

华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF） 更新的招募说明书摘要

（2019 年第 1 号）

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

二零一九年八月

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”）由华安深证300指数证券投资基金（LOF）转型而来，并经中国证监会2018年6月25日证监许可【2018】1030号文准予注册。自2019年1月11日起，《华安深证300指数证券投资基金（LOF）基金合同》失效，《华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效，华安深证300指数证券投资基金（LOF）正式转型为华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值、收益和市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资者购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

本基金在投资运作过程中可能面临各种风险，包括但不限于市场风险、管理风险、流动性风险、资产配置风险、技术风险、道德风险、合规风险、不可抗力风险、本基金的特定风险等。

基金资产投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于退市风险、市场风险、流动性风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，基金资产并非必然投资于科创板股票。

本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金。

本基金主要采用量化模型构建股票投资组合，但并不基于量化策略进行频繁交易。本基金投资过程中的多个环节，将依赖于量化模型，存在量化模型失效，

导致基金业绩表现不佳的风险。

投资者应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

本招募说明书摘要中涉及与基金托管人相关的基金信息已经与基金托管人复核。除特别说明外，本招募说明书摘要所载内容截止日为2019年7月11日，有关财务数据和净值表现截止日为2019年6月30日。

目录

一、基金管理人.....	2
二、基金托管人.....	7
三、相关服务机构.....	8
四、基金的名称.....	33
五、基金的类型.....	33
六、基金的投资目标.....	33
七、基金的投资方向.....	33
八、基金的投资策略.....	34
九、基金的业绩比较基准.....	37
十、基金的风险收益特征.....	37
十一、基金的投资组合报告.....	38
十二、基金的业绩.....	43
十三、费用概览.....	44
十四、对招募说明书更新部分的说明.....	47

一、基金管理人

一、基金管理人概况

- 1、名称：华安基金管理有限公司
- 2、住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期31-32层
- 3、办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期31-32层
- 4、法定代表人：朱学华
- 5、成立日期：1998年6月4日
- 6、批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]20号
- 7、联系电话：（021）38969999
- 8、联系人：王艳
- 9、客户服务中心电话：40088-50099
- 10、网址：www.huaan.com.cn

二、注册资本和股权结构

- 1、注册资本：1.5亿元人民币
- 2、股权结构

持股单位	持股占总股本比例
国泰君安证券股份有限公司	20%
上海上国投资产管理有限公司	20%
上海锦江国际投资管理有限公司	20%
上海工业投资（集团）有限公司	20%
国泰君安投资管理股份有限公司	20%

三、主要人员情况

- 1、基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员
 - (1) 董事会

朱学华先生，本科学历。历任武警上海警卫局首长处副团职参谋，上海财政证券有限公司党总支副书记，上海证券有限责任公司党委书记、副董事长、副总经理、工会主席，兼任海际大和证券有限责任公司董事长。现任华安基金管理有限公司党总支书记、董事长、法定代表人。

童威先生，博士研究生学历。历任上海证券有限责任公司研究发展中心总经理，上海国际集团有限公司研究发展总部副总经理（主持工作），上投摩根基金管理有限公司副总经理，上海国际集团有限公司战略发展总部总经理兼董事会办公室主任，华安基金管理有限公司副总经理。现任华安基金管理有限公司总经理。

邱平先生，本科学历，高级政工师职称。历任上海红星轴承总厂党委书记，上海东风机械（集团）公司总裁助理、副总裁，上海全光网络科技股份有限公司总经理，上海赛事商务有限公司总经理，上海东浩工艺品股份有限公司董事长，上海国盛集团科教投资有限公司党委副书记、总裁、董事，上海建筑材料（集团）总公司党委书记、董事长（法定代表人）、总裁。现任上海工业投资（集团）有限公司党委副书记、执行董事（法定代表人）、总裁。

马名驹先生，工商管理硕士，高级会计师。历任凤凰股份有限公司副董事长、总经理，上海东方上市企业博览中心副总经理，锦江国际（集团）有限公司计划财务部经理。现任锦江国际（集团）有限公司副总裁兼金融事业部总经理、上海锦江国际投资管理有限公司董事长兼总经理、锦江麦德龙现购自运有限公司董事、华安基金管理有限公司董事、长江养老保险股份有限公司董事、上海景域文化传播股份有限公司董事、Crystal Bright Developments Limited 董事、史带财产保险股份有限公司监事、上海上国投资资产管理有限公司监事。

聂小刚先生，经济学博士。历任国泰君安证券股份有限公司投资银行三部助理业务董事、企业融资总部助理业务董事、总裁办公室主管、总裁办公室副经理、营销管理总部副经理、董事会秘书处主任助理、董事会秘书处副主任、董事会秘书处主任、上市办公室主任、国泰君安创新投资有限公司总裁、国泰君安证券股份有限公司战略投资部总经理、权益投资部总经理、战略投资部总经理等职务。现任国泰君安证券股份有限公司战略投资及直投业务委员会副总裁、战略管理部总经理、国泰君安证裕投资有限公司董事长、总经理、中国证券业协会投资业务

委员会副主任委员。

夏则炎先生，本科学历。历任国泰证券有限公司基金管理部业务员、交易部业务员、业务管理部项目经理、管理部综合处副经理；国泰君安证券股份有限公司经纪业务部副经理、董事会办公室副经理、经纪业务总部经理、营销管理总部经理、上海福山路营业部副总经理（主持工作）、上海福山路营业部总经理、上海分公司副总经理、经纪业务委员会综合管理组副组长、经纪业务委员会执行办公室主任、零售业务部总经理。现任国泰君安证券销售交易部总经理。

