华安基金管理有限公司关于以通讯方式召开华安深证300指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的公告

一、召开会议基本情况

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《华安深证300指数证券投资基金（LOF）基金合同》的有关规定，华安深证300指数证券投资基金（LOF）（以下简称“华安深证300LOF”或“本基金”）的基金管理人华安基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）经与基金托管人中国银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议《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》。会议的具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式。

2、会议投票表决起止时间：自2018年12月11日起，至2019年1月7日17:00止（以本基金管理人收到表决票时间为准）。

3、会议通讯表决票的寄达地点：

收件人：华安基金管理有限公司华安深证300LOF基金份额持有人大会投票处

地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期31.32层

邮政编码：200120

联系人：谈娓

联系电话：021-38969931

二、会议审议事项

本次持有人大会拟审议的事项为《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》（简称“《议案》”，详见附件一）。

上述议案的内容说明详见《（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）的说明》（详见附件四）。

三、基金份额持有人的权益登记日

本次大会的权益登记日为2018年12月10日，即2018年12月10日下午交易时间结束后，在本基金登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会。

四、表决票的填写和递交方式

1、本次会议表决票详见附件二、基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印附件二或登录本基金管理人网站（www.huaan.com.cn）下载并打印表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件复印件。

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章或相关的业务专用章（以下简称“公章”），并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本机构公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的有效身份证件复印件，该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件，以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件和证券账户卡复印件和取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件。

（3）个人投资者委托他人投票的，应自代理人在表决票上签字或盖章，并提供个人投资者身份证件复印件，以及填妥的授权委托书原件（详见附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）、以及填妥的授权委托书原件。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）、以及填妥的授权委托书原件。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

（5）以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书，以基金管理人的认可为准。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票邮寄或递交的表决票邮寄的相关文件自2018年12月11日起，至2019年1月7日17:00以前（以基金管理人收到表决票时间为准）通过专人送交或邮寄的方式送达至本基金管理人的办公地址，并请在信封表面注明：“华安深证300LOF基金份额持有人大会表决专用”。

本基金管理人的办公地址及联系办法如下：

收件人：华安基金管理有限公司华安深证300LOF基金份额持有人大会投票处

地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期 31.32层

邮政编码：200120

联系人：谈娓

联系电话：021-38969931

4.投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话40088-50099（免长途话费）咨询。

五、计票

1.本次通讯会议的计票方式为：由本基金管理人授权的两名监票人在本基金托管人（中国银行股份有限公司）授权代表的监督下在所通知的表决截止日期第二个工作日进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

2.本基金基金份额持有人的表决权

本基金基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

3.表决票效力的认定如下：

（1）表决票填写完整清晰，所提供文件符合本会议通知规定，且在截止时间之前送达指定联系地址的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（2）如表决票上的表决意见未选、多选、模糊不清或相互矛盾的，但其他各项符合会议通知规定的，视为弃权表决，计入有效表决票；并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（3）如表决票上签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达指定联系地址的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（4）基金份额持有人重复提交表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

1）送达时间不是同一天的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

2）送达时间为同一天的，视为在同一表决票上做出了不同表决意见，计入弃权表决票；

3）送达时间按如下原则确定：专人送达的以实际递交时间为准，邮寄的以基金管理人收到的时间为准。

六、决议生效条件

1、本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上（含50%）；

2、本次议案须经参加会议的基金份额持有人所持表决权的50%以上通过方为有效；

3、本次基金份额持有人大会决议通过的事项，本基金管理人自通过之日起五日内报中国证监会备案，基金份额持有人大会决议的事项自持有人大会决议通过之日起生效。

七、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《基金法》及《华安深证300指数证券投资基金（LOF）基金合同》的规定，本次持有人大会需要本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上（含50%）方可举行。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能够成功召开，本基金管理人可在规定时间内就同一议案重新召集基金份额持有人大会，重新召开基金份额持有人大会时，除非授权文件另有载明，本次基金份额持有人大会授权期间基金份额持有人作出的各类授权依然有效，但如果授权方式发生变化或者基金份额持有人重新作出授权，则以最新方式或最新授权为准，详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知。

