

华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）

（华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)）

2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 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

报告送出日期：二〇二〇年四月十一日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2020 年 4 月 7 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

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。

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及其更新。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况（转型前）.....	6
2.2 基金基本情况（转型后）.....	6
2.3 基金产品说明（转型前）.....	7
2.4 基金产品说明（转型后）.....	7
2.5 基金管理人和基金托管人.....	8
2.6 信息披露方式.....	8
2.7 其他相关资料.....	8
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.1.1 华安深证 300 指数证券投资基金(LOF).....	9
3.1.2 华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）.....	10
3.2 基金净值表现（转型前）.....	10
3.3 基金净值表现（转型后）.....	12
3.4 过去三年基金的利润分配情况（转型前）.....	14
3.5 过去三年基金的利润分配情况（转型后）.....	14
§4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	20
§5 托管人报告	20
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	20
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	20
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	20
§6 审计报告	20
6.1 华安深证 300 指数证券投资基金(LOF).....	20
6.1.1 管理层对财务报表的责任.....	21
6.1.2 注册会计师的责任.....	21
6.1.3 审计意见.....	22
6.2 华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）.....	22
6.2.1 管理层对财务报表的责任.....	23
6.2.2 注册会计师的责任.....	23
6.2.3 审计意见.....	24
§7 年度财务报表	24

7.1 华安深证 300 指数证券投资基金(LOF).....	24
7.1.1 资产负债表（转型前）	24
7.1.2 利润表.....	26
7.1.3 所有者权益（基金净值）变动表	28
7.1.4 报表附注.....	29
7.2 华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）	53
7.2.1 资产负债表（转型后）	53
7.2.2 利润表.....	55
7.2.3 所有者权益（基金净值）变动表	56
7.2.4 报表附注.....	57
§8 投资组合报告	80
8.1 华安深证 300 指数证券投资基金(LOF).....	80
8.1.1 期末基金资产组合情况	80
8.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	81
8.1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	83
8.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动	90
8.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	91
8.1.6 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	91
8.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	91
8.1.8 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贵金属投资明细.....	91
8.1.9 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	91
8.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	92
8.2 华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）	93
8.2.1 期末基金资产组合情况	93
8.2.2 期末按行业分类的股票投资组合	94
8.2.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	95
8.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动	96
8.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	99
8.2.6 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	99
8.2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	99
8.2.8 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贵金属投资明细.....	99
8.2.9 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	99
8.2.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	99
§9 基金份额持有人信息	100
9.1 华安深证 300 指数证券投资基金(LOF).....	100
9.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	100
9.1.2 期末上市基金前十名持有人	101
9.1.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	101
9.1.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	101
9.2 华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）	101
9.2.2 期末上市基金前十名持有人	102
9.2.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	102
9.2.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	102
§10 开放式基金份额变动	103
10.1 华安深证 300 指数证券投资基金(LOF).....	103

10.2 华安量化多因子混合型证券投资基金 (LOF)	103
§11 重大事件揭示	103
11.1 基金份额持有人大会决议	103
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	104
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	104
11.4 基金投资策略的改变	104
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	104
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	104
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	104
11.8 其他重大事件 (转型后)	107
11.9 其他重大事件 (转型前)	109
§12 影响投资者决策的其他重要信息	109
§13 备查文件目录	110
13.1 备查文件目录	110
13.2 存放地点	110
13.3 查阅方式	110

§2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)
基金简称	华安深证 300 (LOF)
场内简称	华安 S300
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
基金合同生效日	2011 年 9 月 2 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
报告期末基金份额总额	31,085,420.67 份
基金合同存续期	不定期
下属分级基金的基金简称	华安深证 300 (LOF)
下属分级基金的场内简称	华安 S300
下属分级基金的交易代码	160415
报告期末下属分级基金的份额总额	31,085,420.67 份

2.2 基金基本情况（转型后）

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	华安量化多因子混合 (LOF)
场内简称	华安量化
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
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
报告期末基金份额总额	19,686,192.33 份
基金合同存续期	不定期
下属分级基金的基金简称	华安量化多因子混合（LOF）
下属分级基金的场内简称	华安量化
下属分级基金的交易代码	160415
报告期末下属分级基金的份额总额	19,686,192.33 份

2.3 基金产品说明（转型前）

投资目标	本基金通过被动的指数化投资管理，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式股票指数基金，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即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进行相应调整。
业绩比较基准	95%×深证 300 价格指数收益率+5%×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。
下属分级基金的风险收益特征	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。

2.4 基金产品说明（转型后）

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。
下属分级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。

2.5 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	薛珍	许俊
	联系电话	021-38969999	010-66594319
	电子邮箱	service@huan.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008850099	95566
传真		021-68863414	010-66594942
注册地址		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	北京西城区复兴门内大街1号
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	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		朱学华	刘连舸

2.6 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.huan.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31、32层

2.7 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

	普通合伙)	
注册登记机构	中国证券登记结算有限公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

3.1.1 华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)

金额单位：人民币元

3.1.1.1 期间数据和指标	报告期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 10 日	2018 年	2017 年
本期已实现收益	-707,508.10	6,401,310.96	14,376,459.91
本期利润	529,535.20	-20,897,819.20	39,226,290.13
加权平均基金份额本期利润	0.0160	-0.1864	0.1123
本期加权平均净值利润率	2.40%	-19.26%	10.22%
本期基金份额净值增长率	2.56%	-36.42%	10.15%
3.1.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 1 月 10 日)	2018 年末	2017 年末
期末可供分配利润	-9,875,536.23	-11,653,012.05	25,979,415.59
期末可供分配基金份额利润	-0.3177	-0.3345	0.0462
期末基金资产净值	21,209,884.44	23,181,074.01	588,689,726.49
期末基金份额净值	0.6820	0.665	1.046
3.1.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 1 月 10 日)	2018 年末	2017 年末
基金份额累计净值增长率	-14.17%	-16.31%	31.63%

3.1.2 华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）

金额单位：人民币元

3.1.2.1 期间数据和指标	报告期 2019年1月11日至2019年12月31日
本期已实现收益	58,576.04
本期利润	3,817,908.10
加权平均基金份额本期利润	0.2461
本期加权平均净值利润率	21.43%
本期基金份额净值增长率	24.18%
3.1.2.2 期末数据和指标	2019年末
期末可供分配利润	-3,013,698.88
期末可供分配基金份额利润	-0.2233
期末基金资产净值	16,672,493.45
期末基金份额净值	1.2353
3.1.2.3 累计期末指标	2019年末
基金份额累计净值增长率	24.18%

3.2 基金净值表现（转型前）

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标	①-③	②-④
----	----------	------------	------------	------------	-----	-----

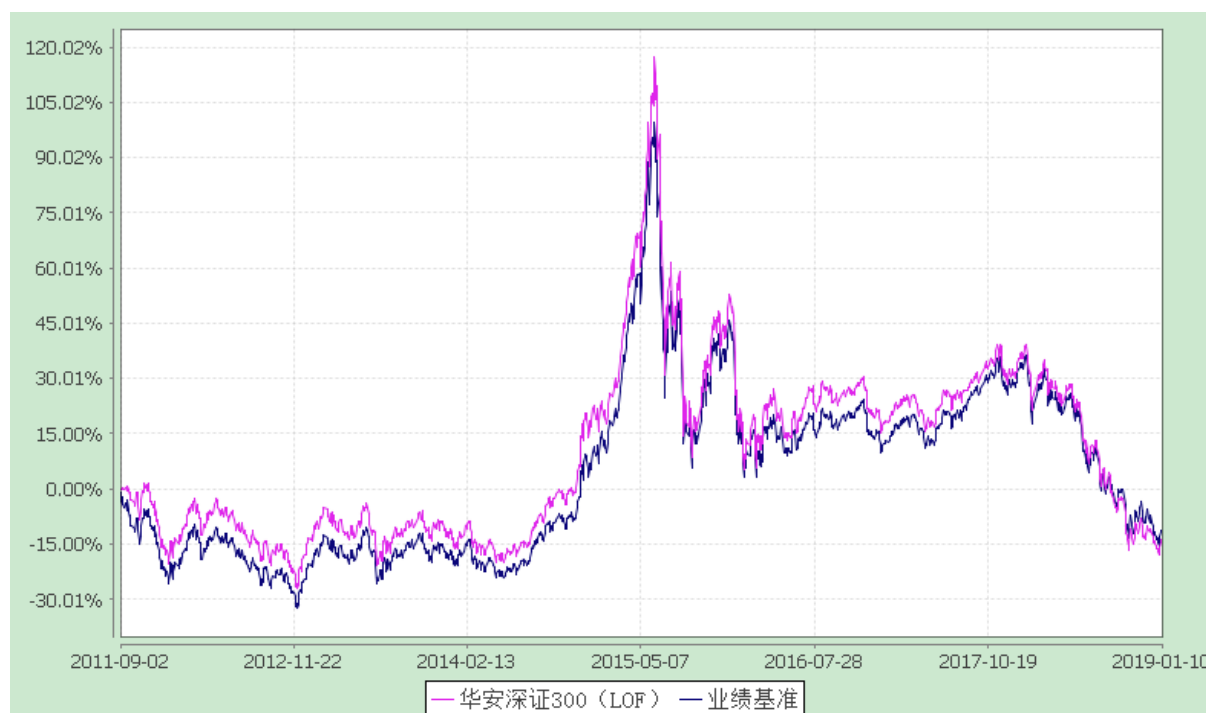
		②		准差④		
过去三个月	-7.71%	1.55%	-7.00%	1.68%	-0.71%	-0.13%
过去六个月	-22.50%	1.47%	-18.23%	1.55%	-4.27%	-0.08%
过去一年	-37.14%	1.39%	-33.37%	1.45%	-3.77%	-0.06%
过去三年	-32.21%	1.32%	-26.90%	1.29%	-5.31%	0.03%
自基金合同生效起至今	-14.17%	1.56%	-11.36%	1.54%	-2.81%	0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

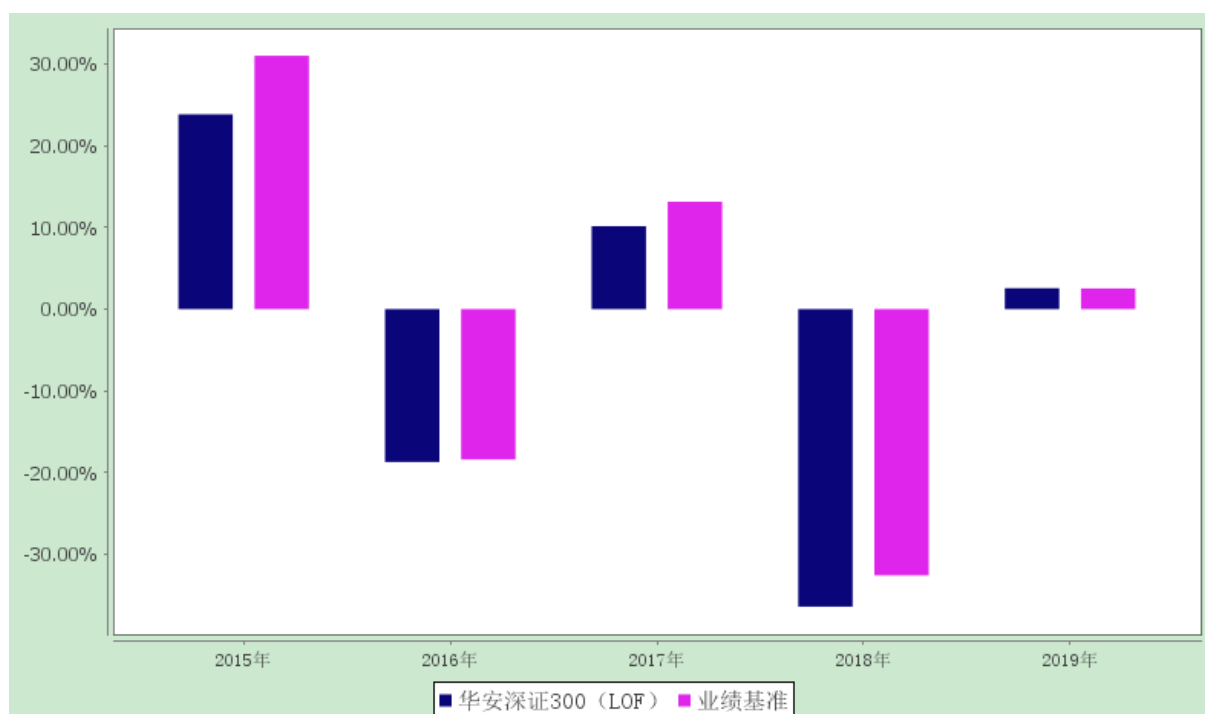
(2011 年 9 月 2 日至 2019 年 1 月 10 日)