独立董事：

吴伯庆先生，大学学历，一级律师，曾被评为上海市优秀律师与上海市十佳法律顾问。历任上海市城市建设局秘书科长、上海市第一律师事务所副主任、上海市金茂律师事务所主任、上海市律师协会副会长。现任上海市金茂律师事务所高级合伙人。

夏大慰先生，研究生学历，教授。现任上海国家会计学院学术委员会主任、教授、博士生导师，中国工业经济学会副会长，财政部会计准则委员会咨询专家，财政部企业内部控制标准委员会委员，香港中文大学名誉教授，复旦大学管理学院兼职教授，上海证券交易所上市委员会委员。享受国务院政府津贴。

（2）监事会

张志红女士，经济学博士。历任中国证监会上海监管局(原上海证管办)机构处副处长、机构监管处副处长、机构监管处处长、机构监管一处处长、上市公司监管一处处长等职务，长城证券有限责任公司党委委员、纪委书记、预算管理委员会委员、合规总监、副总经理、投资决策委员会委员，国泰君安证券股份有限公司总裁助理、业务总监、投行业务委员会副总裁等职务。现任国泰君安证券股份有限公司合规总监，华安基金管理有限公司监事长。

许诺先生，硕士。曾任怡安翰威特咨询业务总监，麦理根（McLagan）公司中国区负责人。现任华安基金管理有限公司总经理助理兼人力资源部高级总监，华安资产管理（香港）有限公司董事。

诸慧女士，研究生学历，经济师。历任华安基金管理有限公司监察稽核部高级监察员，集中交易部总监。现任华安基金管理有限公司集中交易部高级总监。

（3）高级管理人员

朱学华先生，本科学历，20 年证券、基金从业经验。历任武警上海警卫局首长处副团职参谋，上海财政证券有限公司党总支副书记，上海证券有限责任公司党委书记、副董事长、副总经理、工会主席，兼任海际大和证券有限责任公司董事长。现任华安基金管理有限公司党总支书记、董事长、法定代表人。

童威先生，博士研究生学历，17 年证券、基金从业经验。历任上海证券有限责任公司研究发展中心总经理，上海国际集团有限公司研究发展总部副总经理（主持工作），上投摩根基金管理有限责任公司副总经理，上海国际集团有限公司战略发展总部总经理兼董事会办公室主任，华安基金管理有限公司副总经理。现任华安基金管理有限公司总经理。

薛珍女士，硕士研究生学历，18 年证券、基金从业经验。曾任华东政法大学副教授，中国证监会上海证管办机构处副处长，中国证监会上海监管局法制工作处处长。现任华安基金管理有限公司督察长。

翁启森先生，硕士研究生学历，24 年金融、证券、基金行业从业经验。历任台湾富邦银行资深领组，台湾 JP 摩根证券投资经理，台湾摩根投信基金经理，台湾中信证券自营部协理，台湾保德信投信基金经理，华安基金管理有限公司全球投资部总监、基金投资部兼全球投资部高级总监、公司总经理助理。现任华安基金管理有限公司副总经理、首席投资官。

姚国平先生，硕士研究生学历，15 年金融、基金行业从业经验。历任香港恒生银行上海分行交易员，华夏基金管理有限公司上海分公司区域销售经理，华安基金管理有限公司上海业务部助理总监、机构业务总部高级董事总经理、公司总经理助理。现任华安基金管理有限公司副总经理。

谷媛媛女士，硕士研究生学历，19 年金融、基金行业从业经验。历任广发银行客户经理，京华山一国际（香港）有限公司高级经理，华安基金管理有限公司市场业务二部大区经理、产品部高级董事总经理、公司总经理助理。现任华安基金管理有限公司副总经理。

2、本基金基金经理

孙晨进先生，硕士研究生，8 年基金行业从业经验，具有基金从业资格证书。2010 年应届毕业生进入华安基金，先后担任指数投资部数量分析师、投资经理、基金经理助理。2015 年 3 月至 2019 年 1 月，担任华安深证 300 指数证券投资基

金（LOF）的基金经理。2019年1月起，同时担任本基金的基金经理。2015年3月至2015年12月，同时担任华安中证高分红指数增强型证券投资基金的基金经理。2016年12月起，同时担任华安事件驱动量化策略混合型证券投资基金的基金经理。2017年1月起，同时担任华安新安平灵活配置混合型证券投资基金、华安新泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年12月起同时担任华安沪深300量化增强型指数证券投资基金的基金经理。

马丁先生，博士研究生，3年证券基金行业从业经验。曾任国泰君安证券股份有限公司分析师。2018年1月加入华安基金，担任指数与量化投资部基金经理助理。2019年3月起，担任本基金的基金经理。

历任基金经理：

许之彦先生，2011年9月2日至2019年3月29日担任本基金基金经理。

3、基金管理人采取集体投资决策制度，公司投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

童威先生，总经理

翁启森先生，副总经理、首席投资官

杨明先生，投资研究部高级总监

许之彦先生，总经理助理、指数与量化投资部高级总监

贺涛先生，固定收益部总监

苏圻涵先生，全球投资部副总监

万建军先生，投资研究部联席总监

谢振东先生，基金投资部副总监

崔莹先生，基金投资部助理总监

上述人员之间不存在近亲属关系。

4、业务人员的准备情况：

截至2019年6月30日，公司目前共有员工358人（不含香港公司），其中57.5%具有硕士及以上学历，92.7%以上具有三年证券业或五年金融业从业经历，具有丰富的实际操作经验。所有上述人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。公司业务由投资研究、市场营销、合规风控、后台支持等四个业务板块组成。

