（上接B54版）

图1 东吴行业轮动基金股票池构建流程图

资料来源：东吴基金

3、债券投资策略

本基金采取积极的债券投资管理策略。制定具体投资策略自上而下考虑的因素是：基础利率、债券收益率曲线、市场波动、个券的相对价值和套利可能性。与之相对应，本基金分别采取利率预期策略、骑乘收益率策略、相机抉择策略、相对价值策略和套利交易策略。结合投资策略的制定构造债券组合，分别在子弹式组合、梯式组合和杠铃式组合当中进行选择。在债券品种选择上，本基金遵循相对价值原则和流动性原则。现券的相对价值原则指选择到期收益率处于收益率曲线上方的个券，在到期收益率接近的券种之间，选择久期较短者，在久期接近的券种之间，选择凸性较大者；本基金在品种选择上优先考虑流动性高的个券。

4、权证投资策略

本基金权证投资将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，把握市场的短期波动，进行积极操作，追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。具体投资方法如下：

1）考量标的股票合理价值、标的股票价格、行权价格、行权时间、行权方式、股价历史与预期波动率和无风险收益率等要素，估计权证合理价值。

2）根据权证合理价值与其市场价格间的差幅以及权证合理价值对定价参数的敏感性，结合标的股票合理价值考量，决策买入、持有或沽出权证。

十、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准：

本基金整体业绩比较基准=75%*沪深300指数+25%*中证全债指数。

该基金原业绩比较基准“中信标普全债指数”自2015年9月28日变更为“中证全债指数”。更改业绩比较基准的原因是中信标普全债指数于近日停止发布，且更改为中证全债指数的原因是中证全债指数的编制方案以及风险收益情况与中信标普全债指数较相近。

如果指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称、或有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，经与基金托管人协商一致，基金管理人履行相关的程序后，可变更业绩比较基准并及时公告。

十一、基金的风险收益特征

本基金是一只进行主动投资的混合型基金，其风险和预期收益均高于货币市场型基金和债券型基金，低于股票型基金，在证券投资基金中属于风险较高、预期收益较高的基金产品。

十二、基金的投资组合报告

东吴行业轮动混合型开放式证券投资基金(以下简称“本基金”)基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金的托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2015年9月30日（未经审计）。

1、报告期末基金资产组合情况：

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	512,533,329.33	85.20
	其中：股票	512,533,329.33	85.20
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	85,170,283.81	14.16
7	其他资产	3,876,526.84	0.64
8	合计	601,580,139.98	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	6,352,148.10	1.09
C	制造业	370,698,068.63	63.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	5,134,065.00	0.88
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	94,069,282.60	16.10
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	22,745,133.00	3.89
S	综合	13,534,632.00	2.32
	合计	512,533,329.33	87.73

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002488	金固股份	2,228,503	43,121,533.05	7.38
2	002407	多氟多	1,136,600	41,542,730.00	7.11
3	300285	国瓷材料	1,215,474	37,679,694.00	6.45
4	300168	万达信息	1,077,600	32,812,920.00	5.62
5	300261	雅本化学	2,517,920	31,247,387.20	5.35
6	300073	当升科技	1,561,250	31,225,000.00	5.34
7	601799	星宇股份	1,328,460	29,013,566.40	4.97
8	002223	鱼跃医疗	824,130	27,682,526.70	4.74
9	002217	合力泰	2,241,811	27,663,947.74	4.74
10	002405	四维图新	1,049,944	26,406,091.60	4.52

4、报告期末，按券种品种分类的债券投资组合

本基金本报告期未未持有债券。

5、报告期末，按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期未未持有债券。

6、报告期末，按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细：

本基金本报告期未未持有资产支持证券

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期未未持有贵金属投资。

8、报告期末，按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细：

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期未持有股指期货。

9.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期未投资股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1本期国债期货投资政策

本基金本报告期未投资国债期货。

10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

10.3本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

11、投资组合报告附注

1）本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2）基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