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)

自基金转型以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3 基金净值表现（转型后）

3.3.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

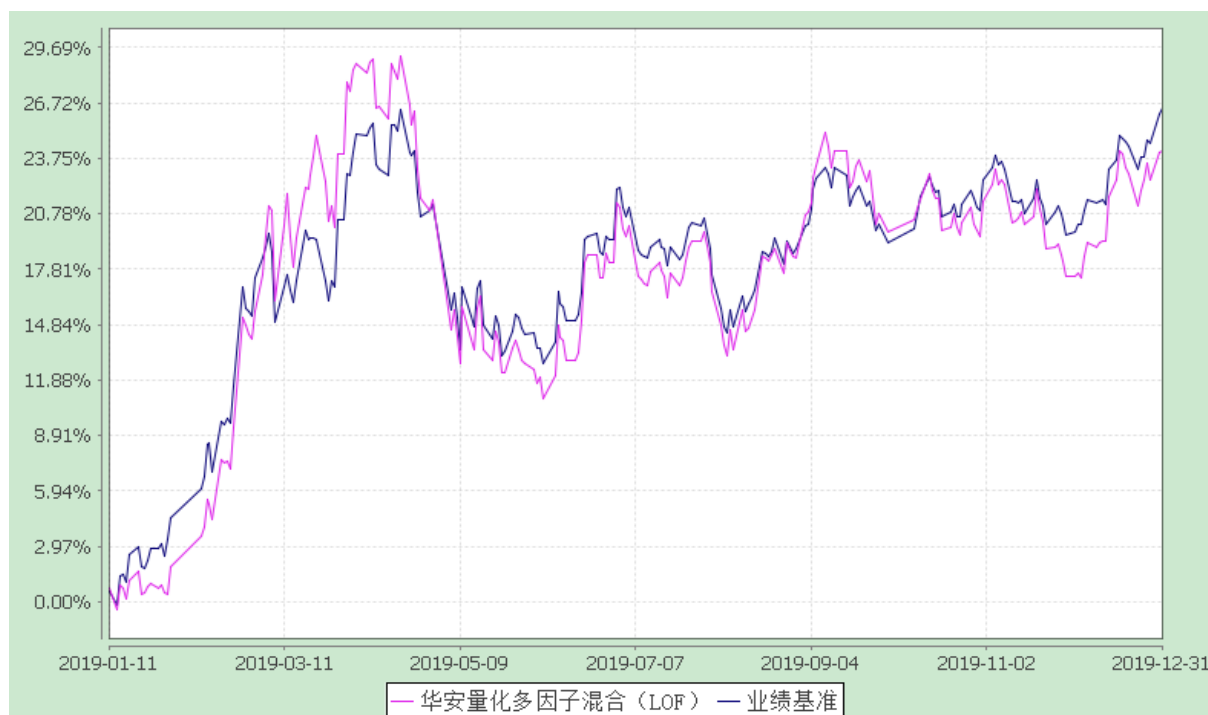
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	3.62%	0.73%	6.03%	0.59%	-2.41%	0.14%
过去六个月	5.07%	0.85%	5.93%	0.68%	-0.86%	0.17%
自基金合同生效起至今	24.18%	1.19%	26.44%	1.00%	-2.26%	0.19%

3.3.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

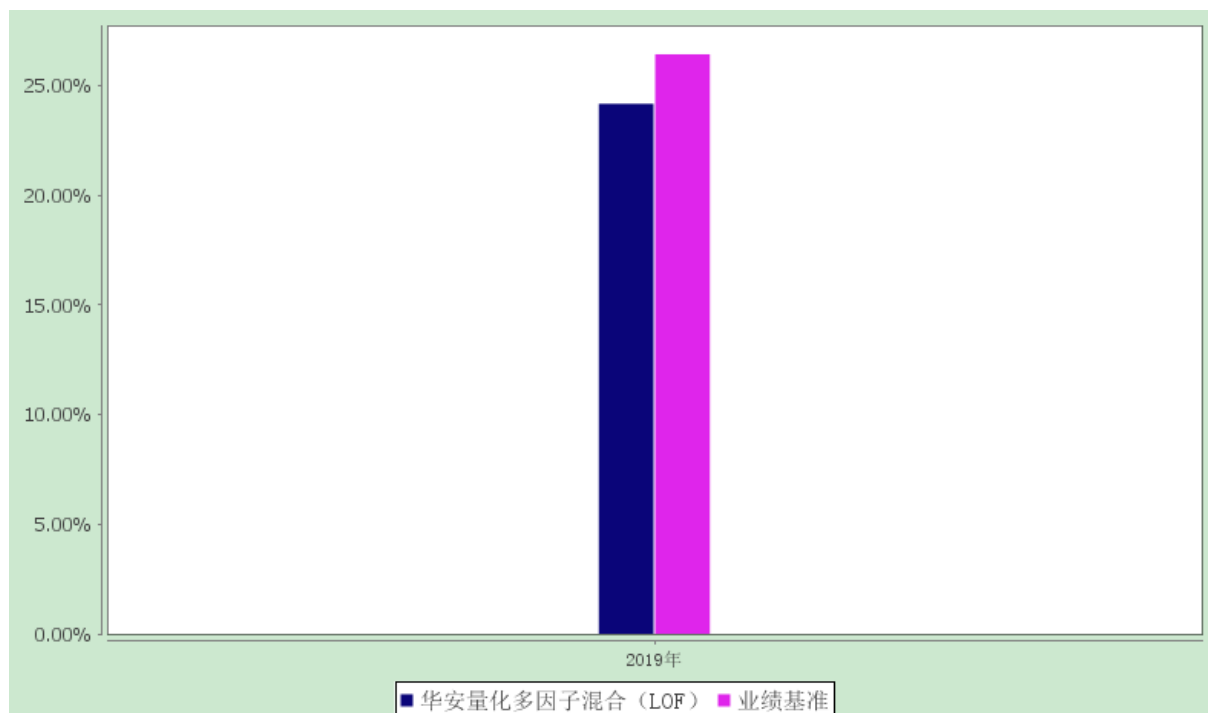
(2019年1月11日至2019年12月31日)



3.3.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安量化多因子混合型证券投资基金 (LOF)

自基金转型以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.4 过去三年基金的利润分配情况（转型前）

无。

3.5 过去三年基金的利润分配情况（转型后）

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰君安证券股份有限公司、上海上国投资产管理有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。公司在北京、西安、成都、广州等地设有分公司，在香港和上海设有子公司——华安（香港）资产管理有限公司、华安未来资产管理有限公司。截至 2019 年 12 月 31 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 129 只开放式基金，管理资产规模达到 3,516.57 亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
许之彦	本基金的基金经理、指数与量化投资部高级总监、总经理助理	2011-09-02	2019-03-29	16 年	院博士后流动站从事金融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，2008 年 4 月至 2012 年 12 月担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理，2009 年 9 月起同时担任上证 180 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2010 年 11 月至 2012 年 12 月担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2011 年 9 月至 2019 年 1

					<p>月，同时担任华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)的基金经理。2019 年 1 月至 2019 年 3 月，同时担任本基金的基金经理。2013 年 6 月起担任指数投资部高级总监。2013 年 7 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理。2014 年 11 月至 2015 年 12 月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。2015 年 6 月起同时担任华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金、华安中证银行指数分级证券投资基金的基金经理。2015 年 7 月起担任华安创业板 50 指数分级证券投资基金的基金经理。2016 年 6 月起担任华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月起，同时担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、华安沪深 300 量化增强型指数证券投资基金的基金经理。2018 年 11 月起，同时担任华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 12 月起，同时担任华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p>
孙晨进	本基金的基金经理、指数与量化投资部助理总监	2015-03-20	-	9 年	<p>硕士研究生，9 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</p>

					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。2019 年 7 月起，同时担任华安安进灵活配置混合型发起式证券投资基金、华安新丰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
马丁	本基金的基金经理	2019-03-29	-	4 年	博士研究生，4 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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。

（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义

对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。(3) 银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司风险管理部会同基金投资、交易部门讨论制定了各类投资组合针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对各类投资组合间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 1 次，未出现异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在 2019 年，基金管理人主要采用多因子策略管理本产品，并逐渐加大 TMT 配置权重。2019 年

科技成长与消费构成投资主线。年初成长板块被极度低估，5G 加速带来的科技景气反转预期催生了成长行情，猪价快速抬升使农业板块也备受关注。年报业绩披露后，叠加中美贸易分歧加大，业绩较好的消费板块成为资金避险去处。下半年 5G 新机陆续发布，半导体与消费电子业绩出现拐点，成长风格持续至年末。2019 年我国经济增速有所下降，但是猪价导致的 CPI 高位制约了货币政策。四季度的工业增加值、PPI、工业企业利润均出现回升，工业产成品库存维持低位，中美贸易谈判出现进展，疫情尚未爆发，市场预期补库存过程将引领制造业回暖。基金管理人基于量化多因子策略，选股采用基本面多因子模型，并参考量化景气度模型对板块做超额配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 12 月 31 日，华安量化多因子混合基金份额净值为 1.2353 元，本报告期（2019 年 1 月 11 日-2019 年 12 月 31 日）份额净值增长率为 24.18%，同期业绩比较基准增长率为 26.44%。截至 2019 年 1 月 10 日，华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）份额净值为 0.6820 元，本报告期（2019 年 1 月 1 日-2019 年 1 月 10 日）份额净值增长率为 2.56%，同期业绩比较基准增长率为 2.53%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2020 年，年初疫情爆发对经济有严重影响，目前预计我国疫情防控有望在四月结束。实体经济运行停滞，同时货币政策明显宽松，流动性催化了春节后权益市场的快速反弹，政策导向的科技新基建成为市场主线。我们认为，疫情对我国和全球经济的冲击尚未在宏观和公司财报数据体现，部分板块估值出现过热迹象。政府逆周期基建投资对出口和消费下滑的补充至关重要，同时，政府投资要引导产业结构升级。消费虽然短期受到冲击，但是估值也有所回调，长期看来消费依然是最好赛道之一。基金管理人将基于量化多因子组合策略，围绕新经济成长动力挖掘优质个股，关注 5G 和云等高景气度产业链以及消费等长期赛道，力争稳健收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司合规监察稽核部从维护基金份额持有人利益、保障基金的合规运作出发，重点在法律事务、合规管理、内部稽核、信息披露、反洗钱、员工行为规范等方面开展工作，深化员工的合规意识，推动公司的合规文化和内部风险控制机制的完善与优化。