二、基金托管人

一、基金托管人基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：陈四清

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

二、基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

三、证券投资基金托管情况

截至2019年3月31日，中国银行已托管710只证券投资基金，其中境内基金670只，QDII基金40只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

三、相关服务机构

一、基金销售机构

1、场外销售机构

(1) 直销机构

1) 华安基金管理有限公司上海业务部

地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 31 层

电话：(021) 38969773

传真：(021) 58406138

联系人：姚佳岑

2) 华安基金管理有限公司北京分公司

地址：北京市西城区金融街 7 号英蓝国际金融中心 522 室

电话：(010) 57635999

传真：(010) 66214061

联系人：刘雯

3) 华安基金管理有限公司广州分公司

地址：广州市天河区珠江西路 8 号高德置地夏广场 D 座 504 单元

电话：(020) 38082891

传真：(020) 38082079

联系人：林承壮

4) 华安基金管理有限公司西安分公司

地址：西安市碑林区南关正街 88 号长安国际中心 A 座 706 室

电话：(029) 87651812

传真：(029) 87651820

联系人：赵安平

5) 华安基金管理有限公司成都分公司

地址：成都市人民南路四段 19 号威斯顿联邦大厦 12 层 1211K-1212L

电话：(028) 85268583

传真：(028) 85268827

联系人：张晓帆

6) 华安基金管理有限公司沈阳业务部

地址：沈阳市沈河区北站路 59 号财富中心 E 座 2103 室

电话：(024) 22522733

传真：(024) 22521633

联系人：杨贺

7) 华安基金管理有限公司深圳业务部

地址：深圳福田区金田路 2030 号卓越世纪中心 3 号楼 2008 室

邮编：518000

电话：0755-82755911

联系人：唐硕

8) 华安基金管理有限公司江苏业务部

地址：南京市中山南路 49 号商茂世纪广场 19D2

电话：025-86890489

联系人：李展

9) 华安基金管理有限公司华东业务部

地址：福建福州鼓楼区五四路 151 号宏远帝豪国际大厦 2307 室

电话：0591-87831775

联系人：王枫

10) 华安基金管理有限公司电子交易平台

华安电子交易网站：www.huaan.com.cn

智能手机 APP 平台：iPhone 交易客户端、Android 交易客户端

华安电子交易热线：40088-50099

传真电话：(021) 33626962

联系人：谢伯恩

(2) 其他除基金管理人以外的销售机构

(1) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：彭纯

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

(2) 中国银行股份有限公司

注册地址：中国北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：中国北京市西城区复兴门内大街 1 号

客户服务电话：95566

网址：www.boc.cn

(3) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：中国北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：中国北京市西城区复兴门内大街 55 号

客户服务电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

(4) 中国农业银行股份有限公司

注册地址：中国北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：周慕冰

客户服务电话：95599

网址：www.abchina.com

(5) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

(6) 招商银行股份有限公司

注册地址：中国广东省深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：李建红

客户服务电话：95555

网址：www.cmbchina.com

(7) 中信银行股份有限公司

注册地址：中国北京市东城区朝阳门北大街 9 号

办公地址：中国北京市东城区朝阳门北大街 9 号

法定代表人：李庆萍

客户服务电话：95558

网址：bank.ecitic.com

(8) 兴业银行股份有限公司

注册地址：福建省福州市湖东路 154 号中山大厦

法定代表人：高建平

客户服务电话：95561

网址：www.cib.com.cn

(9) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：中国北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

客户服务电话：95568

网址：www.cmbc.com.cn

(10) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 3 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：李国华

客户服务电话：95580

公司网址：www.psbc.com

(11) 华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号华夏银行大厦

法定代表人：李民吉

客户服务电话：95577

网址：www.hxb.com.cn

(12)上海银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路 168 号

办公地址：上海市银城中路 168 号

法定代表人：金煜

客户服务电话：(021) 95594

网址：www.bankofshanghai.com

(13)平安银行股份有限公司

注册地址：中国深圳市深南中路 5047 号

法定代表人：谢永林

客户服务电话：95511

网址：bank.pingan.com

(14)浙商银行股份有限公司

注册地址：杭州市庆春路 288 号

办公地址：杭州市庆春路 288 号

法定代表人：沈仁康

客户服务电话：95527

网址：www.czbank.com

(15)渤海银行股份有限公司

注册地址：天津市河西区马场道 201-205 号

法定代表人：李伏安

客户服务电话：400-888-8811

网址：www.cbhb.com.cn

(16)乌鲁木齐市商业银行股份有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市新华北路 8 号

法定代表人：杨黎

客户服务电话：(0991) 96518

网址：www.uccb.com.cn

(17)国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市静安区新闻路 669 号

法定代表人：杨德红

客户服务电话：95521

网址：www.gtja.com

(18)中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

客户服务电话：0755-23835888

网址：www.cs.ecitic.com

(19)中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

法定代表人：陈共炎

客户服务电话：95551/4008-888-888

网址：www.chinastock.com.cn

(20)海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：周杰

客户服务电话：4008888001/95553

网址：www.htsec.com

(21)申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

法定代表人：李梅

客户服务电话：(021) 96250500

网址：www.swhysc.com

(22)兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号证券大厦
办公地址：福州市湖东路 268 号证券大厦；
上海市浦东新区长柳路 36 号丁香国际东塔 21 楼
法定代表人：杨华辉
客户服务电话：95562
网址：www.xyzq.com.cn

