

国寿安保基金管理有限公司关于将国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金变更为国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金并修改基金合同部分条款的公告

国寿安保基金管理有限公司（以下简称“本公司”）旗下的国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金（以下简称“国寿安保沪深 300 指数基金”），于 2014 年 4 月 8 日经中国证监会证监许可[2014]376 号文准予注册募集，且《国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》（以下简称“原基金合同”）于 2014 年 6 月 5 日正式生效。原基金合同约定，“如今后本基金管理人募集并管理‘国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金’，基金管理人有权决定将本基金转换为该基金的联接基金。此项调整无需召开基金份额持有人大会，经基金管理人与基金托管人协商一致，在报中国证监会备案后及时公告”。

因国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金已于 2018 年 1 月 19 日成立，为了更好地满足投资者的投资需求，本公司经与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，决定于 2018 年 8 月 13 日起，将国寿安保沪深 300 指数基金变更为国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“国寿安保沪深 300ETF 联接”或“本基金”，基金代码：000613），并将根据法律法规及基金合同的有关规定，对原基金合同的部分章节进行必要的修订和补充。

现将对原基金合同的主要修订说明如下：

一、对原基金合同全文的修订

将“国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金”修订为“国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”，将“《国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》”修订为“《国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》”。

二、对原基金合同“前言”的修订

将本基金合同订立依据，修订为《公开募集证券投资基金运作管理办法》；并增加本基金由国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金转型而来的相关说明。

三、对原基金合同“释义”的修订

更新相关法规的修改及实施日期；删除基金份额发售公告、基金募集期等与认购相关的释义；修改基金合同生效日释义；增加目标 ETF、ETF 联接基金释义等。

四、对原基金合同“基金的基本情况”的修订

修订或新增基金名称、类别、基金投资目标、标的指数、本基金与目标 ETF 的联系与区别等内容。

五、对原基金合同“基金份额的发售”、第五部分“基金备案”的修订

删除原内容，新增“基金的历史沿革”和“基金的存续”两部分。

六、对原基金合同“基金份额的申购与赎回”的修订

在“申购和赎回的程序”部分，补充完善相关表述。在“申购和赎回的价格、费用及其用途”部分，补充赎回费的相关表述。在“拒绝或暂停申购的情形”、“暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”中增加目标 ETF 暂停估值、暂停申购或二级市场停牌等情形。

七、对原基金合同“基金合同当事人及权利义务”的修订

删除基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件时的义务。

八、对原基金合同“基金份额持有人大会”的修订

新增关于本基金所持目标 ETF 份额行使表决权或召集基金份额持有人大会的相关内容。修订需要召开持有人大会以及无需召开持有人大会的事由。删除表述“本基金转为‘国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金’并相应变更基金类别、修改投资目标、范围和策略的除外”的表述。

九、对原基金合同“基金的投资”的修订

修订或新增本基金的投资目标、投资范围、投资策略、投资限制、风险收益特征等相关内容；增加在目标 ETF 发生相关变更情形时的处理。

十、对原基金合同“基金资产的估值”的修订

按照最新的法规对估值方法进行了更新；新增关于目标 ETF 份额估值方法的相关内容。

十一、对原基金合同“基金的费用与税收”的修订

修订基金管理人的管理费和基金托管人的托管费相关计算公式；删除标的指数许可使用费的表述；删除费用调整的内容。

十二、对基金的收益与分配

修订调整基金收益分配原则的表述。

十三、对原基金合同“基金的信息披露”的修订

删除基金份额发售公告等信息披露规定；增加了需披露临时报告的情形。

十四、对原基金合同“基金合同的效力”的修订

修订关于本基金合同生效的表述。

上述修订自本基金的基金合同生效之日起生效。本公司根据修订的基金合同对本基金托管协议进行了相应修订，并将根据修订的基金合同对招募说明书等文件进行更新。本基金管理人将于公告当日将修改后的本基金的基金合同、托管协议登载于公司网站，并在下期更新的招募说明书中，对上述相关内容进行相应修改。本基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调整上述有关内容。

投资者欲了解基金信息，请仔细阅读本基金的基金合同、招募说明书及相关法律文件。投资者可登录本基金管理人网站(www.gsfunds.com.cn)或拨打本基金管理人的客户服务电话（4009-258-258）获取相关信息。特此公告。

国寿安保基金管理有限公司

2018年8月10日

附件

《国寿安保沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》修订对照表

章节 原文条款 修改后条款

全文 “国寿安保沪深300指数型证券投资基金” “国寿安保沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金”