3）截至2015年9月30日，其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	3,191,933.39
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	21,151.31
5	应收申购款	663,442.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,876,526.84

4）报告期末，持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期未未持有处于转股期的可转换债券。

5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300168	万达信息	32,812,920.00	5.62	重大资产重组
2	300261	雅本化学	31,247,387.20	5.35	重大事项停牌

6）投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十三、基金的业绩

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

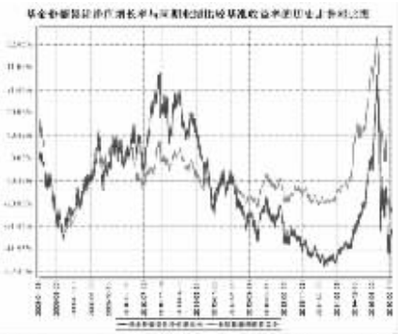
（1） 东吴行业轮动基金历史时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

阶段	净值增长率%①	净值增长率标准差%②	业绩比较基准收益率%③	业绩比较基准收益率标准差%④	①-③	②-④
2008.04.23-2008.12.31	-26.56%	1.63%	-31.79%	2.31%	5.23%	-0.68%
2009.01.01-2009.12.31	42.10%	1.71%	72.60%	1.54%	-30.50%	0.17%
2010.01.01-2010.12.31	19.05%	1.71%	-8.88%	1.19%	27.93%	0.52%
2011.01.01-2011.12.31	-37.26%	1.66%	-17.81%	0.98%	-19.45%	0.68%
2012.01.01-2012.12.31	-2.86%	1.90%	6.67%	0.96%	-9.53%	0.94%
2013.01.01-2013.12.31	-26.13%	1.70%	-5.29%	1.05%	-20.84%	0.65%
2014.01.01-2014.12.31	23.88%	1.21%	41.10%	0.92%	-17.22%	0.29%
2015.01.01-2015.09.30	-5.18%	3.54%	-6.12%	2.03%	0.94%	1.51%
2008.04.23-2015.09.30	-34.03%	1.93%	7.04%	1.40%	-41.34%	0.53%

注：统计截至2015年9月30日，比较基准=75%*沪深300指数+25%*中证全债指数。（该基金原业绩比较基准“中信标普全债指数”自2015年9月28日变更为“中证全债指数”）

（2）东吴行业轮动基金累计净值增长率历史走势图：

自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动进行比较（2008年4月23日至2015年9月30日）



注：东吴行业轮动基金于2008年04月23日成立。（比较基准=75%*沪深300指数+25%*中证全债指数。该基金原业绩比较基准“中信标普全债指数”自2015年9月28日变更为“中证全债指数”）

十四、费用概览

（一）基金运作相关费用

1、管理费：

基金管理费以基金资产净值的1.5%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%年费率计提。

2、托管费：

基金托管费按基金资产净值的0.25%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25% 年费率计提。

3、投资交易费用：

4、银行划汇费用：

5、基金信息披露费用：

6、基金份额持有人大会费用：

7、基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费：

8、基金销售服务费，具体计提办法按中国证监会的具体规定执行：

9、按照国家有关规定的其他费用。

上述第3 项至第9 项费用由本基金管理人向基金托管人发出划款指令后，基金托管人按费用实际支出金额从基金财产中支付，列入当期基金费用。

（二）基金销售相关费用

1、本基金申购费由申购人承担，用于市场推广、销售、登记结算等各项费用。

具体申购费率如下：

申购金额（含申购费）	申购费率
100万元以下	1.5%
100万元以上（含）-200万元以下	1.2%
200万元以上（含）-500万元以下	0.8%
500万元以上（含）	1000元/笔

2、赎回费随基金持有时间的增加而递减，费率如下：

持有时间	赎回费率
1年以内（含1年）	0.5%
1年-2年（含2年）	0.25%
2年以上	0

本基金赎回费由赎回人承担，在投资者赎回基金份额时收取。其中，须依法扣除所收取赎回费总额的25%归入基金资产，其余用于支付登记结算费、销售手续费等各项费用。

3、基金管理人可以调整申购费率、赎回费率或收费方式，并最迟将于新的费率或收费方式开始实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