监察稽核工作重点集中于以下几个方面：

（1）继续深化“主动合规”的管理理念，积极开展形式多样的合规教育培训，强化全体员工的合规意识和风险控制意识，推动公司建立良好的内控环境和合规文化。

（2）积极落实《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披

露管理办法》等法规要求,督促各项工作稳妥、有序开展。

(3) 强化内控建设,推动落实公司投资、运营业务操作流程标准化,细化各相关部门在各业务环节的操作流程及工作职责,降低操作风险。

(4) 构建贯穿公司各业务和产品条线的合规咨询服务体系,积极参与新产品、新业务评估工作,提供合规意见和建议,保障新产品、新业务合规开展。

(5) 对公司内部重要规章制度、重大决策、产品和业务方案、重要法律文本、对外披露材料、宣传推介材料等进行合规性审查,严把合规质量关。

(6) 定期组织开展内部审计、专项稽核、合规有效性评估,对公司前中后各业务环节开展自查自纠,及时排除风险隐患和漏洞,促进合规和内控管理水平的提升,保障公司稳健经营。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性,努力防范和控制各种风险,保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会,负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时,评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值;同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由投资总监、研究部总监、固定收益部总监、指数与量化投资部总监、基金运营部高级总监、风险管理部总监等人员组成,具有多年的证券、基金从业经验,熟悉相关法律法规,具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内,参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议,由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金报告期内基金持有人数不低于 200 人；基金资产净值连续超过 20 个工作日低于 5000 万元。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对华安量化多因子混合型证券投资基金(LOF)（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)

普华永道中天审字(2020)第 26977 号

华安深证 300 指数证券投资基金(LOF) 全体基金份额持有人：

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华安深证 300 指数基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

6.1.1 管理层对财务报表的责任

华安深证 300 指数基金的基金管理人华安基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估华安深证 300 指数基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算华安深证 300 指数基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督华安深证 300 指数基金的财务报告过程。

6.1.2 注册会计师的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华安深证 300 指数基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基

于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华安深证 300 指数基金不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

6.1.3 审计意见

(一)我们审计的内容

我们审计了华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)(以下简称“华安深证 300 指数基金”)的财务报表，包括 2019 年 1 月 10 日(基金合同失效前日)的资产负债表，2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 10 日(基金合同失效前日)止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

(二)我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了华安深证 300 指数基金 2019 年 1 月 10 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 10 日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

中国注册会计师

单峰 楼茜蓉

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

6.2 华安量化多因子混合型证券投资基金 (LOF)

普华永道中天审字(2020)第 23301 号

华安量化多因子混合型证券投资基金(LOF) 全体基金份额持有人：

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华安量化多因子混合基金(LOF)，并履行了职业道德方面的其他责任。

6.2.1 管理层对财务报表的责任

华安量化多因子混合基金(LOF)的基金管理人华安基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估华安量化多因子混合基金(LOF)的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算华安量化多因子混合基金(LOF)、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督华安量化多因子混合基金(LOF)的财务报告过程。

6.2.2 注册会计师的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华安量化多因子混合基金(LOF)持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们

的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华安量化多因子混合基金(LOF)不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

6.2.3 审计意见

(一)我们审计的内容

我们审计了华安量化多因子混合型证券投资基金(LOF)(原华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)，以下简称“华安量化多因子混合基金(LOF)”)的财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年 1 月 11 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

(二)我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了华安量化多因子混合基金(LOF)2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年 1 月 11 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

中国注册会计师

单峰 楼茜蓉

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

§7 年度财务报表

7.1 华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)

7.1.1 资产负债表（转型前）

会计主体：华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)

报告截止日：2019 年 1 月 10 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 1 月 10 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.1.4.6.1	1,585,531.58	2,289,380.02
结算备付金		191,849.12	-
存出保证金		28,806.18	35,891.32
交易性金融资产	7.1.4.6.2	19,578,472.86	21,853,124.91
其中：股票投资		19,556,430.58	21,832,175.35
基金投资		-	-
债券投资		22,042.28	20,949.56
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.1.4.6.3	-	-
买入返售金融资产	7.1.4.6.4	-	-
应收证券清算款		664,859.35	-
应收利息	7.1.4.6.5	960.38	483.68
应收股利		-	-
应收申购款		4,186.62	3,079.17
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.1.4.6.6	-	-
资产总计		22,054,666.09	24,181,959.10
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 1 月 10 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.1.4.6.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	584,294.29
应付赎回款		486,413.99	480.68
应付管理人报酬		3,036.81	10,696.73
应付托管费		607.36	2,139.31
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.1.4.6.7	107,838.16	105,272.32
应交税费		0.02	0.07
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.1.4.6.8	246,885.31	298,001.69
负债合计		844,781.65	1,000,885.09
所有者权益：		-	-
实收基金	7.1.4.6.9	31,085,420.67	34,834,086.06
未分配利润	7.1.4.6.10	-9,875,536.23	-11,653,012.05
所有者权益合计		21,209,884.44	23,181,074.01
负债和所有者权益总计		22,054,666.09	24,181,959.10

注：1.报告截止日 2019 年 1 月 10 日(基金合同失效前日)，基金份额净值 0.682 元，基金份额总额 31,085,420.67 份。

2.本财务报表的实际编制期间为 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 10 日(基金合同失效前日)止期间。

7.1.2 利润表

会计主体：华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 10 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 10 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

一、收入		544,016.55	-18,563,382.94
1.利息收入		476.68	73,407.70
其中：存款利息收入	7.1.4.6.11	475.63	72,884.77
债券利息收入		1.05	522.93
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-696,498.70	7,999,947.92
其中：股票投资收益	7.1.4.6.12	-696,130.01	6,541,541.70
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.1.4.6.13	-	207,946.78
资产支持证券投资收益	7.1.4.6.14	-	-
贵金属投资收益	7.1.4.6.15	-	-
衍生工具收益	7.1.4.6.16	-	-
股利收益	7.1.4.6.17	-368.69	1,250,459.44
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.1.4.6.18	1,237,043.30	-27,299,130.16
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.1.4.6.19	2,995.27	662,391.60
减：二、费用		14,481.35	2,334,436.26
1. 管理人报酬	7.1.4.9.2	3,036.81	543,836.53
2. 托管费	7.1.4.9.2	607.36	108,767.30
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.1.4.6.20	5,632.07	1,152,385.93
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.1.4.6.21	5,205.11	529,446.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		529,535.20	-20,897,819.20

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		529,535.20	-20,897,819.20

7.1.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 10 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 10 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	34,834,086.06	-11,653,012.05	23,181,074.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	529,535.20	529,535.20
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-3,748,665.39	1,247,940.62	-2,500,724.77
其中：1.基金申购款	292,896.89	-99,658.10	193,238.79
2.基金赎回款	-4,041,562.28	1,347,598.72	-2,693,963.56
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	31,085,420.67	-9,875,536.23	21,209,884.44
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益（基金净值）	562,710,310.90	25,979,415.59	588,689,726.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-20,897,819.20	-20,897,819.20
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-527,876,224.84	-16,734,608.44	-544,610,833.28
其中：1.基金申购款	35,850,768.64	-9,329,257.70	26,521,510.94
2.基金赎回款	-563,726,993.48	-7,405,350.74	-571,132,344.22
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	34,834,086.06	-11,653,012.05	23,181,074.01

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：赵敏，会计机构负责人：陈林

7.1.4 报表附注

7.1.4.1 基金基本情况

华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)(以下简称“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[2011]884 号《关于核准华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)募集的批复》核准，由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 607,830,415.01 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 349 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2011 年 9 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 608,040,554.70 份基金份额，其中认购资金利息折合 210,139.69 份基金份额。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。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2011]310 号文审核同意，本基金 146,584,084.00

份基金份额于 2011 年 10 月 18 日在深交所挂牌交易。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

根据本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 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，本基金于 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。本基金基金份额持有人将按照《华安量化多因子混合型证券投资基金(LOF)基金合同》享有权利并承担义务。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定，本基金的本基金投资范围主要为标的指数深证 300 价格指数成份股及其备选成份股，少量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股)、新股(首次发行或增发等)、债券、现金等其他金融工具。标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的 90%；其他股票、新股、债券、现金等其他金融工具的投资比例为基金资产的 5%-10%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{深证 300 价格指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行税后活期存款基准利率}$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2020 年 4 月 7 日批准报出。

7.1.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

经中国证监会批准，基金管理人华安基金管理有限公司将本基金于基金合同失效日转型为华安

量化多因子混合型证券投资基金(LOF)并相应延长存续期至不定期,因此本基金财务报表仍以持续经营假设为编制基础。

7.1.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 10 日(基金合同失效前日)止期间的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2019 年 1 月 10 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 10 日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.1.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.1.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 10 日(基金合同失效前日)。

7.1.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.1.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金

持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.1.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.1.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.1.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.1.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.1.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.1.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.1.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.1.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.1.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.1.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告 2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.1.4.4.14 会计政策变更的说明

本会计期间不存在会计政策变更。

7.1.4.4.15 会计估计变更的说明

本会计期间不存在会计估计变更。

7.1.4.4.16 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.1.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应

纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.1.4.6 重要财务报表项目的说明

7.1.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2019 年 1 月 10 日	2018 年 12 月 31 日
活期存款	1,585,531.58	2,289,380.02
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	1,585,531.58	2,289,380.02

7.1.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2019 年 1 月 10 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	22,083,458.83	19,556,430.58	-2,527,028.25	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	20,100.00	22,042.28	1,942.28
	银行间市场	-	-	-
	合计	20,100.00	22,042.28	1,942.28
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	

其他	-	-	-
合计	22,103,558.83	19,578,472.86	-2,525,085.97
项目	上年度末		
	2018 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	25,595,154.18	21,832,175.35	-3,762,978.83
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	20,100.00	20,949.56
	银行间市场	-	-
	合计	20,100.00	20,949.56
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	25,615,254.18	21,853,124.91	-3,762,129.27

7.1.4.6.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

7.1.4.6.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

7.1.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2019 年 1 月 10 日	2018 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	857.20	455.94
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	60.41	-
应收债券利息	11.26	10.19

应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	1.35	1.35
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	30.16	16.20
合计	960.38	483.68

7.1.4.6.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.1.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年1月10日	上年度末 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	107,838.16	105,272.32
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	107,838.16	105,272.32

7.1.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年1月10日	上年度末 2018年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,832.44	1.69
预提审计费	1,643.80	58,000.00
预提信息披露费	191,643.80	190,000.00
指数使用费	50,121.47	50,000.00
预提上市年费	1,643.80	-
合计	246,885.31	298,001.69

7.1.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2019年1月1日至2019年1月10日	
	基金份额	账面金额
上年度末	34,834,086.06	34,834,086.06
本期申购	292,896.89	292,896.89
本期赎回（以“—”号填列）	-4,041,562.28	-4,041,562.28
本期末	31,085,420.67	31,085,420.67

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2.截至 2019 年 1 月 10 日(基金合同失效前日)止，本基金于深交所上市的基金份额为 1,378,401.00 份(2018 年 12 月 31 日：1,382,293.00 份)，托管在场外未上市交易的基金份额为 29,707,019.67 份(2018 年 12 月 31 日：33,451,793.06 份)。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

7.1.4.6.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-2,981,965.31	-8,671,046.74	-11,653,012.05
本期利润	-707,508.10	1,237,043.30	529,535.20
本期基金份额交易产生的变动数	339,327.19	908,613.43	1,247,940.62
其中：基金申购款	-26,368.23	-73,289.87	-99,658.10
基金赎回款	365,695.42	981,903.30	1,347,598.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,350,146.22	-6,525,390.01	-9,875,536.23