“媒体” “媒介”

第一部分前言 《证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、

增加：本基金由国寿安保沪深300指数型证券投资基金转换而来。

第二章释义 7、基金份额发售公告：指《国寿安保沪深300指数型证券投资基金基金份额发售公告》 删除

8、《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，2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自2013年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订 8、《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，经2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自2013年6月1日起实施，并经2015年4月24日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

11、《运作办法》：指中国证监会2004年6月29日颁布、同年7月1日实施，并于2012年6月19日修订的《证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订 11、《运作办法》：指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

增加：21、目标ETF：指国寿安保基金管理有限公司管理的国寿安保沪深300交易型开放式指数证券投资基金（简称沪深300ETF）

22、ETF联接基金、联接基金：指将其绝大部分基金财产投资于沪深300ETF（目标ETF），紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金，即本基金

23、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

28、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

29、基金合同生效日：指《国寿安保沪深300

交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》的生效日

30、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月

38、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

删除

第三章基金的基本情况 二、基金的类别

股票型指数证券投资基金 二、基金的类别
联接基金
四、基金的投资目标
本基金采用被动式指数化投资策略，通过控制基金组合相对于标的指数的偏离度和跟踪误差，实现对标的指数的有效跟踪，以为投资者带来与指数收益相似的长期回报。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的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%。

四、基金的投资目标

通过主要投资于沪深300交易型开放式指数证券投资基金，紧密跟踪标的指数即沪深300指数的表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

五、投资理念

指数化投资可以以较低的成本获取良好的市场长期回报，投资于具有良好市场代表性、流动性与投资性的指数，可以分享经济快速增长过程中带来的投资机会。

删除

增加：五、本基金的目标ETF及标的指数
本基金的目标ETF为国寿安保沪深300交易型开放式指数证券投资基金，标的指数是沪深300指数。

六、基金的最低募集份额总额

本基金的最低募集份额总额为2亿份。

七、基金份额发售面值和认购费用

本基金基金份额发售面值为人民币1.00元。

本基金认购费率按招募说明书的规定执行。

删除

增加：七、本基金与目标ETF的联系与区别
本基金为目标ETF的联接基金，二者既有联系也有区别：

1、在基金的投资方法方面，目标ETF采取完全复制法，直接投资于标的指数的成份股；而本基金则采取间接方法，通过将绝大部分基金财产投资于目标ETF，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。

2、在交易方式方面，投资者既可以像股票一样在交易所市场买卖目标ETF，也可以通过发售代理机构申赎目标ETF；而本基金作为不上市交易，投资者可以通过基金管理人及其他销售机构申购和赎回本基金份额。

3、在申购赎回方式方面，目标ETF主要采用份额申购和份额赎回的方式，本基金采用金额申购、份额赎回的方式。

本基金与目标ETF业绩表现可能出现差异。可能引发差异的因素主要包括：

1、法律法规对投资比例的要求。目标ETF作为一种特殊的基金品种，可将全部或接近全部的基金资产，用于跟踪标的指数的表现；而本基金作为普通的开放式基金，仍需将不低于基金资产净值5%的资产投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券；

2、申购赎回的影响。目标ETF主要采取实物申赎的方式，申购赎回对基金净值影响较小；而本基金申赎采取现金方式，大额申赎可能会对基金净值产生一定冲击。

增加：第四部分基金的历史沿革 国寿安保沪深300指数型证券投资基金经中国证监会《关于准予国寿安

保沪深 300 指数型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2014】376 号）准予募集注册，基金管理人为国寿安保基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金自 2014 年 5 月 8 日至 2014 年 5 月 30 日进行公开募集，募集总额为 5,130,087,968.40 元，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》于 2014 年 6 月 5 日生效。

根据《国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》的约定，如今后本基金管理人募集并管理“国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金”，基金管理人有权决定将国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金转换为该基金的联接基金。此项调整无需召开基金份额持有人大会，经基金管理人与基金托管人协商一致，在报中国证监会备案后及时公告。

自 2018 年 8 月 13 日起，国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金转换为“国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”，《国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于同日生效。

第五部分基金的存续 一、基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币且基金认购人数不少于 200 人的条件下，基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息；
- 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。

法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。 一、基金的变更登记

《基金合同》生效后，基金管理人负责办理基金份额的变更登记。基金管理人根据生效日的基金份额持有人名册，进行基金份额更名以及必要的信息变更，并对投资者持有的基金份额予以确认或重新登记。

