华安中证500行业中性低波动
交易型开放式指数证券投资基金
联接基金清算报告

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：2022年12月17日

§1 重要提示

华安中证 500 行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金(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[2018]第 947 号《关于准予华安中证 500 行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金注册的批复》注册，由华安基金管理有限公司向社会公开发行募集。《华安中证 500 行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于 2019 年 1 月 15 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 386,657,040.06 份基金份额。

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《华安中证 500 行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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《华安中证 500 行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》，并召开基金份额持有人大会审议上述事项。根据管理人 2022 年 12 月 2 日发布的《关于华安中证 500 行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金联接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 2022 年 12 月 1 日表决通过了《关于终止华安中证 500 行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金联接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 2022 年 12 月 2 日，自 2022 年 12 月 3 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 2022 年 12 月 3 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

基金简称	华安中证 500 低波 ETF 联接
基金主代码	006129
交易代码	006129
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 1 月 15 日
报告期末（2022 年 12 月 2 日）基金份额总额	10,256,743.26 份
投资目标	通过投资于目标 ETF，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	本基金为目标 ETF 的联接基金，目标 ETF 是采用完全复制法实现对标的指数紧密跟踪的全被动指数基金。 本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。正常情况下，本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	中证 500 行业中性低波动指数收益率×95%＋商业银行税后活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金属于目标 ETF 的联接基金，目标 ETF 为股票型指数基金，因此本基金的预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金

	主要投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所代表的市场组合的风险收益特征相似。	
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	
下属分级基金的基金简称	华安中证 500 低波 ETF 联接 A	华安中证 500 低波 ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	006129	006130
报告期末下属分级基金的份额总额	3,961,441.84 份	6,295,301.42 份

§3 基金运作情况概述

本基金经中国证券监督管理委员会证监许可[2018]第 947 号注册，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《华安中证 500 行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》负责公开募集，基金合同于 2019 年 1 月 15 日生效。基金合同生效日的基金总份额为 386,657,040.06 份基金份额。

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。

为适应市场环境变化，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《华安中证 500 行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》的有关规定，经与本基金托管人协商一致，提议终止《华安中证 500 行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》，并召开基金份额持有人大会审议上述事项。根据管理人 2022 年 12 月 2 日发布的《关于华安中证 500 行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金联接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 2022 年 12 月 1 日表决通过了《关于终止华安中证 500 行业中性低波动交易型开

放式指数证券投资基金联接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 2022 年 12 月 2 日，自 2022 年 12 月 3 日进入清算期。

§4 财务报告

4.1资产负债表

会计主体：华安中证 500 行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2022 年 12 月 2 日

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2022年12月2日
资 产：	
银行存款	763,596.73
结算备付金	13,619.03
存出保证金	954.13
应收清算款	12,696,596.10
资产总计	13,474,765.99
负债和所有者权益	**最后运作日 2022年12月2日**
负 债：	
应付赎回款	103,623.74
应付管理人报酬	19.60
应付托管费	3.92
应付销售服务费	180.35
应付税费	25,358.66
其他负债	55,234.30
负债合计	184,420.57
所有者权益：	
实收基金	10,256,743.26
未分配利润	3,033,602.16
所有者权益合计	13,290,345.42
负债和所有者权益总计	13,474,765.99

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》、《华安中证 500 行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基

金联接基金基金合同》约定的资产估值和会计核算方法及中国证监会、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。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：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，注册会计师魏佳亮、楼茜蓉签字出具了普华永道中天特审字(2022)第5769号标准无保留意见的审计报告。

§5 清算情况

自2022年12月3日至2022年12月9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为人民币13,619.03元、存出保证金为人民币954.13元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的结算保证金和最低备付金。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150,000.00元已于2022年12月5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。该垫付款项将于中国证券登记结算有限责任公司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 本基金最后运作日应收证券清算款人民币12,696,596.10元，已于2022年12月5日划入本基金托管账户。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付赎回款人民币103,623.74元，已于2022年12月5日及2022年12月6日分别支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币19.60元；应付托管费为人民币3.92元，应付销售服务费为人民币180.35元，应付税费为人民币25,358.66元，已于2022年12月6日支付。

5.2.3 本基金最后运作日其他负债为人民币 55,234.30 元，其中应付赎回费人民币 2.62 元，已于 2022 年 12 月 5 日及 2022 年 12 月 6 日分别支付；本基金在 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 2 日(基金最后运作日)期间预提审计费用 55,231.68 元，若因本基金终止运作未出具年度财务报表审计报告，冲回该项预提费用产生的收益将按基金份额持有人持有的基金份额比例分配给基金份额持有人。

5.3 清算期间的清算损益情况

项目	自2022年12月3日至2022年12月9日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入（注1）	528.31
2、其他收入（注2）	304,61
清算收入小计	832.92
二、清算费用	
其他费用小计（注3）	
三、清算净收益	832.92

注 1：利息收入系计提的自 2022 年 12 月 3 日至 2022 年 12 月 9 日止清算期间的银行存款利息和结算保证金利息。其中预提的银行存款利息、结算备付金利息和存出保证金利息由基金管理人华安基金管理有限公司以自有资金垫付，并已于 2022 年 12 月 5 日划入托管账户。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

注 2：其他收入系基金赎回费及转换费收入。

注 3：由于清算产生的审计费用 20,000.00 元，律师费 20,000.00 元及本次持有人大会的公证费用 10,000.00 元将由华安基金管理有限公司承担。

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2022年12月2日基金净资产	13,290,345.42
加：清算期间净收益	832.92
减：基金赎回款支付	924,520.50
二、2022年12月9日基金净资产	12,366,657.84

根据本基金的基金合同及《关于华安中证 500 行业中性低波动交易型开放式

指数证券投资基金联接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，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。

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配。

§6 备查文件目录

6.1 备查文件目录

1、华安中证 500 行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金清算财务报表及审计报告

2、关于《华安中证 500 行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金清算报告》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。

华安中证 500 行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金财产清算小组

二〇二二年十二月九日（清算报告出具日）