

# 华安中证高分红指数增强型证券投资基金 清算报告

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：华夏银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年五月二十一日

## §1 重要提示

华安中证高分红指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”),系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[2014]924号《关于准予华安中证高分红指数增强型证券投资基金注册的批复》的核准,由华安基金管理有限公司作为管理人自2014年10月13日至2014年11月12日止期间向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2014)验字第60971571\_B11号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2014年11月14日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为华安基金管理有限公司,基金托管人为华夏银行股份有限公司。

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《华安中证高分红指数增强型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的有关规定,提议终止《基金合同》。华安中证高分红指数增强型证券投资基金已连续60个工作日基金资产净值低于人民币5,000万元。为维护基金份额持有人利益,根据本基金基金合同的约定,不需召开基金份额持有人大会,本基金管理人决定本基金最后运作日为2015年12月7日,自2015年12月8日进入清算期。

由基金管理人华安基金管理有限公司、基金托管人华夏银行股份有限公司、安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市通力律师事务所于2015年12月8日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由安永华明会计师事务所(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

基金简称	华安中证高分红指数增强
基金主代码	000820
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年11月14日
报告期末(2015年12月7日)基金份额总额	3,995,131.00份
投资目标	本基金为增强型股票指数基金,在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上,通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制,力争实现超越标的指数的投资收益,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	基金主要采用指数增强的方式进行投资,将绝大多数基金资产投资于中证高分红指数的成分股及备选

	成分股。同时采取宏观因子和技术情绪进行量化构建模型，通过模型信号进行一定的择时操作，达到获取较高股票分红和超越传统指数收益的双重目标。	
业绩比较基准	95%×中证高分红指数收益率+5%×同期商业银行税后活期存款基准利率	
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	华夏银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华安中证高分红指数增强A类	华安中证高分红指数增强C类
下属分级基金的交易代码	000820	000821
报告期末(2015年12月7日)下属分级基金的份额总额	564,347.26份	3,430,783.74份

### §3 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[2014]924号文《关于准予华安中证高分红指数增强型证券投资基金注册的批复》准予注册，由华安基金管理有限公司作为管理人于2014年10月13日至2014年11月12日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2014）验字第60971571\_B11号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2014年11月14日生效，首次设立募集规模为635,960,218.56份基金份额。自2014年11月14日至2015年12月7日期间，本基金按基金合同正常运作。

为适应市场环境变化，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，提议终止《基金合同》。华安中证高分红指数增强型证券投资基金已连续60个工作日基金资产净值低于人民币5,000万元。为维护基金份额持有人利益，根据本基金基金合同的约定，不需召开基金份额持有人大会，本基金管理人决定本基金最后运作日为2015年12月7日，自2015年12月8日进入清算期。

### §4 财务报告

资产负债表

会计主体：华安中证高分红指数增强型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 7 日

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2015年12月7日
<b>资 产：</b>	
银行存款	4,016,139.03
存出保证金	6,989.82
交易性金融资产	6,722.84
应收利息	7,125.45
资产总计	4,036,977.14
负债和所有者权益	最后运作日 2015年12月7日
<b>负 债：</b>	
应付赎回款	223,433.08
应付管理人报酬	780.24
应付托管费	117.03
应付销售服务费	265.97
应付交易费用	27,722.90
其他负债	37,042.29
负债合计	289,361.51
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	3,995,131.00
未分配利润	-247,515.37
所有者权益合计	3,747,615.63
负债和所有者权益总计	4,036,977.14

注：本财务报告已经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师郭杭翔、濮晓达签字出具了安永华明安永华明（2015）专字第 60971571\_B03 号标准无保留意见的审计报告。

## §5 基金财产分配

## 5.1 清算费用

按照《华安中证高分红指数增强型证券投资基金基金合同》第十九部分“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财产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。

## 5.2 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12月7日基金净资产	3,747,615.63
加：清算期间净收益	610.53
减：基金净赎回转出金额（于2015年12月8日 确认的投资者赎回转出申请）	16,205.50
二、2015年12月15日基金净资产	3,732,020.66

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。

资产处置及负债清偿后，本基金截至 2015 年 12 月 15 日止的剩余财产为人民币 3,732,020.66 元，其中包括本基金管理人为了最大化保护基金份额持有人的利益而根据本基金所持停牌股票（建发股份）及未出售股票（中国中冶）最后运作日的估值价格垫付的等价现金。待该等股票变现后，若其变现金额高于该等股票最后运作日的估值价格，则该差额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，若变现金额小于该等股票最后运作日的估值价格，则由基金管理人承担相应损失。

截至 2015 年 12 月 15 日止，经基金管理人以及基金托管人确认，本基金托管账户银行存款余额共人民币 3,760,574.65 元，其中人民币 50,000.00 元系基金管理人代垫的存出保证金、按照最后运作日估值价格垫付基金未能变现的股票资产以及以当前适用的利率预估的银行存款及存出保证金利息。

本基金的银行存款应收利息和结算备付金利息，以及清算期间的银行划付手续费均为预计金额，可能与实际发生或支付金额存在差异，支付时以银行实际结算金额为准。清算过程中各项利息及费用与实际结算金额的尾差由管理人承担。

若本基金后续清算，出现账面剩余资产不足以支付相关负债的，基金管理人<sup>有义务</sup>于收到基金托管人通知后当日内将款项补足。

### **5.3 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。

## §6 备查文件

### 6.1 备查文件目录

- 1、华安中证高分红指数增强型证券投资基金 2015 年 12 月 7 日资产负债表及审计报告
- 2、《华安中证高分红指数增强型证券投资基金清算报告》的法律意见

### 6.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

### 6.3 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。

华安中证高分红指数增强型证券投资基金基金财产清算小组

二〇一六年五月二十一日