八、本次大会相关机构

1、召集人（基金管理人）：华安基金管理有限公司

2、基金托管人：中国银行股份有限公司

3、公证机关：上海市东方公证处

联系人：傅匀

联系方式：021-62154848

4、律师事务所：上海市通力律师事务所

九、重要提示

1、请基金份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。

2、上述基金份额持有人大会有关公告可通过本基金管理人网站（www.huaan.com.cn）查阅，投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话40088-50099（免长途话费）咨询。

3、本基金的首次停牌时间为《华安基金管理有限公司关于以通讯方式召开华安深证300指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的公告》刊登日当天（2018年11月26日）开市起至当日10:30止，10:30后恢复交易。本基金第二次停牌的时间为基金份额持有人大会计票之日（2019年1月9日）开市起至基金份额持有人大会决议生效公告日10:30止。敬请基金份额持有人关注本基金停牌期间的流动性风险。

4.本公告的有关内容由华安基金管理有限公司负责解释。

附件一：《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》

附件二：《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票》

附件三：《授权委托书》

附件四：《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》的说明

华安基金管理有限公司

2018年11月26日

附件一：《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》

华安深证300指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人：

根据市场环境变化，为更好地满足投资者需求，保护基金份额持有人的利益，根据《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《华安深证300指数证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“《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银行股份有限公司协商一致，提议对华安深证300指数证券投资基金（LOF）进行转型，基金名称变更为“华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）”，基金类别变更为“混合型证券投资基金”，并修改投资目的、投资范围、投资策略、投资比例限制、业绩比较基准、风险收益特征、费率水平、收益分配原则、信息方法等相关事项，具体说明可参见附件四《（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）的说明》。

本议案如获得基金份额持有人大会审议通过，基金管理人将根据基金份额持有人大会决议对《基金合同》进行修改。本基金的招募说明书及托管协议也将进行必要的修改或补充。

以上议案，请予审议。

华安基金管理有限公司

2018年11月26日

附件二：《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票》

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票

基金份额持有人姓名或名称：			
证件号码（身份证件号/营业执照号）：			
证券账户卡号/开放式基金账户号：			
审议事项	同意	反对	弃权
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			
基金份额持有人（委托人）代理人签名或盖章 年 月 日			

说明：

1、请以打“√”方式在审议事项栏目下相应表决意见。持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见，表决意见代表基金份额持有人所填基金/证券账户号的全部基金份额（以权益登记日所登记的基金份额为准）的表决意见。

2、表决意见未选、多选、模糊不清或相互矛盾的（且其他各项符合会议通知规定）的表决票均视为投票人放弃表决权利，其所持全部基金份额的表决结果均计为“弃权”。签字/盖章部分不完整、不清晰的，视为无效表决。

（本表决票可剪报、复印或登录基金管理人网站（www.huaan.com.cn）下载并打印，在填写完整并签字盖章后均为有效。）

附件三：《授权委托书》

兹授权先生/女士或机构代表本人（或本机构）参加投票截止日为2019年1月7日的以通讯方式召开的华安深证300指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）基金份额持有人大会，并代为全权行使对所有议案的表决权。

上述授权有效期自签署日起至审议上述事项的基金份额持有人大会决议结束之日止。若本基金重新召开审议相同议案的持有人大会的，本授权继续有效。

委托人（签字/盖章）：

委托人身份证件号或营业执照号：

委托人证券账户卡号/开放式基金账户号：

代理人（签字/盖章）：

代理人身份证件号或营业执照号：

委托日期：年月日

授权委托书填写注意事项：

1、授权委托书可剪报、复印或按以上格式自制，在填写完整并签字盖章后均为有效；

2、委托人为机构的应当于名称后加盖公章，个人则为本人签字；

3、以上授权是持有人就其持有的本基金全部份额（含截至权益登记日的未付累计收益）向代理人所做授权；

4、如本次持有人大会权益登记日，投资者未持有本基金的基金份额，则其授权无效。

附件四：《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》的说明

华安深证300指数证券投资基金（LOF）于2011年9月2日成立，基金托管人为中国银行股份有限公司。根据市场环境变化，为更好地满足投资者需求，保护基金份额持有人的利益，基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《华安深证300指数证券投资基金（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，决定以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《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》。本次华安深证300指数证券投资基金（LOF）变更事宜属于实质性调整，经基金管理人向中国证监会申请，已经中国证监会核予安更注册。

