

华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）
清算报告

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2022年9月23日

§1 重要提示

华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），由华安基金管理有限公司（以下简称“公司”、“本基金管理人”或“基金管理人”）任基金管理人，由中国银行股份有限公司任基金托管人，由华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）转型而来，并经中国证监会证监许可【2018】1030 号文准予注册，本基金自 2019 年 1 月 11 日起正式转型。

根据市场环境变化，为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《华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）基金合同》的有关规定，本基金管理人经与本基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）以通讯方式召开了基金份额持有人大会，并于 2022 年 8 月 29 日表决通过了《关于华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）终止基金合同并终止上市有关事项的议案》，本次基金份额持有人大会决议自该日起生效。根据决议生效公告，本基金最后运作日为 2022 年 8 月 30 日，自 2022 年 8 月 31 日进入清算期。

基金管理人华安基金管理有限公司、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 2022 年 8 月 31 日组成基金财产清算小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。

§2 基金产品概况

| | |
|-------|-----------------------|
| 基金名称 | 华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF） |
| 基金简称 | 华安量化多因子（LOF） |
| 场内简称 | 华安量化 LOF |
| 基金主代码 | 160415 |
| 交易代码 | 160415 |

| | |
|------------------------|---|
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式（LOF） |
| 基金合同生效日 | 2019年1月11日 |
| 基金管理人 | 华安基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 |
| 报告期末（2022年8月30日）基金份额总额 | 6,107,225.36份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 投资目标 | 通过量化选股模型精选具备投资价值的个股，追求资产的长期增值，在严格控制组合风险同时，力争获得稳定的超越业绩比较基准的投资收益。 |
| 投资策略 | 本基金采用多因子量化模型投资策略，综合技术、财务、流动性等多方面指标，精选股票进行投资，优化调整投资组合，力争实现高于业绩比较基准的投资收益和基金资产的长期增值。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。 |

§3 基金运作情况概述

华安量化多因子混合型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)是根据经份额持有人大会表决通过的《关于华安深证300指数证券投资基金(LOF)转型并修改基金合同等相关事项的议案》以及相关法律法规的相关规定，由华安深证300指数证券投资基金(LOF)转型而来。

根据本基金的基金管理人于2019年1月10日发布的《关于华安深证300指

数证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，基金份额持有人大会于 2019 年 1 月 9 日表决通过了《关于华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)转型并修改基金合同等相关事项的议案》，同时根据《关于准予华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)变更注册的批复》(证监许可[2018]1030 号)批复，华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)于 2019 年 1 月 11 日正式转型为华安量化多因子混合型证券投资基金(LOF)。自同日起，《华安量化多因子混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和《华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）托管协议》生效，原《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》和《华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）托管协议》失效。本基金为上市契约型开放式基金，存续期限不定。华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)于《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》失效前经审计的基金资产净值为 21,209,884.44 元，已于《华安量化多因子混合型证券投资基金(LOF)基金合同》生效日全部转为本基金的基金资产净值。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

自《华安量化多因子混合型证券投资基金(LOF)基金合同》生效日至最后运作日期间，本基金正常运作。

根据市场环境变化，为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《华安量化多因子混合型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定，本基金管理人经与本基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，提议终止《华安量化多因子混合型证券投资基金(LOF)基金合同》并终止上市，并召开基金份额持有人大会审议上述事项。根据本基金管理人 2022 年 8 月 30 日发布的《关于华安量化多因子混合型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本次基金份额持有人大会于 2022 年 8 月 29 日表决通过了《关于华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）终止基金合同并终止上市有关事项的议案》，本次基金份额持有人大会决议自该日起生效。根据决议生效公告，本基金最后运作日为 2022 年 8 月 30 日，自 2022 年 8 月 31 日进入清算期。

§4 财务报告

4.1 资产负债表

会计主体：华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2022年8月30日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末 2022年8月30日 (基金最后运作日) |
|-----------------|--------------------------------|
| 资产： | |
| 银行存款 | 8,123,865.31 |
| 结算备付金 | 22,861.74 |
| 存出保证金 | 2,757.15 |
| 交易性金融资产 | - |
| 其中：股票投资 | - |
| 应收清算款 | 1,771,354.66 |
| 应收申购款 | 0.06 |
| 其他资产 | - |
| 资产总计 | 9,920,838.92 |
| 负债和净资产 | |
| 负债： | |
| 应付赎回款 | 55,275.19 |
| 应付管理人报酬 | 17,244.98 |
| 应付托管费 | 2,874.16 |
| 应交税费 | - |
| 其他负债 | 65,448.76 |
| 负债合计 | 140,843.09 |
| 净资产： | |
| 实收基金 | 8,908,150.11 |
| 未分配利润 | 871,845.72 |
| 净资产合计 | 9,779,995.83 |
| 负债和净资产总计 | 9,920,838.92 |