(23)湘财证券股份有限公司

注册地址：长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼
办公地点：长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼
法定代表人：孙永祥
客户服务电话：95351/400-888-1551
网址：www.xcsc.com

(24)民生证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层
办公地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层
法定代表人：冯鹤年
客户服务电话：4006198888
网址：www.msyzq.com

(25)山西证券股份有限公司

注册地址：太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼
办公地址：太原市府西街 69 号山西国际贸易中心 A 座 26—30 层
法定代表人：侯巍
客户服务电话：95573
网址：http://www.i618.com.cn

(26)东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州市工业园区星阳街 5 号
办公地址：苏州市工业园区星阳街 5 号
法定代表人：范力
客户服务电话：95330

网址：www.dwzq.com.cn

(27)信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址：北京西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：张志刚

客户服务电话：95321

网址：www.cindasc.com

(28)东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25层-29层

办公地址：上海市中山南路318号2号楼21层-23层、25层—29层、32、36、39、40层

法定代表人：潘鑫军

客户服务电话：95503

网址：www.dfzq.com.cn

(29)光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路1508号

办公地址：上海市静安区新闻路1508号

法定代表人：周健男

客户服务电话：95525、4008888788

网站：www.ebscn.com

(30)广州证券股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层

办公地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层

法定代表人：张永衡

客户服务电话：95396

网址：www.gzs.com.cn

(31)上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区四川中路213号7楼

办公地址：上海市黄浦区四川中路213号7楼

法定代表人：李俊杰

客户服务电话：4008918918

网址：www.shzq.com

(32)新时代证券股份有限公司

注册地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

办公地址：北京市海淀区北三环西路 99 号西海国际中心 1 号楼 15 层

法定代表人：叶顺德

客户服务电话：400-698-9898

网址：www.xsdzq.cn

(33)平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路荣超大厦 4036 号 16-20

办公地址：深圳市福田区中心区金田路荣超大厦 4036 号 16-20

法定代表人：何之江

电话：4008866338

客户服务电话：95511-8

网址：stock.pingan.com

(34)东莞证券股份有限公司

注册地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号

办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

法定代表人：陈照星

客户服务电话：0769-95328

网址：www.dgzq.com.cn

(35)中原证券股份有限公司

注册地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号

办公地址：河南省郑州市郑东新区商务外环路 10 号

法定代表人：菅明军

客户服务电话：95377

网址：www.ccnew.com

(36)国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层、10层

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层、10层

客户服务电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

(37)国盛证券有限责任公司

联系地址：江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道1115号北京银行大楼

注册地址：南昌市北京西路88号江信国际金融大厦

客户服务电话：4008222111

网址：www.gszq.com

(38)中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市经七路86号

办公地址：山东省济南市经七路86号

法定代表人：李玮

客户服务电话：95538

网址：<http://www.zts.com.cn/>

(39)中航证券有限公司

注册地址：南昌市红谷中大道1619号南昌国际金融大厦A栋41层

办公地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号南昌国际金融大厦

A栋41层

法定代表人：王晓峰

客户服务电话：4008866567

网址：www.avicsec.com

(40)西部证券股份有限公司

注册地址：陕西省西安市新城东大街319号8幢10000室

办公地址：陕西省西安市新城东大街319号8幢10000室

法定代表人：刘建武

客户服务电话：95582

网址：www.westsecu.com.cn

(41)华福证券有限责任公司

注册地址：福州市鼓楼区温泉街道五四路 157 号 7-8 层

办公地址：福州市鼓楼区温泉街道五四路 157 号 7-8 层

法定代表人：黄金琳

客户服务电话：0591-96326

网址：www.hfzq.com.cn

(42) 中国国际金融股份有限公司

注册地址：中国北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 6 层、26 层、27 层及 28 层