7.1.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 10 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	401.26	69,577.47

定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	60.41	923.57
其他	13.96	2,383.73
合计	475.63	72,884.77

7.1.4.6.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年1月10日	2018年1月1日至2018年12月31日
卖出股票成交总额	2,815,565.34	554,636,393.46
减：卖出股票成本总额	3,511,695.35	548,094,851.76
买卖股票差价收入	-696,130.01	6,541,541.70

7.1.4.6.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年1月10日	2018年1月1日至2018年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-	1,667,794.19
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-	1,459,200.00
减：应收利息总额	-	647.41
买卖债券差价收入	-	207,946.78

7.1.4.6.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.1.4.6.15 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.1.4.6.16 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具投资。

7.1.4.6.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年1月10日	2018年1月1日至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	-368.69	1,250,459.44
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	-368.69	1,250,459.44

7.1.4.6.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年1月10日	2018年1月1日至2018年12月31日
1.交易性金融资产	1,237,043.30	-27,299,130.16
——股票投资	1,235,950.58	-27,299,979.72
——债券投资	1,092.72	849.56
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
合计	1,237,043.30	-27,299,130.16

7.1.4.6.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年1月10日	2018年1月1日至2018年12月31日

基金赎回费收入	2,995.27	662,391.60
合计	2,995.27	662,391.60

7.1.4.6.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年1月10日	2018年1月1日至2018年12月31日
交易所市场交易费用	5,632.07	1,152,385.93
银行间市场交易费用	-	-
合计	5,632.07	1,152,385.93

7.1.4.6.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年1月10日	2018年1月1日至2018年12月31日
审计费用	1,643.80	58,000.00
信息披露费	1,643.80	190,000.00
指数使用费	121.47	200,000.00
银行汇划费	152.24	3,444.99
上市年费	1,643.80	60,000.00
账户维护费	-	18,000.00
其他费用	-	1.51
合计	5,205.11	529,446.50

注：根据《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》及《深证 300 指数使用许可协议书》，本基金的指数许可使用费从基金财产中列支，收取标准为每年本基金的资产净值的 0.02%，收取下限为每季 5 万元，逐日累计，每季支付一次。基金合同生效之日所在季度的指数使用费，按实际计提金额收取，不设下限。计算方法如下：

日指数许可使用费 = 前一日基金资产净值 × 0.02% / 当年天数。

7.1.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.1.4.7.1 或有事项

无。

7.1.4.7.2 资产负债表日后事项

《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》自 2019 年 1 月 11 日起失效,《华安量化多因子混合型证券投资基金(LOF)基金合同》于同日起生效,同时本基金更名为“华安量化多因子混合型证券投资基金(LOF)”。

7.1.4.8 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司(“华安基金公司”)	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
上海上国投资资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东
华安资产管理(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司
华安未来资产管理(上海)有限公司	基金管理人的全资子公司

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.1.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.1.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.1.4.9.1.1 股票交易

无。

7.1.4.9.1.2 债券交易

无。

7.1.4.9.1.3 债券回购交易

无。

7.1.4.9.1.4 权证交易

无。

7.1.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年1月10日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国泰君安	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国泰君安	-	-	78,611.08	74.67%

注：1.上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2.该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

3. 关联方交易上年度实际期间为 2018 年 12 月 5 日至 12 月 31 日。

7.1.4.9.2 关联方报酬

7.1.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年1月 10日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12 月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	3,036.81
其中：支付销售机构的客户维护费	711.93	32,892.96

注：支付基金管理人华安基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

7.1.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年1月10日	2018年1月1日至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	607.36	108,767.30

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

7.1.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.1.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

7.1.4.9.4.1 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.1.4.9.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年1月10日		2018年1月1日至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	1,585,531.58	401.26	2,289,380.02	69,577.47

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.1.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.1.4.9.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.1.4.10 利润分配情况

无。

7.1.4.11 期末（2019年1月10日）本基金持有的流通受限证券

7.1.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.1.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单 价	数量 (单位：股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
000693	*ST 华泽	2018-05-02	重大事项停牌	3.31	2019-05-27	2.98	1,360.00	29,419.08	4,501.60	

7.1.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.1.4.11.3.1 银行间市场债券正回购**

截至报告期末 2019 年 1 月 10 日止，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.1.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末 2019 年 1 月 10 日止，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.1.4.12 金融工具风险及管理

本基金是指数型基金，采用完全复制策略，跟踪深证 300 指数，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。本基金投资的金融工具主要为股票投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金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进行相应调整。但因特殊情况(例如因受相关法规限制而无法买入标的指数成份股等情况)导致无法获得或无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。

7.1.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控

制的总体措施等；在管理层层面设立合规与风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。监察稽核部和风险管理部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在此可承受的范围内。

7.1.4.12.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在经中国人民银行和中国证券监督管理委员会所批准的具有基金托管资格和基金代销资格的银行，并根据本基金的基金管理人管理交易对手的经验进行筛选，因而与这些银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

7.1.4.12.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金份额持有人利益。

7.1.4.12.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.1.4.11。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2019 年 1 月 10 日(基金合同失效前日)，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.02%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2019 年 1 月 10 日(基金合同失效前日)，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为 21,828,548.81 元，超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.1.4.12.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而

发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.1.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等，其余金融资产和金融负债均不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

7.1.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年1月10日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,585,531.58	-	-	-	1,585,531.58
结算备付金	191,849.12	-	-	-	191,849.12
存出保证金	28,806.18	-	-	-	28,806.18
交易性金融资产	-	-	22,042.28	19,556,430.58	19,578,472.86
应收证券清算款	-	-	-	664,859.35	664,859.35
应收利息	-	-	-	960.38	960.38
应收申购款	-	-	-	4,186.62	4,186.62
资产总计	1,806,186.88	-	22,042.28	20,226,436.93	22,054,666.09
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	486,413.99	486,413.99
应付管理人报酬	-	-	-	3,036.81	3,036.81
应付托管费	-	-	-	607.36	607.36
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	107,838.16	107,838.16

应交税费	-	-	-	0.02	0.02
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	246,885.31	246,885.31
负债总计	-	-	-	844,781.65	844,781.65
利率敏感度缺口	1,806,186.88	-	22,042.28	19,381,655.28	21,209,884.44
上年度末 2018年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,289,380.02	-	-	-	2,289,380.02
存出保证金	35,891.32	-	-	-	35,891.32
交易性金融资产	-	-	20,949.56	21,832,175.35	21,853,124.91
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	483.68	483.68
应收申购款	-	-	-	3,079.17	3,079.17
资产总计	2,325,271.34	-	20,949.56	21,835,738.20	24,181,959.10
负债					
应付证券清算款	-	-	-	584,294.29	584,294.29
应付赎回款	-	-	-	480.68	480.68
应付管理人报酬	-	-	-	10,696.73	10,696.73
应付托管费	-	-	-	2,139.31	2,139.31
应付交易费用	-	-	-	105,272.32	105,272.32
应付税费	-	-	-	0.07	0.07
其他负债	-	-	-	298,001.69	298,001.69
负债总计	-	-	-	1,000,885.09	1,000,885.09
利率敏感度缺口	2,325,271.34	-	20,949.56	20,834,853.11	23,181,074.01

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.1.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2019年1月10日(基金合同失效前日),本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为0.10%(2018年12月31日:0.09%),因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2018年12月31日:同)。

7.1.4.12.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金

的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.1.4.12.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即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进行相应调整。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。深证 300 指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产的 90%，其他股票、新股、债券及及其它金融工具投资比例为基金资产的 5%-10%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.1.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 1 月 10 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	19,556,430.58	92.20
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
合计	19,556,430.58	92.20

7.1.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金市场价格风险决定于业绩比较基准的变动	
	除上述基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额（单位：人民币万元）
		本期末 2019 年 1 月 10 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 103
	业绩比较基准下降 5%	减少约 103

7.1.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 1 月 10 日(基金合同失效前日)，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 19,573,971.26 元，属于第二层次的余额为 4,501.60 元，无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第一层次 21,643,518.21 元，第二层次 209,606.70 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 1 月 10 日(基金合同失效前日)，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7.2 华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）

7.2.1 资产负债表（转型后）

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：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日
资 产：		-
银行存款	7.2.4.6.1	1,742,750.76
结算备付金		25,203.31
存出保证金		4,602.49
交易性金融资产	7.2.4.6.2	15,140,747.58
其中：股票投资		15,140,747.58
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.2.4.6.3	-
买入返售金融资产	7.2.4.6.4	-
应收证券清算款		82,799.28
应收利息	7.2.4.6.5	452.19
应收股利		-

应收申购款		3,312.39
递延所得税资产		-
其他资产	7.2.4.6.6	-
资产总计		16,999,868.00
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日
负 债:		-
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.2.4.6.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		178,270.80
应付管理人报酬		21,151.95
应付托管费		3,525.33
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.2.4.6.7	66,337.25
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.2.4.6.8	58,089.22
负债合计		327,374.55
所有者权益:		-
实收基金	7.2.4.6.9	19,686,192.33
未分配利润	7.2.4.6.10	-3,013,698.88
所有者权益合计		16,672,493.45
负债和所有者权益总计		16,999,868.00

注：1.报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2353 元，基金份额总额 13,496,251.49 份。

2.本财务报表的实际编制期间为 2019 年 1 月 11 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日止期间。

7.2.2 利润表

会计主体：华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2019 年 1 月 11 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2019 年 1 月 11 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		4,531,074.22
1.利息收入	7.2.4.6.11	15,618.53
其中：存款利息收入		15,511.92
债券利息收入		106.61
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		713,841.32
其中：股票投资收益	7.2.4.6.12	405,961.49
基金投资收益		-
债券投资收益	7.2.4.6.13	4,851.41
资产支持证券投资收益	7.2.4.6.14	-
贵金属投资收益	7.2.4.6.15	-
衍生工具收益	7.2.4.6.16	-
股利收益	7.2.4.6.17	303,028.42
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.2.4.6.18	3,759,332.06
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.2.4.6.19	42,282.31
减：二、费用		713,166.12
1. 管理人报酬	7.2.4.9.2	258,043.76

2. 托管费	7.2.4.9.2	43,007.26
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.2.4.6.20	217,254.95
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.2.4.6.21	194,860.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,817,908.10
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,817,908.10

注：本基金基金合同生效日为 2019 年 1 月 11 日，因此无上年度可比期间。

7.2.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2019 年 1 月 11 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2019 年 1 月 11 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	31,085,420.67	-9,875,536.23	21,209,884.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,817,908.10	3,817,908.10
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-11,399,228.34	3,043,929.25	-8,355,299.09
其中：1.基金申购款	8,432,924.44	-1,821,973.83	6,610,950.61
2.基金赎回款	-19,832,152.78	4,865,903.08	-14,966,249.70

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	19,686,192.33	-3,013,698.88	16,672,493.45

注：本基金基金合同生效日为 2019 年 1 月 11 日，因此无上年度可比期间。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：赵敏，会计机构负责人：陈林

7.2.4 报表附注

7.2.4.1 基金基本情况

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)(以下简称“华安深证 300 基金”)基金转型而来。

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)》和《华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）托管协议》失效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。原基金于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 21,209,884.44 元，已于本基金的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。

根据本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2019 年 1 月 24 日发布的《关于华安量化多因子混合型证券投资基金(LOF)份额折算比例及停复牌的公告》，基金管理人以 2019 年 1 月 23 日为