本次华安深证300指数证券投资基金（LOF）变更方案需经参加会议的基金份额持有人所持表决权的50%以上（含50%）通过，因此变更方案存在无法获得相关基金份额持有人大会表决通过的可能。参加基金份额持有人大会表决的基金份额持有人为权益登记日登记在册的华安深证300指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人，本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额须占权益登记日基金总份额的50%以上（含50%）。

基金份额持有人大会表决通过的事项须报中国证监会备案，且自本次基金份额持有人大会表决通过之日起生效。法律法规另有规定的，从其规定。中国证监会对本次华安深证300指数证券投资基金（LOF）变更方案所作的任何决定或意见，均不表明其对本次修改方案或本基金的投资价值、市场前景或投资者的收益做出实质性判断或保证。

具体方案如下：

一、方案要点

（一）更名

基金名称由“华安深证300指数证券投资基金（LOF）”更名为“华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）”。

（二）变更后基金的基本情况

1、基金的名称：华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）。

2、基金的类别：混合型证券投资基金。

3、基金的运作方式：上市契约型开放式。

4、基金的投资目标：通过量化选股模型精选具备投资价值的个股，追求资产的长期增值，在严格控制组合风险同时，力争获得稳定的超越业绩比较基准的投资收益。

5、上市交易地点：深圳证券交易所。

6、基金存续期限：不定期。

（三）变更后基金的投资目标、投资范围、投资策略和投资限制等投资相关

1、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。

2、投资范围

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

本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。

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

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

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

3.投资策略

本基金采用多因子量化模型投资策略，综合技术、财务、流动性等多方面指标，精选股票进行投资，优化调整投资组合，力争实现高于业绩比较基准的投资收益和基金资产的长期增值。

（1）资产配置策略

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

（2）股票投资策略

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

本基金运用的量化投资模型主要包括：

i.多因子alpha模型——股票超额回报预测

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

ii.风险估测模型——有效控制风险预算

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

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

（3）债券投资策略

1）资产配置策略

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

2）利率类品种投资策略

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

3）信用债投资策略

本基金将在深入的宏观研究基础上，综合分析各类信用债发行主体所处行业环境、发行人所处的市场地位、财务状况、管理水平等因素后，结合具体发行契约，对债券进行信用评级。在此基础上，建立信用类债券池，积极投资信用利差具有相对投资机会的个券进行投资。

4）可转债投资策略

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

（4）股指期货投资策略

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

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

（5）权证投资策略

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

（6）资产支持证券的投资策略

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

7）参与融资业务的投资策略

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

4.投资组合限制

（1）本基金股票投资占基金资产的比例不低于60%；

（2）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；

（3）基金参与股指期货交易，应当遵守下列要求：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%；本基金持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

（4）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的10%；

（5）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；

（6）基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）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%；

（7）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

（8）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；

（9）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；

（10）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；

（11）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

（12）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

（13）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计计划规模的10%；

（14）本基金应投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

（15）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

（16）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不展期；

（17）基金参与融资交易的，应当遵守下列要求：每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；

（18）基金总资产不得超过基金净资产的140%；

（19）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%；

因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。

（20）本基金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的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

（21）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第（2）、（14）、（19）、（20）项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准，但须提前公告。

5.业绩比较基准

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

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

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

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

（2）在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。

（3）对在交易所市场上市交易的可转换债券，按照每日收盘价作为估值全价。

（4）对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券，估值日不存在活跃市场时采用估值技术确定其公允价值进行估值。如成本能够近似体现其公允价值，基金管理人应持续评估上述做法的适当性，并作情况发生改变时做出适当调整。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

（2）首次公开发行未上市的股票、债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

（3）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，按成本应对市场报价进行调整，确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则采用估值技术确定公允价值。

（4）流通受限的股票，包括非公开发行股票、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（不包括停牌、新发行未上市、同购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期限对应的价格进行估值。对银行间市场上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