十五、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，本基金管理人对本基金原招募说明书进行了更新，并根据本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要更新的内容如下：

1、在“重要提示”中，对相关内容进行了更新。

2、在“三、基金管理人”中，对相关内容进行了更新。

3、在“四、基金托管人”中，对相关内容进行了更新。

4、在“五、相关服务机构”中，对相关内容进行了更新。

5、在“九、与基金管理人管理的其他基金转换”中，对相关内容进行了更新。

6、在“十、基金的投资”中，对相关内容进行了更新。

7、在“十一、基金的业绩”中，对相关内容进行了更新。

8、在“二十三、其他应披露事项”中，对相关内容进行了更新：

（1）2015年5月22日在中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告》；

（2）2015年5月29日在中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴行业轮动股票型证券投资基金基金经理变更公告》；

（3）2015年5月29日在中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国农业银行股份有限公司网上银行、手机银行申购费率优惠的公告》；

（4）2015年6月1日在中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告》；

（5）2015年6月4日在中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告》；

（6）2015年6月5日在中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴行业轮动股票型开放式证券投资基金招募说明书以及摘要》；

（7）2015年6月8日在中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金在公司网上交易开展转换费率优惠活动的公告》；

（8）2015年6月8日在中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及参加相台、网上交易申购费率优惠的公告》；

（9）2015年6月9日在中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告》；

（10）2015年6月12日在上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增上海好买基金销售有限公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告》；

（11）2015年6月12日在上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在上海好买基金销售有限公司申购费率及定投申购费率优惠的公告》；

（12）2015年6月26日在上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站等媒体上公告了《关于东吴基金管理有限公司旗下基金参与深圳众禄基金销售有限公司费率优惠活动的公告》；

（13）2015年6月26日在上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加数米基金网费率优惠活动的公告》；

（14）2015年6月26日在上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加浙江同花顺基金销售有限公司费率优惠活动的公告》；

（15）2015年6月29日在上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在交通银行股份有限公司网上银行、手机银行延长基金申购费率优惠的公告》；

（16）2015年6月30日在上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告》；

（17）2015年7月1日在上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司管理的基金2015年半年度资产净值公告》；

（18）2015年7月6日在上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告》；

（19）2015年7月7日在中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告》；

（20）2015年7月7日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金在公司直销柜台开展申购费率优惠活动的公告》；

（21）2015年7月7日在上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于公司及高管、基金经理投资旗下基金相关事宜公告》；

（22）2015年7月8日在中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告》；

（23）2015年7月9日在中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告》；

（24）2015年7月10日在上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告》；

（25）2015年7月15日在中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告》；

（26）2015年7月21日在中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴行业轮动股票型证券投资基金2015年第2季度报告》；

（27）2015年8月7日在中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金关于旗下“东吴行业轮动股票型证券投资基金”变更基金名称、基金类别及修订基金合同相应条款的公告》；

（28）2015年8月7日在公司网站上公告了《东吴行业轮动混合型证券投资基金基金合同、托管协议》；

（29）2015年8月25日在中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告》；

（30）2015年8月25日在上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加天天基金网费率优惠的公告》；

（31）2015年8月26日在中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告》；

（32）2015年8月27日在中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴行业轮动股票型证券投资基金2015年半年度报告以及摘要》；

（33）2015年9月17日在上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增上海汇付金融服务有限公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告》；

（34）2015年9月17日在上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在上海汇付金融服务有限公司申购费率及定投申购费率优惠的公告》；

（35）2015年9月18日在中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告》；

（36）2015年9月24日在上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加好买基金网费率优惠的公告》；

（37）2015年9月28日在中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金关于变更旗下部分开放式基金业绩比较基准并修订基金合同相应条款的公告》；

（38）2015年10月12日在中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告》；

（39）2015年10月20日在上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金参加平安证券有限责任公司基金申购及定期定额投资费率优惠的公告》；