份额折算基准日，在基金份额持有人持有的基金份额所代表的资产净值总额保持不变的前提下，对本基金基金份额施行折算，并将基金份额净值调整为 1.0000 元，基金份额数按折算比例 0.685569884 相应调整。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》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)。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。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2020 年 4 月 7 日批准报出。

7.2.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)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》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2019 年 12 月 31 日，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

7.2.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年 1 月 11 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年 1 月 11 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.2.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.2.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2019 年 1 月 11 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日。

7.2.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.2.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项, 包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.2.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时, 按公允价值在资产负债表内确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.2.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.2.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负

债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.2.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.2.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.2.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.2.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.2.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未

实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.2.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.2.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(私

募债券除外), 按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.2.4.4.14 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.2.4.4.15 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.2.4.4.16 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.2.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为, 以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为, 暂适用简易计税方法, 按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税, 对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务, 以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股票的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入, 应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得, 持股期限在1个月以内(含1个月)的, 其股

息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.2.4.6重要财务报表项目的说明

7.2.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2019 年 12 月 31 日	
活期存款	1,742,750.76	
定期存款	-	
其他存款	-	
合计	1,742,750.76	

7.2.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	13,906,501.49	15,140,747.58	1,234,246.09
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	13,906,501.49	15,140,747.58	1,234,246.09

7.2.4.6.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

7.2.4.6.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

7.2.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	438.24
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	11.40
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.45
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	2.10
合计	452.19

7.2.4.6.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

7.2.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	66,337.25
银行间市场应付交易费用	-
合计	66,337.25

7.2.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	89.22
预提审计费	58,000.00
合计	58,089.22

7.2.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月11日至2019年12月31日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	31,085,420.67	31,085,420.67
基金份额折算调整	-7,024,205.75	
本期申购	5,790,533.88	8,432,924.44
本期赎回（以“—”号填列）	-16,355,497.31	-19,832,152.78
本期末	13,496,251.49	19,686,192.33

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 原华安深证 300 基金于基金合同失效前的实收基金为 31,085,420.67 元，已于本基金基金合同生效日全部转为本基金的实收基金。

3. 根据《华安量化多因子混合型证券投资基金(LOF)基金合同》、《华安量化多因子混合型证券投资基金(LOF)基金募集说明书》和《关于华安量化多因子混合型证券投资基金(LOF)开放申购、赎回及定投业务的公告》的相关规定，本基金于 2019 年 1 月 11 日(基金合同生效日)至 2019 年 1 月 24 日止期间不向投资人开放基金交易。申购、赎回以及定期定额投资业务自 2019 年 1 月 25 日期开始办理。

4. 根据《华安量化多因子混合型证券投资基金(LOF)基金合同》的相关规定和《关于华安量化多因

子混合型证券投资基金(LOF)份额折算公告》，本基金的基金管理人华安基金公司以 2019 年 1 月 23 日为本基金的基金份额折算基准日和权益登记日，2019 年 1 月 24 日为折算处理日和场内除权日，对本基金份额实施份额折算。折算前，本基金场内份额和场外份额分别为 1,338,510.00 份和 21,000,970.99 份，根据基金份额折算公式，新增基金份额折算比例为 0.685569884，折算后本基金场内份额和场外份额分别为 917,642.00 份和 14,397,633.24 份，基金份额净值为 1.0000 元。中国证券登记结算有限责任公司已根据上述折算比例，对全体基金份额持有人持有的基金份额进行了折算，并于 2019 年 1 月 24 日进行了变更登记。

5.截至 2019 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 706,958.00 份，托管在场外未上市交易的基金份额为 12,789,293.49 份。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

7.2.4.6.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-3,350,146.22	-6,525,390.01	-9,875,536.23
本期利润	58,576.04	3,759,332.06	3,817,908.10
本期基金份额交易产生的变动数	1,143,308.56	1,900,620.69	3,043,929.25
其中：基金申购款	-1,475,048.63	-346,925.20	-1,821,973.83
基金赎回款	2,618,357.19	2,247,545.89	4,865,903.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,148,261.62	-865,437.26	-3,013,698.88

7.2.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 11 日至 2019 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	14,188.23
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,070.91

其他	252.78
合计	15,511.92

7.2.4.6.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月11日至2019年12月31日
卖出股票成交总额	74,865,713.68
减：卖出股票成本总额	74,459,752.19
买卖股票差价收入	405,961.49

7.2.4.6.13 债券投资收益

7.2.4.6.13.1 债券投资收益项目构成

项目	本期 2019年1月11日至2019年12月31日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4,851.41
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	4,851.41

7.2.4.6.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月11日至2019年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	99,072.25
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	94,100.00
减：应收利息总额	120.84
买卖债券差价收入	4,851.41

7.2.4.6.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

7.2.4.6.15 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

7.2.4.6.16 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具投资。

7.2.4.6.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月11日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	303,028.42
基金投资产生的股利收益	-
合计	303,028.42

7.2.4.6.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019年1月11日至2019年12月31日
1.交易性金融资产	3,759,332.06
——股票投资	3,761,274.34
——债券投资	-1,942.28
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	3,759,332.06

7.2.4.6.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月11日至2019年12月31日
基金赎回费收入	42,282.31
合计	42,282.31

7.2.4.6.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月11日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	217,254.95
银行间市场交易费用	-
合计	217,254.95

7.2.4.6.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月11日至2019年12月31日
审计费用	56,356.20
信息披露费	-1,643.80
指数使用费	-121.47
银行汇划费	3,912.71
上市年费	58,356.20
账户维护费	18,000.00
其他费用	60,000.31
合计	194,860.15

7.2.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.2.4.7.1 或有事项

无。

7.2.4.7.2 资产负债表日后事项

无。

7.2.4.8 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司(“华安基金公司”)	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
国泰君安证券股份有限公司(“国泰君安”)	基金管理人的股东、基金销售机构
上海上国投资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东
华安资产管理(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司
华安未来资产管理(上海)有限公司	基金管理人的全资子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.2.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.2.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.2.4.9.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月11日至2019年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安证券股份 有限公司	48,071,216.82	34.06%

7.2.4.9.1.2 权证交易

无。

7.2.4.9.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月11日至2019年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国泰君安证券股份有	22,313.45	22.52%

限公司		
-----	--	--

7.2.4.9.1.4 债券回购交易

无。

7.2.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月11日至2019年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国泰君安证券股份有 限公司	43,807.77	33.73%	30,691.02	46.27%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.2.4.9.2 关联方报酬

7.2.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月11日至2019年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	91,813.09

注：支付基金管理人华安基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

7.2.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期

	2019年1月11日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	43,007.26

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

7.2.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.2.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

7.2.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.2.4.9.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.2.4.9.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月11日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	1,742,750.76	14,188.23

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.2.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2019年1月11日至2019年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
国泰君安证	110059	浦发转债	老股东配	160.00	16,000.00

券股份有限 公司			售		
-------------	--	--	---	--	--

7.2.4.9.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.2.4.10 利润分配情况

无。

7.2.4.11 期末（2019 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.2.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.2.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.2.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.2.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 12 月 31 日止，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.2.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末 2019 年 12 月 31 日止，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.2.4.12 金融工具风险及管理

本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益都要低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于证券投资基金中的中等风险和中等收益投资品种。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。

7.2.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立合规与风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。监察稽核部和风险管理部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.2.4.12.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2019 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券投资（2018 年 12 月 31 日：持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.09%）。

7.2.4.12.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金份额持有人利益。

于 2019 年 12 月 31 日，本基金所承担的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.2.4.12.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.2.4.11。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2019 年 12 月 31 日，本基金无流动性受限资产。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2019 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为 16,969,610.01 元，超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动

性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.2.4.12.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.2.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

7.2.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,742,750.76	-	-	-	1,742,750.76
结算备付金	25,203.31	-	-	-	25,203.31
存出保证金	4,602.49	-	-	-	4,602.49
交易性金融资产	-	-	-	15,140,747.58	15,140,747.58
应收证券清算款	-	-	-	82,799.28	82,799.28
应收利息	-	-	-	452.19	452.19
应收申购款	-	-	-	3,312.39	3,312.39

资产总计	1,772,556.56	-	-	15,227,311.44	16,999,868.00
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	178,270.80	178,270.80
应付管理人报酬	-	-	-	21,151.95	21,151.95
应付托管费	-	-	-	3,525.33	3,525.33
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	66,337.25	66,337.25
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	58,089.22	58,089.22
负债总计	-	-	-	327,374.55	327,374.55
利率敏感度缺口	1,772,556.56	-	-	14,899,936.89	16,672,493.45

表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.2.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2019 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券资产，且持有的银行存款均为活期存款，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.2.4.12.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.2.4.12.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即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进行相应调整。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资占基金资产的比例不低于 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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值不得超过基金资产净值的 10%；本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的 95%，其中有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%。

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.2.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	15,140,747.58	90.81
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
合计	15,140,747.58	90.81

7.2.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金市场价格风险决定于业绩比较基准的变动
	除上述基准以外的其他市场变量保持不变

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）
		本期末 2019 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 95
	业绩比较基准下降 5%	减少约 95

7.2.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 15,140,747.58 元，无属于第二或第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)

8.1.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	19,556,430.58	88.67
	其中：股票	19,556,430.58	88.67
2	固定收益投资	22,042.28	0.10
	其中：债券	22,042.28	0.10
	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	1,777,380.70	8.06
7	其他各项资产	698,812.53	3.17
8	合计	22,054,666.09	100.00

8.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.1.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	678,342.66	3.20
B	采矿业	63,748.16	0.30
C	制造业	11,458,066.57	54.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	157,083.98	0.74
E	建筑业	108,528.58	0.51

F	批发和零售业	437,280.39	2.06
G	交通运输、仓储和邮政业	184,250.98	0.87
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,567,159.37	7.39
J	金融业	1,499,538.19	7.07
K	房地产业	1,379,719.17	6.51
L	租赁和商务服务业	184,406.54	0.87
M	科学研究和技术服务业	48,728.00	0.23
N	水利、环境和公共设施管理业	87,248.29	0.41
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	228,291.68	1.08
R	文化、体育和娱乐业	330,344.02	1.56
S	综合	41,705.40	0.20
	合计	18,454,441.98	87.01

8.1.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	4,501.60	0.02
C	制造业	728,342.00	3.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,476.00	0.17
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	166,574.00	0.79
J	金融业	25,200.00	0.12
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	61,840.00	0.29
R	文化、体育和娱乐业	80,055.00	0.38
S	综合	-	-
	合计	1,101,988.60	5.20

8.1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.1.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000333	美的集团	22,165	870,862.85	4.11
2	000651	格力电器	22,942	866,289.92	4.08
3	000002	万科A	21,295	534,717.45	2.52
4	300498	温氏股份	17,863	497,841.81	2.35
5	002415	海康威视	17,185	486,851.05	2.30
6	000858	五粮液	8,752	436,374.72	2.06
7	000001	平安银行	39,268	396,606.80	1.87
8	000725	京东方A	120,838	322,637.46	1.52
9	002304	洋河股份	2,741	252,692.79	1.19
10	300059	东方财富	18,378	229,908.78	1.08
11	000063	中兴通讯	11,312	227,031.84	1.07
12	002230	科大讯飞	7,560	221,205.60	1.04
13	002594	比亚迪	3,986	194,716.10	0.92
14	002142	宁波银行	11,595	190,042.05	0.90
15	000776	广发证券	14,230	188,120.60	0.89
16	002024	苏宁易购	16,615	177,282.05	0.84
17	000338	潍柴动力	22,271	174,159.22	0.82