法定代表人：丁学东

客户服务电话：(010) 65051166

网址：www.cicc.com.cn

(43) 瑞银证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层

办公地址：北京西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层

法定代表人：钱于军

客户服务电话：400-887-8827

网址：www.ubssecurities.com

(44) 中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋 4 层、18-21 层

办公地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋 4 层、18-21 层

法定代表人：高涛

客服电话 400-600-8008, 95532

网址：www.china-invs.cn

(45) 中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层

办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层

法定代表人：林炳城

客户服务电话：4001022011

网址：www.zszq.com.cn

(46)江海证券有限公司

注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市松北区创新三路 833 号

法定代表人：赵洪波

客户服务电话：40066-62288

网址：www.jhzq.com.cn

(47)国金证券股份有限公司

注册地址：成都市东城根上街 95 号

办公地址：成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

客户服务电话：95310

网址：www.gjq.com.cn

(48)华宝证券有限责任公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层

法定代表人：陈林

客户服务电话：4008209898

网址：www.cnhbstock.com

(49)厦门证券有限公司

注册地址：福建省厦门市思明区莲前西路 2 号莲富大厦 17 楼

办公地址：厦门市思明区莲前西路 2 号莲富大厦 17 楼

法定代表人：傅毅辉

客户服务电话：（0592）5163588

网址：www.xmzq.com.cn

(50)中天证券股份有限公司

注册地址：沈阳市和平区光荣街 23 甲

办公地址：沈阳市和平区光荣街 23 甲

法定代表人：马功勋

客户服务电话：4006180315

网址：www.iztzq.com

(51)天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人：林义相

客户服务电话：(010) 66045678

网址：www.txsec.com/ jijin.txsec.com

(52)上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号 903-906 室

法定代表人：杨文斌

电话：400-700-9665

网址：www.ehowbuy.com

(53)上海天天基金销售有限公司

注册地址：浦东新区峨山路 613 号 6 幢 551 室

办公地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼东方财富大厦 2 楼

法定代表人：其实

电话：4001818188

网址：www.1234567.com.cn

(54)蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号 12 楼

法定代表人：陈柏青

电话：4000-766-123

网址：www.fund123.cn

(55)上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层

法定代表人：张跃伟

客户服务电话：400-820-2899

网址：www.e-rich.com.cn

(56)诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号东码头园区 C 栋 2 楼

法定代表人：汪静波

电话：400-821-5399

网址：www.noah-fund.com

(57)浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

办公地址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 楼

法定代表人：易峥

客服电话：0571-88920897 4008-773-772

网址：www.5ifund.com

(58)北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层

法定代表人：闫振杰

客户服务电话：4008886661

网址：www.myfp.cn

(59)浦领基金销售有限公司（原众升财富（北京）基金销售有限公司）

注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 3201 内 3201 单元

办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院盘古大观 A 座 3201

法定代表人：李招弟

电话：400-876-9988

网址：www.wy-fund.com

(60)深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

电话：4006-788-887

网址：www.zlfund.cn www.jjmmw.com

(61)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道民田路 178 号华融大厦 27 层 2704

办公地址：深圳市福田区福田街道民田路 178 号华融大厦 27 层 2704

法定代表人：马勇

客服电话：4001161188

公司网站：<https://8.jrj.com/>

(62)一路财富（北京）信息科技有限公司

地址：北京市西城区阜成门外大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

法定代表人：吴雪秀

客服电话：4000011566

网址：www.yilucaifu.com

(63)北京恒天明泽基金销售有限公司

地址：北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层

法定代表人：梁越

客服电话：4008980618

网址：www.chtfund.com/

(64)海银基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区东方路 1217 号 16 楼 B 单元

办公地址：上海市浦东新区东方路 1217 号 16 楼 B 单元

法定代表人：刘惠

客户服务电话：400-808-1016

网址：<http://www.fundhaiyin.com>

(65)上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：胡学勤

客服电话：400-866-6618

网址：www.lu.com

(66)北京虹点基金销售有限公司

地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 16 层 1603

法定代表人：董浩

客户服务电话: 400-068-1176

网址: www.jimufund.com

(67) 深圳富济基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾路 1 号 A 栋 201 室

办公地址：深圳市南山区高新南七道惠恒集团二期 418 室

法定代表人：齐小贺

客户服务电话:0755-83999913

网址: www.jinqianwo.cn

(68)上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 号楼 3 层

法定代表人：燕斌

客户服务电话: 400-046-6788

网址: www.66zichan.com

(69) 珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室—3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道 1 号宝利国际广场南塔 12 楼

法定代表人：肖雯

客户服务电话: 020-89629066

网站: www.yingmi.cn

(70) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司

地址：北京市宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层

法定代表人：彭运年

客户服务电话：4008909998

网址：www.jnlc.com

(71) 北京加和基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街 4 号 5 号楼 1 层

办公地址：北京市西城区车公庄大街 4 号 5 号楼 1 层

法定代表人：徐福星

客户服务电话：400-600-0030

公司网址：www.bzfunds.com

(72) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦
20 楼 2005 室

办公地址：

新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

法定代表人：韩志谦

客户服务电话：4008000562

公司网址：www.swhysc.com

(73) 东莞农村商业银行股份有限公司

注册地址：广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号

办公地址：广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号

法定代表人：何沛良

客户服务电话：0769-961122

网址：www.drcbank.com

(74) 奕丰基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入住深圳
市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座 1115 室，1116 室及 1307
室

法定代表人：TAN YIK KUAN

联系人：叶健

客户服务电话：400-684-0500

公司网站：www.ifastps.com.cn

（75）中信期货有限公司

地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层

法定代表人：张皓

客户服务电话：400-990-8826

网址：www.citicsf.com

（76）江苏常熟农村商业银行股份有限公司

地址：江苏省常熟市新世纪大道58号

法定代表人：宋建明

客户服务电话：4009962000、0512-962000 或前往常熟农商银行各营业网点进行咨询。

网址：www.csrcbank.com

（77）北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

办公地址：北京市朝阳区创远路34号院融新科技中心C座17层

邮编：100102

法定代表人：钟斐斐

客户服务电话：4000618518

网站：https://danjuanapp.com/

（78）上海大智慧基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元

法定代表人：申健

客服电话：021-20292031

网址：https://www.wg.com.cn/

（79）北京创金启富投资管理有限公司

注册地址：北京市西城区民丰胡同 31 号中水大厦 215A

办公地址：北京市西城区民丰胡同 31 号中水大厦 215A

法定代表人：梁蓉

客户服务电话：400-6262-818

公司网址：www.5irich.com

（80）北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层 1108 号

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层

法定代表人：王伟刚

客户服务电话：400-619-9059

公司网址：www.hcjijin.com

（81）宁波银行股份有限公司

地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

客户服务电话：95574

网址：www.nbc.com.cn

（82）上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人：王廷富

客户服务电话：400-821-0203

（83）北京电盈基金销售有限公司

法定代表人：程刚

住所：北京市朝阳区呼家楼(京广中心)1 号楼 36 层 3603 室

电话：400-100-3391

网址：<http://www.dianyingfund.com/>

（84）上海有鱼基金销售有限公司

法定代表人：林琼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东大道 2123 号 3 层 3E-2655 室

