

华安沪深 300 指数分级证券投资基金清算报告

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2020年7月6日

§1 重要提示

华安沪深 300 指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）基金部函[2012]521 号《关于华安沪深 300 指数分级证券投资基金备案确认的函》的确认，于 2012 年 6 月 25 日成立并正式运作。

根据市场环境变化，为保护基金份额持有人的利益，基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金管理人经与本基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，提议终止《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》，并召开基金份额持有人大会审议上述事项。根据管理人 2020 年 6 月 10 日发布的《关于华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本次基金份额持有人大会于 2020 年 6 月 9 日表决通过了《关于终止华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本次基金份额持有人大会决议自该日起生效。根据决议生效公告，本基金最后运作日为 2020 年 6 月 16 日，自 2020 年 6 月 17 日进入清算期。

基金管理人华安基金管理有限公司、基金托管人中国建设银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于 2020 年 6 月 17 日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

§2 基金产品概况

基金名称	华安沪深 300 指数分级证券投资基金
基金简称	华安沪深 300 指数分级
场内简称	华安 300
基金主代码	160417
交易代码	160417
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 6 月 25 日
基金管理人	华安基金管理有限公司

基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末(2020年6月16日)基金份额总额	7,671,614.39 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012年7月23日		
下属分级基金的基金简称	华安沪深 300 指数分级 A	华安沪深 300 指数分级 B	华安沪深 300 指数分级
下属分级基金的场内简称	HS300A	HS300B	华安 300
下属分级基金的交易代码	150104	150105	160417
报告期末下属分级基金的份额总额	1,191,712.00 份	1,191,712.00 份	5,288,190.39 份

§3 基金运作情况概述

华安沪深 300 指数分级证券投资基金(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[2012]278 号《关于核准华安沪深 300 指数分级证券投资基金募集的批复》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《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》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 607,221,793.60 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(2012)第 201 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》于 2012 年 6 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 607,313,857.99 份,其中认购资金利息折合 92,064.39 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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

自本基金基金合同生效日至最后运作日期间,本基金正常运作。

根据市场环境变化,为保护基金份额持有人的利益,基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金管理人经与本基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致,提议终止《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》,并召开基金份额持有人大会审议上述事项。根据管

理人 2020 年 6 月 10 日发布的《关于华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本次基金份额持有人大会于 2020 年 6 月 9 日表决通过了《关于终止华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本次基金份额持有人大会决议自该日起生效。根据决议生效公告，本基金最后运作日为 2020 年 6 月 16 日，自 2020 年 6 月 17 日进入清算期。

§4 财务报告

4.1 资产负债表

会计主体：华安沪深 300 指数分级证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 16 日

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2020年6月16日
资 产：	
银行存款	11,717,331.68
结算备付金	58,579.11
存出保证金	69,443.21
交易性金融资产	132,047.64
应收利息	7,113.40
资产总计	11,984,515.04
负债和所有者权益	最后运作日 2020年6月16日
负 债：	
应付证券清算款	3,177.19
应付赎回款	1,115,506.22
其他负债	29,841.71
负债合计	1,148,525.12
所有者权益：	
实收基金	6,406,238.24
未分配利润	4,429,751.68
所有者权益合计	10,835,989.92
负债和所有者权益总计	11,984,515.04

注 1：本清算报表按照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》约定的资产估值和会计核算方法及中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作以清算基础编制。于基金最后运作日，所有资产以可收回的金额与原账面价值孰低计量，负债以预计需要清偿的金额计量。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

注 2：报告截止日 2020 年 6 月 16 日(基金最后运作日)，华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金份额总额 7,671,614.39 份，其中华安沪深 300 指数分级证券投资基金之基础份额 5,288,190.39 份，基金份额净值 1.4125 元；华安沪深 300 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额 1,191,712.00 份，基金份额参考净值 1.0230 元；华安沪深 300 指数分级证券投资基金之积极收益类份额 1,191,712.00 份，基金份额参考净值 1.8020 元。