18	002475	立讯精密	11,354	169,288.14	0.80
19	000538	云南白药	2,285	168,267.40	0.79
20	001979	招商蛇口	9,529	165,899.89	0.78
21	000661	长春高新	866	153,368.60	0.72
22	000568	泸州老窖	3,917	152,018.77	0.72
23	000540	中天金融	40,409	151,129.66	0.71
24	000100	TCL 科技	50,639	136,218.91	0.64
25	000166	申万宏源	31,168	134,957.44	0.64
26	002008	大族激光	4,314	124,070.64	0.58
27	002044	美年健康	8,813	122,765.09	0.58
28	000895	双汇发展	4,692	116,080.08	0.55
29	000069	华侨城 A	18,299	114,734.73	0.54
30	002202	金风科技	10,500	112,665.00	0.53
31	300142	沃森生物	5,722	108,031.36	0.51
32	000783	长江证券	19,415	107,753.25	0.51
33	300015	爱尔眼科	4,017	105,526.59	0.50
34	002466	天齐锂业	3,608	105,353.60	0.50
35	000423	东阿阿胶	2,607	104,201.79	0.49
36	002450	*ST 康得	12,711	99,654.24	0.47
37	002352	顺丰控股	3,002	98,525.64	0.46
38	002236	大华股份	7,917	95,004.00	0.45
39	000413	东旭光电	19,531	94,725.35	0.45
40	002422	科伦药业	4,589	93,523.82	0.44
41	002736	国信证券	10,605	92,369.55	0.44
42	300003	乐普医疗	4,882	90,170.54	0.43
43	000768	中航飞机	6,386	89,595.58	0.42
44	002456	欧菲光	9,800	89,082.00	0.42
45	300122	智飞生物	2,318	86,577.30	0.41
46	300136	信维通信	4,003	85,904.38	0.41
47	002001	新 和 成	5,759	85,290.79	0.40
48	000963	华东医药	3,276	84,881.16	0.40
49	002714	牧原股份	2,758	82,822.74	0.39
50	300024	机器人	5,947	82,128.07	0.39
51	300408	三环集团	5,197	82,112.60	0.39
52	002007	华兰生物	2,645	80,989.90	0.38
53	002739	万达电影	3,773	80,666.74	0.38
54	000157	中联重科	21,957	79,484.34	0.37
55	002179	中航光电	2,157	77,953.98	0.37
56	002410	广联达	3,431	77,815.08	0.37
57	002311	海大集团	3,385	76,162.50	0.36
58	000876	新 希 望	9,960	75,696.00	0.36
59	000625	长安汽车	10,210	75,349.80	0.36
60	000750	国海证券	14,479	74,856.43	0.35
61	300144	宋城演艺	3,788	74,244.80	0.35

62	000703	恒逸石化	5,804	73,304.52	0.35
63	002673	西部证券	8,845	72,263.65	0.34
64	000656	金科股份	11,500	70,035.00	0.33
65	002340	格林美	17,107	67,914.79	0.32
66	002241	歌尔股份	9,688	67,912.88	0.32
67	000425	徐工机械	20,814	67,853.64	0.32
68	002146	荣盛发展	8,438	67,166.48	0.32
69	000977	浪潮信息	4,203	67,121.91	0.32
70	002065	东华软件	9,478	66,251.22	0.31
71	002465	海格通信	7,858	64,671.34	0.30
72	002439	启明星辰	2,789	64,565.35	0.30
73	002129	中环股份	8,604	64,099.80	0.30
74	300383	光环新网	4,627	64,083.95	0.30
75	002271	东方雨虹	4,698	63,939.78	0.30
76	002405	四维图新	4,246	63,859.84	0.30
77	300253	卫宁健康	5,720	63,778.00	0.30
78	300017	网宿科技	7,801	63,032.08	0.30
79	000709	河钢股份	20,975	62,925.00	0.30
80	002049	紫光国微	2,043	62,291.07	0.29
81	002602	世纪华通	3,096	62,260.56	0.29
82	000623	吉林敖东	4,191	62,026.80	0.29
83	002797	第一创业	10,027	61,365.24	0.29
84	000401	冀东水泥	4,931	61,341.64	0.29
85	002050	三花智控	4,557	61,154.94	0.29
86	300450	先导智能	2,209	60,637.05	0.29
87	000630	铜陵有色	29,828	59,656.00	0.28
88	002195	二三四五	15,733	59,628.07	0.28
89	000786	北新建材	4,169	59,241.49	0.28
90	002493	荣盛石化	5,672	58,648.48	0.28
91	000998	隆平高科	4,016	56,063.36	0.26
92	000690	宝新能源	8,341	55,968.11	0.26
93	000997	新大陆	3,678	55,758.48	0.26
94	002223	鱼跃医疗	2,806	55,474.62	0.26
95	002038	双鹭药业	2,199	54,996.99	0.26
96	002081	金螳螂	6,817	54,740.51	0.26
97	002624	完美世界	2,104	54,725.04	0.26
98	300296	利亚德	7,707	54,026.07	0.25
99	002092	中泰化学	7,479	53,699.22	0.25
100	002252	上海莱士	7,250	53,577.50	0.25
101	000778	新兴铸管	12,540	53,545.80	0.25
102	000830	鲁西化工	5,308	53,451.56	0.25
103	002268	卫士通	2,690	53,154.40	0.25
104	000960	锡业股份	5,008	51,732.64	0.24
105	002127	南极电商	6,400	51,584.00	0.24

106	002384	东山精密	5,048	51,540.08	0.24
107	000060	中金岭南	12,603	51,168.18	0.24
108	002500	山西证券	7,824	50,934.24	0.24
109	002281	光迅科技	1,900	50,920.00	0.24
110	002572	索菲亚	3,005	50,694.35	0.24
111	002013	中航机电	6,753	50,647.50	0.24
112	000961	中南建设	8,912	50,620.16	0.24
113	000627	天茂集团	8,988	49,973.28	0.24
114	000988	华工科技	3,991	49,847.59	0.24
115	000686	东北证券	7,210	49,821.10	0.23
116	002470	金正大	7,344	49,792.32	0.23
117	002153	石基信息	1,900	49,780.00	0.23
118	300676	华大基因	800	48,728.00	0.23
119	300072	三聚环保	5,254	48,599.50	0.23
120	002217	合力泰	9,270	48,482.10	0.23
121	000999	华润三九	2,092	47,844.04	0.23
122	000581	威孚高科	2,696	47,153.04	0.22
123	002138	顺络电子	3,252	47,088.96	0.22
124	000825	太钢不锈	10,983	46,677.75	0.22
125	002074	国轩高科	3,800	46,132.00	0.22
126	000039	中集集团	4,093	46,005.32	0.22
127	002371	北方华创	1,100	45,716.00	0.22
128	000418	小天鹅 A	1,000	45,680.00	0.22
129	300315	掌趣科技	12,412	45,676.16	0.22
130	002032	苏泊尔	900	45,396.00	0.21
131	002110	三钢闽光	3,400	45,322.00	0.21
132	000547	航天发展	5,145	44,915.85	0.21
133	002085	万丰奥威	5,776	44,764.00	0.21
134	002221	东华能源	5,405	44,212.90	0.21
135	002075	沙钢股份	6,140	44,208.00	0.21
136	000898	鞍钢股份	8,703	44,124.21	0.21
137	300168	万达信息	3,818	44,021.54	0.21
138	300166	东方国信	4,053	43,610.28	0.21
139	300014	亿纬锂能	2,619	42,768.27	0.20
140	002353	杰瑞股份	2,613	42,461.25	0.20
141	000671	阳光城	8,004	42,341.16	0.20
142	000513	丽珠集团	1,600	41,840.00	0.20
143	300088	长信科技	9,358	41,830.26	0.20
144	000009	中国宝安	9,372	41,705.40	0.20
145	300009	安科生物	3,200	41,376.00	0.20
146	002078	太阳纸业	6,968	41,320.24	0.19
147	000050	深天马 A	4,212	41,319.72	0.19
148	000983	西山煤电	7,706	41,304.16	0.19
149	002640	跨境通	3,802	41,175.66	0.19

150	002294	信立泰	1,985	40,652.80	0.19
151	000826	启迪环境	3,754	39,341.92	0.19
152	000596	古井贡酒	725	39,229.75	0.18
153	000046	泛海控股	7,971	39,217.32	0.18
154	002019	亿帆医药	3,816	39,114.00	0.18
155	000932	华菱钢铁	6,400	39,040.00	0.18
156	002120	韵达股份	1,300	38,883.00	0.18
157	300251	光线传媒	4,703	38,705.69	0.18
158	002385	大北农	12,122	38,669.18	0.18
159	300628	亿联网络	501	38,592.03	0.18
160	000402	金融街	5,666	38,415.48	0.18
161	300027	华谊兄弟	8,319	38,350.59	0.18
162	002176	江特电机	6,262	38,260.82	0.18
163	002373	千方科技	3,300	38,181.00	0.18
164	002183	怡亚通	7,590	38,025.90	0.18
165	000598	兴蓉环境	9,233	37,855.30	0.18
166	300073	当升科技	1,404	37,851.84	0.18
167	000732	泰禾集团	2,689	37,538.44	0.18
168	300170	汉得信息	3,584	37,022.72	0.17
169	000488	晨鸣纸业	6,299	36,471.21	0.17
170	000887	中鼎股份	3,570	36,378.30	0.17
171	000938	紫光股份	1,126	35,818.06	0.17
172	300182	捷成股份	8,191	35,630.85	0.17
173	300418	昆仑万维	2,691	35,521.20	0.17
174	002185	华天科技	8,198	35,415.36	0.17
175	000970	中科三环	4,473	35,381.43	0.17
176	000028	国药一致	890	35,155.00	0.17
177	002273	水晶光电	3,516	35,089.68	0.17
178	002583	海能达	4,253	35,002.19	0.17
179	000559	万向钱潮	6,397	34,863.65	0.16
180	000738	航发控制	2,693	34,847.42	0.16
181	300133	华策影视	4,500	34,785.00	0.16
182	002601	龙蟠佰利	2,801	34,564.34	0.16
183	000008	神州高铁	8,562	34,333.62	0.16
184	002916	深南电路	400	34,208.00	0.16
185	000878	云南铜业	4,153	33,888.48	0.16
186	002589	瑞康医药	4,987	33,712.12	0.16
187	002010	传化智联	5,194	33,189.66	0.16
188	000883	湖北能源	8,958	33,144.60	0.16
189	002151	北斗星通	1,500	32,700.00	0.15
190	300699	光威复材	900	32,562.00	0.15
191	002491	通鼎互联	3,887	32,456.45	0.15
192	000415	渤海租赁	8,640	32,400.00	0.15
193	300207	欣旺达	3,703	32,327.19	0.15