十六、签署日期

本基金更新招募说明书于2015年12月4日签署。

东吴基金管理有限公司

二零一五年十二月四日

上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金清算报告

2015年11月10日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

公告日期：2015年12月4日

一、重要提示

上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“百强ETF”或“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可【2013】125号文核准募集，于2013年4月24日成立并正式运作，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据市场环境变化，为更好地满足投资者需求，保护基金份额持有人的利益，基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，提议本基金终止上市并终止《基金合同》。百强ETF已于2015年10月12日在北京以现场开会方式召开基金份额持有人大会，并表决通过了《关于上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金终止上市并终止基金合同有关事项的议案》，决定终止上市并终止《基金合同》。基金份额持有人大会的表决结果及决议生效的公告详见刊登在2015年10月13日《证券时报》、上海证券交易所网站和基金管理人网站上的《上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

本基金从2015年10月14日起进入清算期，由基金管理人长盛基金管理有限公司、基金托管人中国银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于2015年10月13日组成基金财产清算组履行基金财产清算程序，并由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、基金概况

1、基金名称：上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金（基金简称：长盛上证市值百强ETF，场内简称：百强ETF，基金代码：510700）

2、基金运作方式：交易型开放式

3、基金合同生效日：2013年4月24日

4、2015年10月13日基金份额总额：4,213,677.00份

5、投资目标：本基金跟踪投资标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争实现与标的指数表现相一致的长期收益。

6、标的指数：上证市值百强指数

7、投资策略：本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。本基金跟踪标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%。

7、业绩比较基准：上证市值百强指数

8、风险收益特征：本基金为被动式投资的股票指数型基金，预期收益和风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合风险收益特征相近，属于高风险、高收益的基金品种。

9、基金管理人：长盛基金管理有限公司

10、基金托管人：中国银行股份有限公司

三、基金运作情况概述

本基金经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2013】125号文《关于核准上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准，由基金管理人长盛基金管理有限公司于2013年4月1日至2013年4月17日向社会公开发行募集，基金合同于2013年4月24日正式生效，首次设立募集规模为622,680,523.00份基金份额。自2013年4月24日至2015年10月13日期间，本基金按基金合同正常运作。

根据市场环境变化，为更好地满足投资者需求，保护基金份额持有人的利益，基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《基金合同》的有关规定，提议本基金终止上市并终止《基金合同》。百强ETF已于2015年10月12日在北京以现场开会方式召开基金份额持有人大会，并表决通过了《关于上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金终止上市并终止基金合同有关事项的议案》，决定终止上市并终止《基金合同》。本基金从2015年10月14日起进入清算期。

四、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2015年10月13日

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2015年10月13日
资 产：	?
银行存款	366,060.91
结算备付金	12,777.23
存出保证金	286.57
股票投资	909,315.20
应收利息	171.19
应收申购款	0.00
应收证券清算款	9,773,095.83
资产总计	11,061,706.93
负 债：	
应付管理人报酬	2,007.94
应付托管费	401.59
应付赎回款	0.00
应付交易费用	11,722.44
其他应付款	57,065.22
预提费用	70,000.00
负债合计	141,197.19
所有者权益：	
实收基金	7,578,483.38
未分配利润	3,342,026.36
所有者权益合计	10,920,509.74
负债和所有者权益总计	11,061,706.93

五、清算情况

自2015年10月14日至2015年11月10日止清算期间，基金财产清算组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

1、清算费用

按照《上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金基金合同》中“二十六、基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定，清算费用是指基金财产清算组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

考虑到本基金清算的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金的清算费用将由基金管理人代为支付。

2、资产处置情况

（1）本基金最后运作日结算备付金为人民币12,777.23元，已于2015年11月3日由中国证券登记结算有限责任公司划入托管账户。

（2）本基金最后运作日存出保证金为人民币286.57元，已由基金管理人长盛基金管理有限公司于2015年11月6日以自有资金垫付至托管账户。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