二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后，连续 20 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 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，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。

法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

第六部分基金份额的申购和赎回 四、申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购申请成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。四、申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请不成立。

2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成立。投资人全额交付申购款项，申购申请成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。

增加：基金管理人可在法律法规允许的范围内，依法对上述申购和赎回申请的确认时间进行调整，并必须在调整实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

增加：赎回费用应根据法律法规规定的比例归入基金财产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

七、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作。

……

6、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额数的比例达到或者超过基金份额总数的50%，或者有可能导致投资者变相规避前述50%比例要求的情形。

7、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。

8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第1、2、3、5、7、8项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

七、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作。

……

6、目标ETF暂停基金资产估值。

7、目标ETF暂停申购、暂停上市或二级市场交易停牌，基金管理人认为有必要暂停本基金申购的情形。

8、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。

9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第1、2、3、5、6、7、9项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

……

5、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允

价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。

6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

……

5、目标 ETF 暂停基金资产估值。

6、目标 ETF 暂停赎回、暂停上市或二级市场交易停牌，基金管理人认为有必要暂停本基金赎回的情形。

7、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。

8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

第七部分基金合同当事人及权利义务 一、基金管理人

(一) 基金管理人简况

……

注册资本：5.88 亿元

……

一、基金管理人

(一) 基金管理人简况

……

注册资本：12.88 亿元

……

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；删除

第八部分基金份额持有人大会 增加：鉴于本基金是目标 ETF 的联接基金，本基金的基金份额持有人可以凭所持有的本基金份额出席或者委派代表出席目标 ETF 的基金份额持有人大会并参与表决，其持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为：在目标 ETF 基金份额持有人大会的权益登记日，本基金持有目标 ETF 份额的总数乘以该基金份额持有人所持有的本基金份额占本基金总份额的比例。计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

本基金的基金管理人不应以本基金的名义代表本基金的全体基金份额持有人以目标 ETF 的基金份额持有人的身份行使目标 ETF 的基金份额持有人大会的表决权，但可接受本基金的特定基金份额持有人的委托以本基金的基金份额持有人代理人的身份出席目标 ETF 的基金份额持有人大会并参与表决。

本基金的基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 的基金份额持有人大会的，须先遵照本基金基金合同的约定召开本基金的基金份额持有人大会；本基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集目标 ETF 的基金份额持有人大会的，由本基金的基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 的基金份额持有人大会。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

(5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准（根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外）；

(5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准（根据法律法规的要求调整该等报酬标准的除外）；

(6) 变更基金类别（本基金转换为“国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”除外）

； (6) 变更基金类别

(8) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定或《基金合同》另有约定的除外）

，本基金转换为“国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”并相应修改投资目标、范围和策略的除外；

(8) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定或《基金合同》另有约定的除外）；

(1) 调低基金管理费、基金托管费； 删除

(4) 本基金转为“国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”并相应变更基金类别、修改投资目标、范围和策略； 删除

增加：(6) 由于目标 ETF 基金交易方式变更、终止上市或目标 ETF 基金合同终止而变更基金投资目标、范围或策略；

(7) 基金推出新业务或服务；

(8) 调整本基金份额类别的设置；

转换基金运作方式（除本基金合同另有约定外）、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

第十二部分 基金的投资 一、投资目标

本基金采用被动式指数化投资策略，通过控制基金组合相对于标的指数的偏离度和跟踪误差，实现对标的指数的有效跟踪，以为投资者带来与指数收益相似的长期回报。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的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%。一、投资目标通过主要投资于国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金，紧密跟踪标的指数即沪深 300 指数的表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

二、投资理念

指数化投资可以以较低的成本获取良好的市场长期回报，投资于具有良好市场代表性、流动性与投资性的指数，可以分享经济快速增长过程中带来的投资机会。

三、投资范围

本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、权证、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产，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。

如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：本基金持有的股票资产占基金资产的比例不低于 90%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%，本基金持有的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、应收申购款等。 二、投资范围

本基金以目标 ETF 基金份额、标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、国债、金融债券、次级债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证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）。

如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。

本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%；每个交易日日终，本基金应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规对上述投资比例要求有变更的，本基金将及时对其做出相应调整，并以调整变更后的投资比例为准。

三、投资策略

本基金采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构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（如市场流动性不足、成份股被限制投资等）导致基金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。