194	000930	中粮科技	4,392	32,281.20	0.15
195	000807	云铝股份	7,977	31,668.69	0.15
196	002555	三七互娱	3,105	31,484.70	0.15
197	002168	惠程科技	3,132	31,445.28	0.15
198	002152	广电运通	5,505	31,378.50	0.15
199	002831	裕同科技	747	31,366.53	0.15
200	300316	晶盛机电	3,000	31,020.00	0.15
201	002035	华帝股份	3,500	30,520.00	0.14
202	002408	齐翔腾达	4,358	30,375.26	0.14
203	000027	深圳能源	5,693	30,115.97	0.14
204	002051	中工国际	2,600	29,874.00	0.14
205	300058	蓝色光标	6,534	29,206.98	0.14
206	300113	顺网科技	2,188	28,859.72	0.14
207	002597	金禾实业	1,900	28,804.00	0.14
208	002299	圣农发展	1,658	28,733.14	0.14
209	300496	中科创达	1,116	28,446.84	0.13
210	300618	寒锐钴业	400	28,380.00	0.13
211	002497	雅化集团	4,102	28,262.78	0.13
212	002426	胜利精密	10,223	28,113.25	0.13
213	000793	华闻集团	8,765	27,960.35	0.13
214	002030	达安基因	2,724	27,921.00	0.13
215	000059	华锦股份	4,625	27,888.75	0.13
216	000717	韶钢松山	5,996	27,701.52	0.13
217	300222	科大智能	1,810	27,367.20	0.13
218	002280	联络互动	6,479	26,434.32	0.12
219	001965	招商公路	3,200	25,856.00	0.12
220	002244	滨江集团	6,700	25,527.00	0.12
221	002285	世联行	5,313	25,502.40	0.12
222	002665	首航高科	8,802	25,173.72	0.12
223	002411	延安必康	1,300	24,895.00	0.12
224	300159	新研股份	4,633	24,323.25	0.11
225	300433	蓝思科技	3,671	24,228.60	0.11
226	300355	蒙草生态	5,849	24,156.37	0.11
227	300055	万邦达	2,993	23,914.07	0.11
228	002056	横店东磁	3,989	23,854.22	0.11
229	300197	铁汉生态	6,250	23,750.00	0.11
230	300115	长盈精密	2,854	23,145.94	0.11
231	000933	神火股份	5,769	23,018.31	0.11
232	002670	国盛金控	2,200	22,946.00	0.11
233	000877	天山股份	3,066	22,627.08	0.11
234	002128	露天煤业	3,100	22,444.00	0.11
235	002468	申通快递	1,282	20,986.34	0.10
236	000564	供销大集	7,586	20,861.50	0.10
237	002635	安洁科技	1,795	20,498.90	0.10

238	002359	*ST 北讯	2,300	20,355.00	0.10
239	002600	领益智造	7,492	20,228.40	0.10
240	002716	ST 金贵	2,900	20,184.00	0.10
241	002424	贵州百灵	2,211	19,390.47	0.09
242	000537	广宇发展	2,200	16,874.00	0.08
243	000723	美锦能源	4,765	15,676.85	0.07
244	000959	首钢股份	3,846	14,884.02	0.07
245	002477	雏鹰退	8,001	12,881.61	0.06
246	000617	中油资本	741	7,528.56	0.04

8.1.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	1,400	106,792.00	0.50
2	300760	迈瑞医疗	800	82,656.00	0.39
3	000860	顺鑫农业	1,900	65,018.00	0.31
4	300347	泰格医药	1,600	61,840.00	0.29
5	002180	纳思达	2,000	50,300.00	0.24
6	002507	涪陵榨菜	2,300	48,507.00	0.23
7	300601	康泰生物	1,400	45,850.00	0.22
8	002821	凯莱英	600	42,594.00	0.20
9	000681	视觉中国	1,700	41,905.00	0.20
10	300413	芒果超媒	1,000	38,150.00	0.18
11	002399	海普瑞	1,800	35,766.00	0.17
12	000040	东旭蓝天	4,900	35,476.00	0.17
13	002841	视源股份	600	34,440.00	0.16
14	300038	数知科技	3,500	34,160.00	0.16
15	002023	海特高新	3,000	32,250.00	0.15
16	300036	超图软件	1,800	31,572.00	0.15
17	000528	柳 工	5,100	31,416.00	0.15
18	300188	美亚柏科	2,000	28,380.00	0.13
19	002368	太极股份	1,200	28,320.00	0.13
20	300377	赢时胜	2,300	26,128.00	0.12
21	002926	华西证券	2,800	25,200.00	0.12
22	002262	恩华药业	2,700	23,517.00	0.11
23	002563	森马服饰	2,700	22,950.00	0.11
24	002773	康弘药业	600	21,426.00	0.10
25	002745	木林森	1,800	21,402.00	0.10
26	300308	中际旭创	500	20,430.00	0.10
27	300454	深信服	200	18,014.00	0.08
28	002925	盈趣科技	400	17,040.00	0.08
29	000553	安道麦 A	1,400	13,174.00	0.06

30	300747	锐科激光	100	12,814.00	0.06
31	000693	*ST 华泽	1,360	4,501.60	0.02

8.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.1.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未买入股票。

8.1.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002027	分众传媒	221,613.52	0.96
2	300124	汇川技术	122,453.24	0.53
3	000651	格力电器	97,187.90	0.42
4	000333	美的集团	94,720.85	0.41
5	002460	赣锋锂业	90,854.72	0.39
6	000728	国元证券	82,811.56	0.36
7	300070	碧水源	68,216.84	0.29
8	300146	汤臣倍健	68,164.82	0.29
9	000002	万 科 A	61,058.84	0.26
10	000503	国新健康	57,931.00	0.25
11	300498	温氏股份	55,996.59	0.24
12	002508	老板电器	53,579.80	0.23
13	000839	中信国安	51,569.91	0.22
14	002415	海康威视	51,139.10	0.22
15	002506	协鑫集成	50,469.06	0.22
16	000066	中国长城	49,919.00	0.22
17	002310	东方园林	47,148.64	0.20
18	000001	平安银行	45,509.00	0.20
19	300274	阳光电源	45,427.00	0.20
20	000858	五 粮 液	43,879.50	0.19

8.1.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	0.00
卖出股票的收入（成交）总额	2,815,565.34

8.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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）	22,042.28	0.10
8	其他	-	-
9	合计	22,042.28	0.10

8.1.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	128045	机电转债	142	15,852.88	0.07
2	128048	张行转债	43	4,418.68	0.02
3	128047	光电转债	16	1,770.72	0.01

8.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

8.1.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.1.9 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投资。

8.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**8.1.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.1.10.2 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。

8.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.1.11.1 本期国债期货投资政策**

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

8.1.11.2 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。

8.1.12 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。

8.1.13 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。

8.1.13.1 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	28,806.18
2	应收证券清算款	664,859.35
3	应收股利	-
4	应收利息	960.38
5	应收申购款	4,186.62

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	698,812.53

8.1.13.2 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	128045	机电转债	15,852.88	0.07
2	128048	张行转债	4,418.68	0.02
3	128047	光电转债	1,770.72	0.01

8.1.13.3 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.1.13.3.1 期末指数投资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。

8.1.13.3.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。

8.2 华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）

8.2.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	15,140,747.58	89.06
	其中：股票	15,140,747.58	89.06
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	1,767,954.07	10.40
7	其他各项资产	91,166.35	0.54
8	合计	16,999,868.00	100.00

8.2.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	7,847,450.00	47.07
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	316,336.00	1.90
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	1,360,452.00	8.16
J	金融业	4,681,199.66	28.08
K	房地产业	534,698.92	3.21
L	租赁和商务服务业	97,845.00	0.59
M	科学研究和技术服务业	162,583.00	0.98
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	140,183.00	0.84
S	综合	-	-
	合计	15,140,747.58	90.81

8.2.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	11,300	965,698.00	5.79
2	000333	美的集团	11,700	681,525.00	4.09
3	601009	南京银行	54,400	477,088.00	2.86
4	600519	贵州茅台	400	473,200.00	2.84
5	601377	兴业证券	65,800	465,864.00	2.79
6	002839	张家港行	73,100	434,214.00	2.60
7	600690	海尔智家	21,800	425,100.00	2.55
8	601877	正泰电器	15,600	418,080.00	2.51
9	600048	保利地产	25,700	415,826.00	2.49
10	601166	兴业银行	20,000	396,000.00	2.38
11	600201	生物股份	20,500	383,760.00	2.30
12	600036	招商银行	10,200	383,316.00	2.30
13	600837	海通证券	23,800	367,948.00	2.21
14	600919	江苏银行	47,100	341,004.00	2.05
15	002230	科大讯飞	9,800	337,904.00	2.03
16	600436	片仔癀	2,900	318,623.00	1.91
17	002727	一心堂	13,600	316,336.00	1.90
18	002304	洋河股份	2,400	265,200.00	1.59
19	600958	东方证券	24,200	260,392.00	1.56
20	000066	中国长城	15,100	234,956.00	1.41
21	600585	海螺水泥	4,200	230,160.00	1.38
22	002475	立讯精密	6,150	224,475.00	1.35
23	600809	山西汾酒	2,500	224,250.00	1.35
24	000728	国元证券	23,858	221,163.66	1.33
25	002271	东方雨虹	7,700	202,587.00	1.22
26	600660	福耀玻璃	8,100	194,319.00	1.17
27	002415	海康威视	5,900	193,166.00	1.16
28	600741	华域汽车	7,300	189,727.00	1.14

29	002439	启明星辰	5,600	189,280.00	1.14
30	002138	顺络电子	8,100	187,110.00	1.12
31	300523	辰安科技	4,000	179,440.00	1.08
32	300451	创业慧康	10,000	179,400.00	1.08
33	603298	杭叉集团	13,800	177,744.00	1.07
34	000568	泸州老窖	2,000	173,360.00	1.04
35	600104	上汽集团	7,100	169,335.00	1.02
36	000977	浪潮信息	5,600	168,560.00	1.01
37	300136	信维通信	3,700	167,906.00	1.01
38	601288	农业银行	45,500	167,895.00	1.01
39	002368	太极股份	4,300	167,356.00	1.00
40	002812	恩捷股份	3,300	166,650.00	1.00
41	600745	闻泰科技	1,800	166,500.00	1.00
42	002273	水晶光电	10,300	166,448.00	1.00
43	600089	特变电工	25,000	166,250.00	1.00
44	300497	富祥股份	8,800	166,056.00	1.00
45	600728	佳都科技	17,700	166,026.00	1.00
46	603283	赛腾股份	5,300	165,625.00	0.99
47	600438	通威股份	12,600	165,438.00	0.99
48	002832	比音勒芬	6,300	163,611.00	0.98
49	002236	大华股份	8,200	163,016.00	0.98
50	300284	苏交科	19,900	162,583.00	0.98
51	002241	歌尔股份	8,100	161,352.00	0.97
52	300146	汤臣倍健	8,800	143,352.00	0.86
53	300365	恒华科技	10,900	141,046.00	0.85
54	600373	中文传媒	10,300	140,183.00	0.84
55	000002	万科A	3,694	118,872.92	0.71
56	600000	浦发银行	9,300	115,041.00	0.69
57	300124	汇川技术	3,500	107,240.00	0.64
58	601888	中国国旅	1,100	97,845.00	0.59
59	600038	中直股份	1,800	85,878.00	0.52
60	601328	交通银行	15,200	85,576.00	0.51
61	300014	亿纬锂能	1,600	80,256.00	0.48
62	603659	璞泰来	900	76,635.00	0.46

8.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.2.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)

1	601009	南京银行	1,118,594.00	5.27
2	601318	中国平安	984,578.00	4.64
3	002236	大华股份	800,462.00	3.77
4	600048	保利地产	797,896.00	3.76
5	601328	交通银行	739,159.00	3.48
6	002439	启明星辰	686,593.00	3.24
7	601333	广深铁路	681,896.00	3.21
8	601169	北京银行	664,121.00	3.13
9	600879	航天电子	662,959.00	3.13
10	600390	五矿资本	652,685.00	3.08
11	600016	民生银行	641,522.00	3.02
12	000333	美的集团	612,760.00	2.89
13	600000	浦发银行	593,506.00	2.80
14	600522	中天科技	583,881.00	2.75
15	601398	工商银行	559,153.00	2.64
16	300274	阳光电源	540,346.00	2.55
17	002281	光迅科技	536,812.00	2.53
18	600872	中炬高新	536,251.00	2.53
19	002153	石基信息	533,796.00	2.52
20	601877	正泰电器	516,318.00	2.43
21	002230	科大讯飞	511,688.00	2.41
22	601166	兴业银行	508,195.00	2.40
23	600126	杭钢股份	507,749.10	2.39
24	600837	海通证券	498,237.00	2.35
25	000543	皖能电力	491,504.00	2.32
26	601898	中煤能源	490,446.00	2.31
27	000028	国药一致	486,544.00	2.29
28	600875	东方电气	482,704.00	2.28
29	601818	光大银行	468,448.00	2.21
30	600519	贵州茅台	449,861.00	2.12
31	600362	江西铜业	446,419.36	2.10
32	002304	洋河股份	441,082.00	2.08
33	002839	张家港行	430,790.00	2.03
34	601377	兴业证券	424,355.00	2.00