（3）本基金最后运作日应收利息为人民币171.19元，已由基金管理人长盛基金管理有限公司于2015年11月6日以自有资金垫付至托管账户。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

（4）本基金最后运作日应收证券清算款为人民币9,773,095.83元，已于2015年10月14日由中国证券登记结算有限责任公司划入托管账户。

（5）本基金最后运作日持有的股票资产为人民币909,315.20元（最后运作日估值金额），均为最后运作日停牌股票。

①本基金最后运作日（2015年10月13日）持有的全部停牌股票明细为：

序号	股票代码	股票名称	股票数量（股）	停牌价格（人民币元）	最后运作日估值金额（人民币元）
1	600100	同方股份	3,600	15.60	56,160.00
2	600104	上汽集团	7,000	17.77	124,390.00
3	600271	航天信息	1,500	55.91	83,865.00
4	600739	辽宁成大	3,000	15.83	47,490.00
5	600893	中航动力	1,300	40.86	53,118.00
6	600900	长江电力	13,700	14.35	196,595.00
7	601169	北京银行	20,860	8.77	182,942.20
8	601618	中国中冶	12,500	7.79	97,375.00
9	601727	上海电气	6,000	11.23	67,380.00
合计					909,315.20

②清算期间（2015年10月14日至2015年11月10日）复牌股票的处置情况：

1）中航动力（代码：600893）

2015年10月14日复牌，2015年10月15日卖出1,300股，卖出所得金额61,755.00元。

2）同方股份（代码：600100）

2015年10月26日复牌，2015年10月27日卖出3,600股，卖出所得金额64,264.92 元。

3）上汽集团（代码：600104）

2015年11月6日复牌，截止清算期结束日2015年11月10日尚未卖出。

③截止清算期结束日（2015年11月10日），本基金仍持有的股票明细如下：

序号	股票代码	股票名称	股票数量（股）	停牌价格（人民币元）	最后运作日估值金额（人民币元）
1	600104	上汽集团	7,000	17.77	124,390.00
2	600271	航天信息	1,500	55.91	83,865.00
3	600739	辽宁成大	3,000	15.83	47,490.00
4	600900	长江电力	13,700	14.35	196,595.00
5	601169	北京银行	20,860	8.77	182,942.20
6	601618	中国中冶	12,500	7.79	97,375.00
7	601727	上海电气	6,000	11.23	67,380.00
合计					800,037.20

根据本基金2015年9月8日发布的《关于以现场开会方式召开上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告》中附件三《关于上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金终止上市并终止基金合同有关事项的说明》约定，基金进入清算程序后，如有持仓股票停牌，为了最大化保护基金份额持有人利益，提高清算效率，基金管理人将以自有资金按照基金所持有股票资产的停牌价格垫付基金未能变现的股票资产。

截止清算期结束日，本基金持有的股票中，上汽集团（代码：600104）已于2015年11月6日复牌，但尚未卖出变现。基金管理人以自有资金按照基金所持有股票资产的最后运作日估值金额（即停牌价格*持仓数量）垫付基金未能变现的股票资产，并已于2015年11月6日垫付至托管账户共计800,037.20元。待全部股票复牌处置完毕后，若变现金额高于最后运作日估值金额，则差额归基金份额持有人所有，基金管理人将按基金份额持有人持有的基金份额比例追偿给基金份额持有人；若变现金额低于最后运作日估值金额，则由基金管理人承担相应损失。

3、负债清偿情况

（1）本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币2,007.94元，该款项已于2015年10月23日支付。

（2）本基金最后运作日应付托管费为人民币401.59元，该款项已于2015年10月23日支付。

（3）本基金最后运作日应付交易费用为人民币11,722.44元，该款项已于2015年11月5日支付。

（4）本基金最后运作日预提费用为本基金应支付的信息披露费，共计人民币70,000.00元，该款项已于2015年10月23日支付。

（5）本基金最后运作日其他应付款为本基金应支付的指数使用费，共计人民币57,065.22元，该款项已于2015年10月23日支付。

4、清算日的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2015年10月14日至2015年11月10日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入-银行存款利息收入（注1）	5,498.02
2、股票投资收益（注2）	15,662.07
清算收益小计	21,160.09
二、清算费用	
清算费用小计（注3）	-
三、清算净收益	21,160.09