1、股票资产指数化投资策略

本基金股票资产投资原则上采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数。通常情况下，本基金根据标的指数成份股票在指数中的权重确定成份股票的买卖数量，并根据标的指数成份股及其权重变动对股票投资组合进行相应调整。在特殊情况下，本基金将选择其它股票或股票组合对标的指数中的股票加以替换，这些情况包括但不限于以下情形：

- （1）法律法规的限制；
- （2）标的指数成份股流动性严重不足；
- （3）本基金资产规模过大导致本基金持有该股票比例过高；
- （4）成份股上市公司存在重大虚假陈述等违规行为、或者面临重大的不利行政处罚或司法诉讼；
- （5）有充分而合理的理由认为其市场价格被操纵等。

进行此等替换遵循的原则如下：

- （1）优先考虑用以替换的股票与被替换的股票属于同一行业；
- （2）替换后，该成份股票所在行业在基金股票资产组合中的权重与标的指数中该行业权重相一致；
- （3）用以替换的股票或股票组合与被替换的股票在考查期内日收益率序列风险收益特征高度相关，能较好地代表被替代股票的收益率波动情况。

2、股票指数化投资日常投资组合管理

（1）组合调整原则

本基金为指数型基金，基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发因素等变化，对基金投资组合进行适时调整，以保证基金净值增长率与标的指数间的跟踪误差最小化。

（2）投资组合调整方法

本基金将对标的指数进行定期与不定期的跟踪调整，同时也会结合限制性调整措施对基金资产进行适当调整。

（3）跟踪偏离度的监控与管理

每日跟踪基金组合与标的指数表现的偏离度，定期分析基金的实际组合与标的指数表现的累计偏离度、跟踪误差变化情况及其原因，并优化跟踪偏离度管理方案。

3、债券投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于国债、金融债等期限在一年期以下的债券，保证基金资产流动性，提高基金资产的投资收益。

4、其他金融工具投资策略

在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则运用权证等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以提高投资效率，控制基金投资组合风险水平，更好地实现本基金的投资目标。本基金管理人运用上述金融衍生工具必须是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的，不得应用于投机交易目的，或用作杠杆工具放大基金的投资。

三、投资策略

本基金主要投资于目标 ETF，方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金不参与目标 ETF 的投资管理。

1、资产配置策略

为实现投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90% 的资产投资于目标 ETF。其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、国内依法发行上市的非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的公司股票）、衍生工具（权证等）、债券资产、资产支持证券、债券回购、银行存款、现金资产、货币市场工具以及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的相关规定），其目的是为了

使本基金在保障日常申购赎回的前提下，更好地跟踪标的指数。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日均跟踪偏离度不超过 0.3%，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，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

2、基金投资策略

（1）投资组合的构建

基金合同生效后，本基金将主要按照标的指数成份股的基准权重构建股票组合，并在建仓期内将股票组合换购成目标 ETF，使本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。

（2）投资组合的投资方式

本基金投资目标 ETF 的三种方式如下：

1) 特殊申购：目标 ETF 成立后，以现金或股票组合方式进行申购；

2) 申购和赎回：目标 ETF 开放申购赎回后，以股票组合进行申购赎回；

3) 二级市场方式：目标 ETF 上市交易后，在二级市场进行目标 ETF 份额的交易。本基金投资于目标 ETF 的方式以申购和赎回为主，但在目标 ETF 二级市场流动性较好的情况下，为了更好地实现本基金的投资目标，减小与标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差，也可以通过二级市场交易买卖目标 ETF。

当目标 ETF 申购、赎回或交易模式进行了变更或调整，本基金也将作相应的变更或调整，无须召开基金份额持有人大会。

3、股票投资策略

本基金的股票投资以标的指数成份股和备选成份股的投资为主，采用被动式指数化投资方法进行日常管理，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

4、债券投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于国债、金融债等期限在一年期以下的债券，保证基金资产流动性，提高基金资产的投资收益。

5、其他金融工具投资策略

在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则运用权证等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以提高投资效率，控制基金投资组合风险水平，更好地实现本基金的投资目标。本基金管理人运用上述金融衍生工具必须是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的，不得应用于投机交易目的，或用作杠杆工具放大基金的投资。

四、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金持有的股票资产占基金资产的比例不低于 90%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%（已申购但尚未确认的目标 ETF 份额

可计入在内)；

增加：(15) 基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

(1) 承销证券；

.....

(4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

2、禁止行为
为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

(1) 承销证券；

.....