客服电话：021-60907378

网址：<http://www.youyufund.com/>

（85）北京植信基金销售有限公司

地址：北京市密云区兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室-67

法定代表人：于龙

网站网址：www.zhixin-inv.com

客服联系方式：4006-802-123

（86）上海挖财基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 楼

法定代表人：胡燕亮

客户服务电话：021-50810673

网址：www.wacaijijin.com

（87）福建海峡银行股份有限公司

注册地址：福州市台江区江滨中大道 358 号福建海峡银行

办公地址：福州市台江区江滨中大道 358 号福建海峡银行

法定代表人：俞敏

客户服务热线：400-893-9999

公司网站：www.fjhxbank.com

（88）嘉实财富管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼

二期 53 层 5312-15 单元

法定代表人：赵学军

客户服务电话：4000218850

公司网站：www.harvestwm.cn

（89）北京唐鼎耀华基金销售有限公司

注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 19 号 A 座 1504/1505 室

法定代表人：张冠宇

客服电话:400-819-9868

网址:<http://www.tdyhfund.com/>

(90) 厦门市鑫鼎盛控股有限公司

注册地址：厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场西座 1501-1504 室

办公地址：厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场西座 1501-1504 室

法定代表人：陈洪生

客服热线：400-918-0808

公司网址：www.xds.com.cn

(91) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）

法定代表人：王翔

联系电话：021-65370077

公司网站：www.jiyufund.com.cn/

客户服务电话：400-820-5369

(92) 泛华普益基金销售有限公司

注册地址：成都市成华区建设路 9 号高地中心 1101 室

法定代表人：于海锋

客户服务电话：4008-588-588

网址：www.puyifund.com/

(93) 上海通华财富基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室

办公地址：上海市浦东新区杨高南路 799 号陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 9 层

法定代表人：马刚

客服电话：95156

公司网址：www.tonghuafund.com

(94) 宜信普泽（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C1809

法定代表人：戎兵

联系电话：010-52413385

传真号码：010-85894285

网址：<http://www.yixinfund.com/>

客服电话：400-6099-200

(95) 江苏江南农村商业银行股份有限公司

住所：常州市和平中路 413 号

法定代表人：陆向阳

联系电话：(0519) 96005

网址：<http://www.jnbank.com.cn/index.html>

(96) 中民财富基金销售（上海）有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路 100 号 7 层 05 单元

办公地址：上海市黄浦区中山南路 100 号 7 层 05 单元

法定代表人：弭洪军

联系电话：021-33355333

传真号码：021-33355288

全国统一客服电话：400-876-5716

公司网站：www.cmiwm.com

(97) 武汉市伯嘉基金销售有限公司

注册地址：武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）第七幢 23 层 1 号 4 号

办公地址：武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）第七幢 23 层 1 号 4 号

法定代表人：陶捷

客户服务电话：4000279899

网址：<http://www.buyfunds.cn>

(98) 上海华夏财富投资管理有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人：李一梅

客户服务电话：400-817-5666

网址：www.amcfortune.com

（99）北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

注册资本：2000 万元

法定代表人：江卉

电话：4000988511/ 4000888816

客服电话：个人业务:95118 企业业务：400-088-8816

公司网址：<http://fund.jd.com/>

（100）泰诚财富基金销售（大连）有限公司

法定代表人：林卓

地址：辽宁省大连市沙河口区星海公园 3 号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海公园 3 号

电话：400-6411-999

网址：www.taichengcaifu.com

（101）济安财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环中路 7 号 4 号楼 40 层 4601 室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路 7 号北京财富中心 A 座 46 层

法定代表人：杨健

（102）东海期货有限责任公司

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦 8 楼

法定代表人：陈太康

电话：95531/400-8888588

网址：www.qh168.com.cn

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23、25、27、29 号

（103）乾道金融信息服务（北京）有限公司

注册地址：北京市海淀区东北旺村南 1 号楼 7 层 7117 室

办公地址：北京市西城区德外大街合生财富广场 1302 室

法定代表人：王兴吉

联系电话：010-62062880

传真号码：010-82057741

（104）上海云湾基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层

法定代表人：戴新装

客服电话：4008201515

网址：www.zhengtongfunds.com

（105）华金证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区杨高南路 759 号 30 层

办公地址：上海市浦东新区杨高南路 759 号 30 层

法定代表人：宋卫东

电话：4008211357

（106）上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海市虹口区东大名路 1098 号浦江金融世纪广场

法定代表人：李兴春

网址：http://www.leadbank.com.cn/?utm_source=www.thinksas.cn

（107）玄元保险代理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室

法定代表人：马永谔

联系电话：021-50701053

基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。

2、场内销售机构

本基金的场内发售机构为具有基金销售资格的深圳证券交易所会员单位(具体名单可在深圳证券交易所网站查询)。

二、登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

负责人：周明

联系人：朱立元

电话：(010) 59378839

传真：(010) 59378907

三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

电话：(021) 31358666

传真：(021) 31358600

联系人：陈颖华

经办律师：安冬、陈颖华

四、审计基金资产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 507 单元 01 室

办公地址：上海市湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：张青萌

经办注册会计师：单峰、魏佳亮

四、基金的名称

本基金名称：华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）

五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式。

六、基金的投资目标

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。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融