4、存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

5、投资证券衍生品的估值方法

（1）从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

（2）首次发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

（3）因持有股票而享有的配股权，以及停止交易但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行估值。

（4）本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

6、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

7、本基金可以采用第三方估值机构按照上述公允价值确定原则提供的估值价格数据。

8、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

9、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

当发生大额申购或赎回时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金份额净值的公布、公证机关、投资者进行了充分沟通，保证持有人大会可以顺利召开。

为了保障华安深证300指数证券投资基金（LOF）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，保证持有人大会可以顺利召开。

本基金的基金管理人、基金托管人已就本次转型方案进行了充分沟通和细致准备，技术可行。

因此，转型方案不存在运营技术层面的障碍。

四、转型方案的主要风险及预备措施

本次基金转型的主要风险是议案被持有人大会否决的风险。

在设计转型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，基金管理人将根据持有人意见，对转型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。

如果随征转型方案未获得持有人大会批准，基金管理人计划在规定时间内，按照有关规定重新向持有人大会提交转型并修改基金合同等相关事项的议案。

附件：《华安深证300指数证券投资基金（LOF）基金合同》（“《基金合同》”）与《华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）基金合同》（“《基金合同》（修订）”）修改前后对照表

《基金合同》（修订）章节	《基金合同》	《基金合同(修订)》
全文修改基金名称	华安深证300指数证券投资基金（LOF）	华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）
第一部分前言	（一）订立《华安深证300指数证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“本基金合同”）的目的、依据和原则 1、订立本基金合同的目的 订立本基金合同的目的是明确本基金合同当事人的权利义务，规范华安深证300指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）的运作，保护基金份额持有人的合法权益。 2、订立本基金合同的依据 订立本基金合同的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《中华人民共和国证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）和其他有关法律法规规定。 3、订立本基金合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护投资人合法权益。	一、订立本基金合同的目的、依据和原则 1、订立本基金合同的目的是保护投资人合法权益，明确基金合同当事人的权利义务，规范基金运作。 2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《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》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)和其他有关法律法规规定。 3、订立本基金合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护投资人合法权益。
（一）订立《华安深证300指数证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“本基金合同”）的目的、依据和原则 1、订立本基金合同的目的 订立本基金合同的目的是明确本基金合同当事人的权利义务，规范华安深证300指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）的运作，保护基金份额持有人的合法权益。 2、订立本基金合同的依据 订立本基金合同的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称《流动性风险管理规定》）和其他有关法律法规规定等有关规定。 3、订立本基金合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护投资人合法权益。	（一）订立《华安深证300指数证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“本基金合同”）的目的、依据和原则 1、订立本基金合同的目的是保护投资人合法权益，明确基金合同当事人的权利义务，规范基金运作。 2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《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》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)和其他有关法律法规规定等有关规定。 3、订立本基金合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护投资人合法权益。
（二）订立《华安深证300指数证券投资基金（LOF）基金合同》的基本原则 本基金合同中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义： 基金或本基金：指华安深证300指数证券投资基金（LOF）； 基金合同或本基金合同、本合同：指《华安深证300指数证券投资基金（LOF）基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充； 招募说明书：指《华安深证300指数证券投资基金（LOF）招募说明书》及其定期更新； 发售公告：指《华安深证300指数证券投资基金（LOF）基金份额发售公告》 托管协议：指《华安深证300指数证券投资基金（LOF）托管协议》及其任何有效修订和补充； 业务规则：华安基金管理有限公司、深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则； 中国证监会：指中国证券监督管理委员会； 中国银监会：指中国银行业监督管理委员会； 《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过的自2004年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及不时做出的修订； 《销售办法》：指2004年6月25日由中国证监会公布并于2004年7月1日起实施的《证券投资基金销售管理办法》及不时做出的修订； 《运作办法》：指2004年6月29日由中国证监会公布并于2004年7月1日起实施的《证券投资基金运作管理办法》及不时做出的修订； 《信息披露办法》：《流动性风险管理规定》：指中国证监会2004年6月9日颁布并于2004年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及不时作出的修订； 指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订 7元：指人民币元； 基金管理人：指华安基金管理有限公司； 基金托管人：指中国银行股份有限公司； 基金份额持有人：指根据基金合同及相关法律文件合法取得本基金基金份额的投资者； 注册登记业务：指本基金登记、存管、清算和