(4) 买卖除目标 ETF 外的其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

七、风险收益特征

本基金为股票型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，采用完全复制策略，跟踪标的指数市场表现，是股票型基金中处于中等风险水平的基金产品。

六、风险收益特征
本基金为被动式投资的交易型开放式指数基金联接基金，跟踪沪深 300 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

本基金属于被动式投资的股票指数基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于高预期风险、高预期收益的开放式基金。

增加：七、目标 ETF 的变更

目标 ETF 出现下述情形之一的，本基金将由投资于目标 ETF 的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金；若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金，则本基金将本着维护投资者合法权益的原则，履行适当的程序后选取其他合适的指数作为标的指数。相应地，本基金基金合同中将去掉关于目标 ETF 的表述部分，或将变更标的指数，届时将由基金管理人另行公告。

1、目标 ETF 交易方式变更；

2、目标 ETF 终止上市；

3、目标 ETF 基金合同终止。

若目标 ETF 变更标的指数，按照监管部门要求，本基金将在履行适当程序后相应变更标的指数且继续投资于该目标 ETF。

八、基金管理人代表基金行使股东权利和债权人权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利和债权人权利，保护基金份额持有人的利益；

2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

3、有利于基金财产的安全与增值；

4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

九、基金的融资融券

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资、融券。

十、基金转换为“国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金”联接基金

如今后本基金管理人募集并管理“国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金”，基金管理人有权决定将本基金转换为该基金的联接基金。ETF 联接基金是指将其绝大部分基金财产投资于跟踪同一标的指数的 ETF，紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作的基金。

第十四部分基金资产估值 二、估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

二、估值对象
基金所拥有的目标 ETF 基金份额、股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

三、估值方法 三、估值方法

增加：本基金持有的目标 ETF 份额以其当日份额净值估值，当日无份额净值的，以最近工作日的份额净值估值，

1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考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，确定公允价格；

(2) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，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，可参考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，确定公允价格；

(3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；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，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考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，确定公允价格；

1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 除本第三条另有规定的有价证券外，交易所上市的其他有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考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，确定公允价格；

(2) 交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（本基金合同另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值，具体估值机构由基金管理人与基金托管人另行协商约定；

(3) 交易所上市交易的可转换债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；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，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考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，确定公允价格；交易所上市未实行净价交易的债券（可转换债券除外），选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。(3) 流通受限股票，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，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

5、本基金转为 ETF 联接基金后，本基金投资的目标 ETF 份额以目标 ETF 估值日的净值估值。

删除

增加：5、因持有股票而享有的配股权，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。

第十五部分基金费用与税收 一、基金费用的种类

3、标的指数使用许可费； 删除

8、证券账户开户费用和银行账户维护费； 8、账户开户费用和银行账户维护费；

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除本基金投资于目标 ETF 部分基金资产净值后的净额（金额为负时以零计）的 0.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值扣除本基金投资于目标 ETF 部分基金资产净值后的净额（金额为负时以零计）

基金管理人对本基金投资组合中投资于目标 ETF 部分的基金资产净值不计提基金管理费。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除本基金投资于目标 ETF 部分基金资产净值后的净额（金额为负时以零计）的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值扣除本基金投资于目标 ETF 部分基金资产净值后的净额（金额为负时以零计）

基金托管人对本基金投资组合中投资于目标 ETF 部分的基金资产净值不计提基金托管费。

3、标的指数许可使用基点费

本基金的指数许可使用费分为许可使用固定费和许可使用基点费，其中许可使用基点费由基金财产承担。

……… 删除

四、费用调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。调低基金管理费率、基金托管费率等，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须依照《信息披露办法》的有关规定于新的费率实施前在指定媒体上刊登公告。 删除

第十六部分基金的收益与分配 在不影响基金份额持有人利益的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒体公告。 在不影响基金份额持有人利益的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下经与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

第十七部分基金的会计与审计 基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度披露； 删除

第十八部分基金的信息披露 基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒体上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。 本基金由国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金变更而来，经中国证监会注册后，基金管理人按照相关规定将基金招募说明书、《基金合同》摘要、《基金合同》、基金托管协议登载在指定媒介上。

（二）基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定媒体上。

(三) 《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒体上登载《基金合同》生效公告。 删除

7、基金募集期延长； 删除

增加：24、发生涉及本基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

28、目标 ETF 或标的指数变更；

第二十部分违约责任 但是如发生下列情况，当事人可以免责：

1、不可抗力； 但是如发生下列情况，当事人免责：

1、不可抗力；

第二十二部分基金合同的效力 1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续，并经中国证监会书面确认后生效。 1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字，经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续。