注1：利息收入系以当前适用的利率预估计提的自2015年10月14日至2015年11月10日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息及存出保证金利息。

注2：股票投资收益为清算期间卖出股票金额与最后运作日估值金额以及因卖出股票所产生的补缴股息红利税金额的差额。

注3：经本基金管理人长盛基金管理有限公司确认，本次清算相关的清算费用由本基金管理人承担，不从基金财产中支付。

5、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2015年10月13日基金净资产	10,920,509.74
加：清算期间净收益	21,160.09
二、2015年11月10日基金净资产	10,941,669.83

资产处置及负债清偿后，2015年11月10日本基金剩余财产为人民币10,941,669.83元，根据本基金的基金合同约定，依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

清算起始日2015年10月14日至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息亦属基金份额持有人所有。为便于及时向基金份额持有人分配剩余资产，基金管理人长盛基金管理有限公司以自有资金先行垫付划入托管账户，用以垫付应收利息及结算备付金等。基金管理人所垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人，基金财产清偿完毕之后所产生的其他任何费用亦由基金管理人承担。

本基金的银行存款应收利息为预计金额，可能与实际发生或支付金额存在差异，资产支付时以银行实际结算金额为准。清算过程中基金管理人垫付资金与实际结算金额的尾差由基金管理人承担。

6、基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证券监督管理委员会备案并向基金份额持有人公告。

六、备查文件

1、备查文件目录

（1）上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金2015年10月13日资产负债表及审计报告

（2）《上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金清算报告》的法律意见

2、存放地点

基金管理人的办公场所。

3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金基金财产清算组

2015年11月10日

证券代码：002366 证券简称：台海核电 公告编号：2015-072

台海玛努尔核电设备股份有限公司关于控股股东部分股权质押的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

台海玛努尔核电设备股份有限公司（以下简称"公司"）于2015年12月2日收到公司控股股东烟台市台海集团有限公司（以下简称"台海集团"）关于其所持台海核电部分股权质押的通知，现将有关情况公告如下：

台海集团因其业务发展需要，2015年11月30日，将其持有的公司股份26,000,000股（首发后机构类限售股）质押给中国民生银行股份有限公司烟台分行，用于贷款担保。上述质押的26,000,000股股份已于2015年11月30日在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司办理了股份质押登记手续，质押登记日为2015年11月30日，股份质押期限自质押登记日起至向中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司办理解除质押登记止。

2015年12月1日，台海集团将其持有的公司股份16,000,000股（首发后机构类限售股）质押给中国民生银行股份有限公司成都分行，用于贷款担保。上述质押的16,000,000股股份已于2015年12月1日在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司办理了股份质押登记手续，质押登记日为2015年12月1日，股份质押期限自质押登记日起至向中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司办理解除质押登记止。

截止本公告日，台海集团持有本公司股份182,883,231股，占本公司总股本的42.18%。本次质押的42,000,000股股份占本公司总股本的9.69%，累计质押数量为86,527,559股，占本公司总股本的19.96%，占其所持有的公司股份总数的47.31%。

2015年公司实施了重大资产重组，根据公司与台海集团签署的《利润补偿协议》及《利润补偿协议之补充协议》，交易对方台海集团承诺烟台台海玛努尔核电设备有限公司2015年、2016年、2017年经审计的扣除非经常性损益后的归属于母公司所有者的净利润分别不低于人民币30,394.83万元、50,814.57万元和57,709.79万元。若经审计的承诺利润在盈利预测承诺期内未能达到，则发行股份购买资产的交易对方台海集团应以其所持有的上市公司股份对上市公司进行补偿。

补偿义务：如拟置入资产实际净利润不满足上述承诺，则台海集团以股份方式补偿。若台海集