

## 附件四：《关于华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）终止基金合同并终止上市有关事项的议案》的说明

华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“华安量化多因子混合（LOF）”或“本基金”）由华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）转型而来，并经中国证监会 2018 年 6 月 25 日证监许可【2018】1030 号文准予注册，基金托管人为中国银行股份有限公司。《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。根据市场环境变化，为更好地保护基金份额持有人的利益，基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，经与基金托管人协商一致，提议终止《基金合同》并终止上市，具体方案如下：

### 一、方案要点

#### 1、基金份额持有人大会决议生效并公告前的基金运作

在通过《关于华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）终止基金合同并终止上市有关事项的议案》的基金份额持有人大会决议生效并公告前，本基金仍按照《基金合同》约定的运作方式进行运作。

基金管理人可按照法律法规及深圳证券交易所的规定、《基金合同》的约定暂停接受投资人的申购、赎回、转托管、定期定额投资等业务申请，具体详见基金管理人届时发布的相关公告。

#### 2、基金财产清算

（1）通过《关于华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）终止基金合同并终止上市有关事项的议案》的基金份额持有人大会决议自本次基金份额持有人大会表决通过之日起生效。基金管理人将自决议生效之日起依照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在规定媒介上公告。

（2）基金份额持有人大会决议生效公告的下一工作日起，本基金即进入清算程序，基金管理人不再接受基金份额持有人提出的申购、赎回、转托管、定期

定额投资等业务申请。本基金进入清算程序后，停止收取基金管理费、基金托管费。

(3) 自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立基金财产清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

(4) 基金财产清算程序：

- 1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- 2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- 3) 对基金财产进行估值和变现；
- 4) 制作清算报告；
- 5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- 6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- 7) 对基金剩余财产进行分配。

(5) 清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金剩余财产中支付。考虑到本基金清算的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金的清算费用将由基金管理人承担。

(6) 基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

3、基金财产清算报告经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。

4、授权基金管理人向深圳证券交易所申请华安量化多因子混合型证券投资

基金（LOF）终止上市等事宜。

基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人在本次基金份额持有人大会决议生效后，按照深圳证券交易所的业务规则申请办理华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）终止上市等业务。

#### 5、本基金份额持有人大会决议生效后的相关安排

在本基金份额持有人大会决议生效并公告后，基金份额持有人同意豁免《华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）基金合同》中约定的投资组合比例限制等条款。基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人据此落实相关事项，并授权基金管理人可根据实际情况做相应调整。

## 二、终止《基金合同》有关事项的可行性

### 1、法律可行性

根据《基金法》及《基金合同》规定，终止基金合同需召开基金份额持有人大会进行表决。

本次基金份额持有人大会决议属于特别决议，经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 2/3 以上（含 2/3）通过方可做出。

因此，终止《基金合同》有关事项不存在法律方面的障碍。

### 2、技术可行性

为了保障华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的顺利召开，基金管理人成立了工作小组，筹备、执行基金份额持有人大会相关事宜。基金管理人与基金托管人、律师事务所、公证机关、投资者进行了充分沟通，保证基金份额持有人大会可以顺利召开。

基金份额持有人大会决议生效公告的下一工作日起，本基金即进入清算程序。本基金将根据《基金合同》中有关基金财产清算的规定，成立基金财产清算小组。基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

本基金的基金管理人、基金托管人已就财产清算的有关事项进行了充分沟通

和细致准备，技术可行。基金财产清算报告经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。

因此，终止《基金合同》不存在运营技术层面的障碍。

### **三、终止《基金合同》有关事项的主要风险及预备措施**

#### **1、议案被基金份额持有人大会否决的风险及预备措施**

本次《基金合同》终止并终止上市的主要风险是议案被基金份额持有人大会否决的风险。

在提议终止《基金合同》并确定具体方案之前，基金管理人已同基金份额持有人进行了沟通，认真听取了基金份额持有人意见，拟定议案综合考虑了基金份额持有人的要求。议案公告后，基金管理人还将再次征询基金份额持有人意见。如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，对基金合同终止及终止上市方案进行适当的修订，并重新公告。基金管理人可在必要情况下，预留出足够的时间，以做二次召开或推迟基金份额持有人大会的召开的充分准备。

如果本次议案未获得基金份额持有人大会批准，基金管理人计划在规定时间内，按照有关规定重新向基金份额持有人大会提交议案。

#### **2、流动性风险及预备措施**

在本基金关于以通讯方式召开基金份额持有人大会的事项公告后，部分基金份额持有人可能选择赎回其持有的基金份额。

在通过《关于华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）终止基金合同并终止上市有关事项的议案》的基金份额持有人大会决议生效并公告前，本基金仍按照《基金合同》约定的运作方式进行运作。在本基金进入清算程序前，持有人申请赎回其持有的基金份额仍需按照《基金合同》约定的方式进行。同时，基金管理人也会提前做好流动性安排，对资产进行变现以应对可能的赎回。

### **四、停复牌及申购、赎回业务安排**

本基金管理人将于 2022 年 7 月 27 日披露以通讯方式召开本基金基金份额持有人大会的公告，因此，本基金将于 2022 年 7 月 27 日上午开市至 10:30 停牌。

本基金将于基金份额持有人大会计票日当日（即 2022 年 8 月 29 日）开市起停牌。如本次基金份额持有人大会表决通过了本次议案，则本基金将不再复牌，并按规定办理本基金终止上市的相关事宜；如议案未获通过，本基金复牌安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

自进入清算程序起本基金不再接受基金份额持有人提出的申购、赎回、转托管、定期定额投资等业务申请。

敬请投资者注意上述事项并做好流动性安排。

## 五、其他

投资者可以登陆华安基金管理有限公司网站（[www.huaan.com.cn](http://www.huaan.com.cn)）或拨打华安基金管理有限公司客户服务热线 40088-50099、021-38969999 咨询相关情况。

特此公告。