8.2.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000651	格力电器	993,111.24	4.68

2	000333	美的集团	901,770.54	4.25
3	300498	温氏股份	864,929.68	4.08
4	002236	大华股份	827,251.67	3.90
5	600390	五矿资本	778,921.40	3.67
6	601009	南京银行	750,094.00	3.54
7	000001	平安银行	743,681.32	3.51
8	600879	航天电子	711,128.00	3.35
9	601333	广深铁路	682,082.00	3.22
10	600016	民生银行	665,458.00	3.14
11	601328	交通银行	658,044.00	3.10
12	600872	中炬高新	640,858.00	3.02
13	601169	北京银行	634,956.00	2.99
14	000990	诚志股份	611,671.00	2.88
15	600522	中天科技	604,325.64	2.85
16	600875	东方电气	600,421.95	2.83
17	002281	光迅科技	592,638.00	2.79
18	002439	启明星辰	592,212.65	2.79
19	000063	中兴通讯	575,699.80	2.71
20	002415	海康威视	573,045.79	2.70
21	002153	石基信息	571,193.00	2.69
22	000028	国药一致	565,574.00	2.67
23	601398	工商银行	550,026.00	2.59
24	300274	阳光电源	543,914.00	2.56
25	000543	皖能电力	531,280.00	2.50
26	600000	浦发银行	522,531.00	2.46
27	300003	乐普医疗	513,697.94	2.42
28	600126	杭钢股份	508,352.00	2.40
29	000877	天山股份	501,147.96	2.36
30	601898	中煤能源	484,982.00	2.29
31	000858	五粮液	483,244.30	2.28
32	000002	万科A	481,080.88	2.27
33	000826	启迪环境	478,392.90	2.26
34	002142	宁波银行	472,880.60	2.23
35	300458	全志科技	455,249.00	2.15
36	601818	光大银行	448,943.00	2.12
37	002304	洋河股份	447,804.76	2.11
38	002475	立讯精密	430,998.00	2.03
39	600048	保利地产	426,588.00	2.01

8.2.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	66,282,794.85
---------------	---------------

卖出股票的收入（成交）总额	74,865,713.68
---------------	---------------

8.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.2.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

8.2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

8.2.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.2.9 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投资。

8.2.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.2.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.2.10.2 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。

8.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.2.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

8.2.11.2 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。

8.2.12 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。

8.2.13 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。

8.2.13.1 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,602.49
2	应收证券清算款	82,799.28
3	应收股利	-
4	应收利息	452.19
5	应收申购款	3,312.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	91,166.35

8.2.13.2 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.2.13.3 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)

9.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户	户均持有的	持有人结构
------	-------	-------

数(户)	基金份额	机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,345	23,111.84	0.00	0.00%	31,085,420.67	100.00%

9.1.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	叶俊琼	7,011,220.20	22.55%
2	望月英里	1,988,251.57	6.40%
3	高盼	1,391,393.39	4.48%
4	蔺杰	904,027.44	2.91%
5	林志英	849,790.65	2.73%
6	金幼文	695,697.39	2.24%
7	易丰	637,474.74	2.05%
8	朱若增	495,387.00	1.59%
9	李少芳	495,207.00	1.59%
10	蒋冰	495,094.50	1.59%

9.1.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	239,025.65	0.77%

9.1.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	-
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

注：本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为0。

9.2 华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）

9.2.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户	户均持有的	持有人结构

数(户)	基金份额	机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,244	10,849.08	0.00	0.00%	13,496,251.49	100.00%

9.2.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	望月英里	1,363,085.40	10.10%
2	蔺杰	619,774.06	4.59%
3	林志英	582,590.89	4.32%
4	李少芳	339,499.01	2.52%
5	蒋冰	339,421.88	2.51%
6	易丰	241,111.50	1.79%
7	卢奕	234,753.88	1.74%
8	袁宁	224,246.14	1.66%
9	林志坚	213,905.10	1.58%
10	许宝佩	203,791.96	1.51%

9.2.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	165,535.84	1.23%

9.2.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	-
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

注：本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

§10 开放式基金份额变动

10.1 华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)

单位：份

基金合同生效日（2011 年 9 月 2 日）基金份额总额	608,040,554.70
基金合同生效日起至报告期期初基金份额总额	34,834,086.06
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	292,896.89
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	4,041,562.28
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	31,085,420.67

10.2 华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）

单位：份

基金合同生效日（2019 年 1 月 11 日）基金份额总额	31,085,420.67
基金合同生效日起至报告期期初基金份额总额	31,085,420.67
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	5,790,533.88
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	16,355,497.31
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-7,024,205.75
本报告期期末基金份额总额	13,496,251.49

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金于 2018 年 12 月 11 日至 2019 年 1 月 7 日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，会议期间审议并通过《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》，决议自 2019 年 1 月 9 日起生效，并已按规定向中国证券监督管理委员会备案。本基金修改后的《华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）基金合同》自 2019 年 1 月 11 日起生效。本次持有人大会详情请见本基金管理人于 2019 年 1 月 10 日发布的《关于华安深证 300 指数(LOF)基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

无。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

托管人中国银行自 2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

2019 年 6 月，刘连舸先生任中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本基金管理人于 2019 年 1 月 10 日发布的《关于华安深证 300 指数（LOF）基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，2019 年 1 月 11 日起“华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）”转型为“华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）”，基金的投资策略作出相应的改变。详情请见本基金管理人发布的相关公告。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为人民币 58,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2019 年 1 月 31 日，上海局根据 2018 年 11 月份来公司的现场检查情况，对我司出具了《关于对华安基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》（证监决[2019]11 号文）。公司高度重视，立即逐一落实各项整改要求，进一步提升公司内部控制和风险管理能力，2019 年 2 月 20 日，上海局对我司整改工作进行现场验收，对公司整改情况表示认可。

除上述情况外，本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）

11.7.1.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券	1	48,071,216.82	34.06%	43,807.77	33.73%	-
长江证券	1	31,178,963.92	22.09%	28,413.72	21.88%	-
西南证券	1	29,224,505.42	20.70%	27,215.89	20.96%	-
国信证券	1	16,010,244.84	11.34%	14,910.11	11.48%	-
安信证券	1	9,084,068.19	6.44%	8,459.97	6.51%	-
中泰证券	1	7,579,509.34	5.37%	7,059.22	5.44%	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

- (1) 内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (2) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；
- (3) 具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调调整体资源，为基金投资赢取机会；
- (4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由相关部门牵头并组织有关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》，对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管领导审批

公司分管领导对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

2019年5月完成租用托管在中国银行的招商证券上海36598交易单元

11.7.1.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期回购成交总 额的比例	成交金额	占当期权证成交总 额的比例
国泰君安证券	22,313.45	22.52%	-	-	-	-
西南证券	16,569.60	16.72%	-	-	-	-
国信证券	60,189.20	60.75%	-	-	-	-

11.7.2 华安深证300指数证券投资基金(LOF)

11.7.2.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总 额的比例	佣金	占当期佣金总量的 比例	
西南证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	2,815,565.34	100.00%	2,565.84	100.00%	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

(1) 内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(2) 研究实力较强, 有固定的研究机构和专门研究人员, 能够针对本基金业务需要, 提供高质量的研究报告和较为全面的服务;

(3) 具有战略规划和定位, 能够积极推动多边业务合作, 最大限度地调动整体资源, 为基金投资赢取机会;

(4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序:

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由相关部门牵头并组织有关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》, 对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果, 择优选出拟新增单元, 填写《新增交易单元申请审核表》, 对拟新增交易单元的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管领导审批

公司分管领导对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核, 并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》, 并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况:

2019年5月完成租用托管在中国银行的招商证券上海36598交易单元

11.8 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）基金基金合同	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2019-01-10
2	华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）托管协议	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2019-01-10
3	华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）	《上海证券报》、《证券	2019-01-10

	招募说明书	时报》、《中国证券报》 和公司网站	
4	关于旗下部分基金参加基煜基金费率优惠活动的公告（转换费）	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2019-01-15
5	关于华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）基金份额折算公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2019-01-18
6	关于华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）开放申购、赎回及定投业务的公告	《证券时报》和公司网站	2019-01-23
7	关于华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）开通系统内转托管和跨系统转托管业务的公告	《证券时报》和公司网站	2019-01-23
8	关于华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）份额折算比例及停复牌的公告	《证券时报》和公司网站	2019-01-24
9	关于华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）份额折算结果公告	《证券时报》和公司网站	2019-01-25
10	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-03-29
11	华安基金关于旗下基金参加中国中投证券优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-03-27
12	关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-03-29
13	关于华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）基金经理变更公告	《证券时报》和公司网站	2019-03-30
14	关于华安基金撤销沈阳分公司的公告	《证券时报》和公司网站	2019-04-10
15	华安基金关于旗下基金参加植信基金优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-04-12
16	关于旗下部分基金增加玄元保险为销售机构的公告	《证券时报》和公司网站	2019-04-27
17	华安基金关于旗下基金参加民生银行优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-05-14
18	华安基金关于旗下基金参加海银基金优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-05-28
19	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	《证券时报》和公司网站	2019-06-21
20	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-06-28
21	华安基金关于参加新时代证券优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-08-07
22	华安基金关于旗下基金参加海通证券优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-08-16
23	华安基金关于旗下基金参加中航证券优惠活	《证券时报》和公司网	2019-08-21

	动的公告	站	
24	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2019-09-30
25	关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2019-09-30
26	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方发行证券的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2019-10-31
27	关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司基金定期定额投资优惠活动的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2019-12-25
28	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2019-12-30
29	关于基金电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2019-12-30

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在指定媒介上披露。

11.9 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）持有人大会计票日开始停牌的提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2019-01-09
2	2019.01.10 关于华安深证 300 指数（LOF）基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2019-01-10
3	2019.01.11 华安基金管理有限公司关于华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）实施转型的提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2019-01-11
4	华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）转型后基金名称、基金简称及基金类型变更的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2019-01-11

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）

12.1.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

无。

12.2 华安深证300指数证券投资基金(LOF)**12.2.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况**

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
个人	1	20190101-20190110	7,011,220.20	0.00	7,011,220.20	0.00	0.00%
产品特有风险							
本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

§13 备查文件目录**13.1 备查文件目录**

- 1、《华安量化多因子混合型证券投资基金(LOF)基金合同》
- 2、《华安量化多因子混合型证券投资基金(LOF)招募说明书》
- 3、《华安量化多因子混合型证券投资基金(LOF)托管协议》
- 4、中国证监会批准华安量化多因子混合型证券投资基金(LOF)设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

13.2 存放地点

基金管理人和基金托管人住所，并登载于基金管理人互联网站 <http://www.huaan.com.cn>。

13.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，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。

华安基金管理有限公司

二〇二〇年四月十一日