工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：投资于股票资产的比例不低于基金资产的 60%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包含结算备付金、存出保证金和应收申购款等；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如果法律法规对该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，本基金的投资比例相应调整。

八、基金的投资策略

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。

1、资产配置策略

本基金以追求基金资产收益长期增长为目标，根据宏观经济趋势、市场政策、资产估值水平、外围主要经济体宏观经济和资本市场的运行状况等因素的变化在本基金的投资范围内进行适度动态配置，力争获得与所承担的风险相匹配的收益。

2、股票投资策略

本基金主要通过定量投资模型，发掘侧重股票价值的基本面逻辑，借助量化方法确定稳定有效的因子，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，对组合的风险暴露做合理控制，根据风险约束条件优化持仓，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

本基金运用的量化投资模型主要包括：

1) 多因子 alpha 模型——股票超额回报预测

多因子 alpha 模型以对中国股票市场的长期研究为基础，结合前瞻性市场判断，用精研的多个因子捕捉市场有效性暂时缺失之处，以多因子在不同个股上的不同体现估测个股的超值回报。概括来讲，本基金 alpha 模型的因子可归为如下几类：价值、成长、盈利、技术、流动性、事件、分析师预期等等。这些类别综合了来自市场各类投资者，公司各类报表，分析师及监管政策等各方面信息。多因子 alpha 模型利用长期积累并最新扩展的数据库，科学客观地综合了大量的各类信息。基金经理将结合市场状况及变化对各类信息的重要性做出具有一定前瞻性的判断，适时调整各因子类别的具体组成及权重。

2) 风险估测模型——有效控制风险预算

本基金将利用风险预测模型和适当的控制措施，有效控制投资组合的预期投资风险，并力求将投资组合的实现风险控制在目标范围内。

本基金将以多因子 alpha 模型估测个股的超额回报，选取并持有预期正超额回报的股票构成投资组合，以投资组合风险预算为约束条件，通过风险估测模型优化投资组合持仓。

3、债券投资策略

(1) 资产配置策略

本基金将通过对宏观经济运行情况、国家货币及财政政策、资本市场资金环境等重要因素的研究和预测，结合投资时钟理论并利用公司研究开发的多因子模型等数量工具，优化基金资产在利率债、信用债以及货币市场工具等各类固定收益类金融工具之间的配置比例。

(2) 利率类品种投资策略

本基金对国债等利率品种的投资，是在对国内外宏观经济运行状况及政策环境等进行分析 and 预测基础上，研究利率期限结构变化趋势和债券市场供求关系变化趋势，深入分析利率品种的收益和风险，预测调整债券组合的平均久期，并通过运用统计和数量分析技术，选择合适的期限结构的配置策略。在合理控制风险的前提下，综合考虑组合的流动性，决定投资品种。

(3) 信用债投资策略

本基金将在深入的宏观研究基础上，综合分析各类信用债发行主体所处行业环境、发行人所处的市场地位、财务状况、管理水平等因素后，结合具体发行契

约，对债券进行信用评级。在此基础上，建立信用类债券池，积极发掘信用利差具有相对投资机会的个券进行投资。

（4）可转债投资策略

可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金在对可转换公司债券条款和发行债券公司基本面进行深入分析研究的基础上，综合考虑可转换债券的债性和股性，利用可转换公司债券定价模型进行估值分析，并最终选择合适的投资品种。

4、股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机以及套期保值的类型（多头套期保值或空头套期保值），并根据风险资产投资（或拟投资）的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例；其次，本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择，以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。

5、权证投资策略

本基金在实现权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，结合权证定价模型寻求其合理估值水平，谨慎地进行投资，以追求较为稳定的收益。

6、资产支持证券的投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

7、参与融资业务的投资策略

本基金在参与融资业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资业务。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%。

沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制，该指数编制合理、透明，市场覆盖率较广，不易被操纵，并且有较高的知名度和市场影响力，适合作为本基金股票投资的业绩比较基准。中债综合指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制，样本债券涵盖的范围更加全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势，适合作为本基金债券投资的业绩比较基准。

本基金是股票投资比例不低于 60% 的混合型基金，在综合考虑了上述指数的权威性和代表性、指数的编制方法和本基金的投资范围和投资理念，选用上述业绩比较基准能够使本基金投资人理性判断本基金产品的风险收益特征，合理地衡量比较本基金的业绩表现。

如果今后法律法规发生变化，或上述业绩比较基准指数停止编制或更改名称，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，确定变更基金的比较基准或其权重构成。因上述原因导致业绩比较基准的变更，需经基金管理人与基金托管人协商一致报中国证监会备案后及时公告，并在更新的招募说明书中列示，无需召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

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。

十一、基金的投资组合报告

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年7月15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2019年6月30日。