注 1：本清算报表按照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）基金合同》约定的资产估值和会计核算方法及中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作以清算基础编制。于基金最后运作日，所有资产以可收回的金额与原

账面价值孰低计量，负债以预计需要清偿的金额计量。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

注 2：本财务报告已经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师魏佳亮、楼茜蓉签字出具了普华永道中天特审字(2022)第 4532 号标准无保留意见的审计报告。

§5 清算情况

自 2022 年 8 月 31 日至 2022 年 9 月 6 日止清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、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：

5.1 资产处置情况

5.1.1 本基金最后运作日结算备付金为人民币 22,861.74 元，存出保证金为人民币 2,757.15 元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳和上海分公司的最低备付金和结算保证金。该款项由基金管理人华安基金管理有限公司先行垫付，垫款人民币 160,000.00 元已于 2022 年 8 月 31 日划入托管户，垫付资金孳生的利息归华安基金管理有限公司所有。上述垫款将于中国证券登记结算有限责任公司深圳和上海分公司调整结算保证金和最低备付金后退还华安基金管理有限公司。

5.1.2 本基金最后运作日应收清算款为人民币 1,771,354.66 元，为场内股票卖出变现资产，该资产将于次日场内清算交收后划入托管户，向基金份额持有人进行分配。

5.1.3 本基金最后运作日应收申购款为人民币 0.06 元，该款项将于对应的结息日划入托管账户。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 17,244.98 元；应付托管费为人民币 2,874.16 元，已于 2022 年 9 月 2 日支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付赎回款人民币 55,275.19 元，已于 2022 年 8 月 31 日和 9 月 1 日分别支付。

5.2.3 本基金最后运作日其他负债为人民币 65,448.76 元，其中人民币 25,660.62 元为应付佣金，已于 2022 年 9 月 5 日支付；人民币 8.18 元为应付赎回费已于 2022 年 8 月 31 日和 9 月 1 日分别支付；人民币 39,779.96 元为预提 2022 年度财务报表审计费将于本基金年度财务报表审计报告出具后支付，若因本基金终止运作未出具年度财务报表审计报告，冲回该项预提费用产生的收益将按基金份额持有人持有的基金份额比例分配给基金份额持有人。

5.3 清算期间的清算损益情况（2022 年 8 月 31 日至 9 月 6 日）

| 项目 | 清算期间 |
|-------------|--------|
| 一、清算收益 | |
| 1、利息收入（注 1） | 645.27 |
| 2、赎回费收入 | 128.86 |
| 清算收入合计 | 774.13 |
| 二、清算费用 | |
| 其他费用合计（注 2） | - |
| 三、清算净收益 | 774.13 |

注 1：利息收入系计提的自 2022 年 8 月 31 日至 2022 年 9 月 6 日止清算期间的银行存款利息、最低备付金利息、结算保证金利息和申购款利息。该款项将于对应的结息日划入托管账户。

注 2：根据《关于华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本次清算期间产生的清算费用由本基金管理人承担。

5.4 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、基金净资产（最后运作日2022年8月30日） | 9,779,995.83 |
| 加：清算期间净收益 | 774.13 |
| 减：基金赎回款支付 | 455,785.50 |
| 二、基金净资产（2022年9月6日） | 9,324,984.46 |

根据本基金的基金合同及《关于华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》的约定，将基金财产清算后的全部剩余财产扣除基金财产清算费用、缴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。

5.5 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，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、基金合同等规定及时进行分配。

§6 备查文件目录

6.1 备查文件目录

- 1、华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）清算财务报表及审计报告
- 2、关于《华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）清算报告》的法律意见

6.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站（<http://www.huaan.com.cn>）、中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>），清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

6.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站、中国证监会基金电子披露网站查阅，或

在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）
基金财产清算小组

二〇二二年九月六日（清算报告出具日）