注 3：本财务报告已经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师单峰、楼茜蓉签字出具了普华永道中天特审字(2020)第 2701 号标准无保留意见的审计报告。

§5 清算情况

自 2020 年 6 月 17 日至 2020 年 6 月 22 日止清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

5.1 资产处置情况

5.1.1 本基金最后运作日结算备付金 58,579.11 元，存出保证金为人民币 69,443.21 元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳和上海分公司的最低备付金和结算保证金。该款项由基金管理人华安基金管理有限公司先行垫付，垫款人民币 210,000.00 元已于 2020 年 6 月 17 日划入托管户，垫付资金孳生的利息归华安基金管理有限公司所有。上述垫款将于中国证券登记结算有限责任公司深圳和上海分公司调整结算保证金和最低备付金后退还华安基金管理有限公

司。

5.1.2 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 132,047.64 元，为处于锁定期股票，该资产将于股票恢复流通并变现后划入托管户，向基金份额持有人进行分配。

5.1.3 本基金最后运作日应收利息为人民币 7,113.40 元，其中应收银行存款利息人民币 6,531.14 元，应收备付金利息 36.82 元，应收保证金利息 265.00 元，应收申购款利息 280.44 元，该款项将于对应的结息日划入托管账户。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付证券清算款为人民币 3,177.19 元，已于 2020 年 6 月 17 日支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付赎回款 1,115,506.22 元，已分别于 2020 年 6 月 17 日、2020 年 6 月 18 日支付。

5.2.3 本基金最后运作日其他负债为人民币 29,841.71 元，其中 27,540.24 元为预提年度财务报表审计费，该款项将于本基金年度财务报表审计报告出具后支付，2,301.47 元为应付赎回费，已分别于 2020 年 6 月 17 日、2020 年 6 月 18 日支付。

5.3 清算期间的清算损益情况

项目	自2020年6月17日至2020年6月22日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入（注1）	1,315.43
2、赎回费收入	356.40
清算收入小计	1,671.83
二、清算费用	-
三、清算净收益	1,671.83

注 1：利息收入系计提的自 2020 年 6 月 17 日至 2020 年 6 月 22 日止清算期间的银行存款利息、最低备付金利息和结算保证金利息。该款项将于对应的结息日划入托管账户。

5.4 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2020年6月16日基金净资产	10,835,989.92
加：清算期间净收益	1,671.83
减：基金净赎回转出金额（于2020年6月17日确认的投资者赎回申请）	396,557.47
二、2020年6月22日基金净资产	10,441,104.28

根据本基金的基金合同及《关于华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》的约定，基金财产清算分配将按华安沪深 300 份额、华安沪深 300A 份额、华安沪深 300B 份额各自的基金份额净值分别计算华安沪深 300 份额、华安沪深 300A 份额与华安沪深 300B 份额三类份额各自的应计分配比例，在此基础上，在华安沪深 300 份额、华安沪深 300A 份额与华安沪深 300B 份额各自类别内按其基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。华安沪深 300A 份额的约定收益在运作终止日后不再计提。故清算期间华安沪深 300A 份额不再计提约定收益。

鉴于清算期间的不确定、清算期间可能不时发生相关费用以及上述流通受限股票等因素，华安沪深 300A 份额可能存在本金损失的风险。鉴于流通受限股票解禁时间具有一定的不确定性，且锁定期内价格波动亦存在不确定性，故投资者存在无法及时获得清算款，或获得的清算款远低于终止运作日份额（参考）净值的风险。

5.5 基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、基金合同等规定及时进行分析。

§6 备查文件目录

6.1 备查文件目录

- 1、华安沪深 300 指数分级证券投资基金清算财务报表及审计报告
- 2、关于《华安沪深 300 指数分级证券投资基金清算报告》的法律意见

6.2 存放地点

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

6.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站、中国证监会基金电子披露网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安沪深 300 指数分级证券投资基金
基金财产清算小组

二〇二〇年六月二十二日（清算报告出具日）