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	16,589,542.63	90.37
	其中：股票	16,589,542.63	90.37
2	固定收益投资	82,338.30	0.45
	其中：债券	82,338.30	0.45
	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	1,661,774.49	9.05
7	其他各项资产	24,478.46	0.13
8	合计	18,358,133.88	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	507,168.00	2.79
C	制造业	7,362,205.84	40.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	245,384.73	1.35
E	建筑业	905,999.00	4.99
F	批发和零售业	177,566.40	0.98
G	交通运输、仓储和邮政业	571,967.00	3.15
H	住宿和餐饮业	182,336.00	1.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	563,749.00	3.10
J	金融业	4,323,899.00	23.80
K	房地产业	956,715.96	5.27
L	租赁和商务服务业	195,030.00	1.07
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	99,389.70	0.55
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	182,723.00	1.01
R	文化、体育和娱乐业	315,409.00	1.74
S	综合	-	-
	合计	16,589,542.63	91.32

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	601318	中国平安	7,600	673,436.00	3.71
2	601166	兴业银行	29,200	534,068.00	2.94

3	600872	中炬高新	12,200	522,526.00	2.88
4	600519	贵州茅台	500	492,000.00	2.71
5	000333	美的集团	8,900	461,554.00	2.54
6	600030	中信证券	17,600	419,056.00	2.31
7	601688	华泰证券	17,000	379,440.00	2.09
8	600036	招商银行	10,200	366,996.00	2.02
9	300003	乐普医疗	15,600	359,112.00	1.98
10	000002	万 科 A	12,294	341,896.14	1.88

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	82,338.30	0.45
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	82,338.30	0.45

5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110051	中天转债	490	51,508.80	0.28

2	128045	机电转债	142	15,585.92	0.09
3	110056	亨通转债	90	8,882.10	0.05
4	128048	张行转债	43	4,511.56	0.02
5	128047	光电转债	16	1,849.92	0.01

6 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资产支持证券投资明细

本基金本报告期末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

本基金本报告期末未持有贵金属。

8 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

本基金本报告期末投资股指期货。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本基金投资国债期货的投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

10.3 本基金投资国债期货的投资评价

无。

11 投资组合报告附注

11.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

11.2 本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	20,261.37
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	425.47
5	应收申购款	3,791.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,478.46

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	---------	--------------

1	128045	机电转债	15,585.92	0.09
2	128048	张行转债	4,511.56	0.02
3	128047	光电转债	1,849.92	0.01

11.5.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有存在流通受限情况的股票。

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，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。

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（一）基金净值表现

历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

（截止时间 2019 年 6 月 30 日）

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
自 2019-1-11 （基金转型生效日）至 2019-6-30	18.19%	1.49%	19.36%	1.26%	-1.17%	0.23%

注：2019 年 1 月 11 日华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）正式转型为华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

十三、费用概览

（一）与基金运作有关的费用

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

（二）与基金销售有关的费用

1、申购费用

（1）场外申购费率

本基金场外申购费率随申购金额的增加而递减。投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

本基金对通过直销中心申购的养老金客户与除此之外的其他投资人实施差别的申购费率。

养老金客户指基本养老保险基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资人。

通过基金管理人的直销中心申购本基金份额的养老金客户申购费率为每笔500元。

除上述养老金客户外，其他投资人申购本基金基金份额申购费率如下所示：

申购金额 (M)	申购费率
M<100万	1.50%
100万≤M<300万	1.20%
300万≤M<500万	0.80%
M≥500万	每笔1000元

（2）场内申购费率

本基金场内申购费率参照场外申购费率设定。

（3）本基金的申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

2、赎回费率

（1）场外赎回费率

本基金的场外赎回费率按持有期递减。赎回费用由赎回基金份额的基金份额

持有人承担，其中对于持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产。具体费率如下：

持有年限 (Y)	赎回费率
Y < 7天	1.5%
7天 ≤ Y < 30天	0.75%
30天 ≤ Y < 6个月	0.5%
Y ≥ 6个月	0

注：6 个月指 180 天

(2) 场内赎回费率

本基金的场内赎回费率参照场外赎回费率设定。

(3) 本基金的赎回费用在投资人赎回本基金份额时收取。本基金的赎回费用由赎回申请人承担，对持续持有期少于 30 日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期长于 30 日但少于 3 个月的投资人收取的赎回费中不低于总额的 75% 计入基金财产；对持续持有期长于 3 个月但少于 6 个月的投资人收取的赎回费中不低于总额的 50% 计入基金财产；对持续持有期长于 6 个月的投资人收取的赎回费中不低于总额的 25% 计入基金财产。其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对基金投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和赎回费率。

(三) 其他费用

- 1、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 2、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 3、基金份额持有人大会费用；

-
- 4、基金的证券、期货交易费用；
 - 5、基金的银行汇划费用；
 - 6、基金的开户费用、账户维护费用；
 - 7、基金的上市费用及年费；
 - 8、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

（四）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用根据《华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）基金合同》的约定执行；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《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》、《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》及其他有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管

理活动，对本基金的原招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

章节	主要更新内容
三、基金管理人	更新了基金管理人相关信息。
四、基金托管人	更新了基金托管人的相关信息。
五、相关服务机构	更新了相关服务机构的信息。
九、基金的投资	新增了本基金最近一期投资组合报告的内容，详见招募说明书。
十、基金的业绩	新增了本章节，披露了本基金生效以来的基金业绩，详见招募说明书。
十七、风险揭示	更新了风险揭示的相关信息。
二十二、其他应披露事项	披露了自 2019 年 1 月 11 日至 2019 年 7 月 11 日期间本基金的公告信息。

华安基金管理有限公司
二〇一九年八月二十四日

