

国寿安保基金管理有限公司关于国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告

根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》及《国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的约定，经与国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”；基金代码：517300；场内简称：沪港深 300；扩位证券简称：沪港深 300ETF）基金托管人招商银行股份有限公司协商一致，并报中国证券监督管理委员会备案，国寿安保基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）决定对本基金的基金合同、招募说明书等法律文件进行修改。本次修改将自 2021 年 4 月 2 日起正式生效。现将主要修订内容公告如下：

一、基金合同修改的内容

（一）在基金合同“第一部分 前言”中增加订立基金合同的依据：

“……《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》（以下简称“《指数基金指引》”）”

在基金合同“第一部分 前言”中增加有关风险提示内容如下：

“本基金为指数基金，投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份券停牌等潜在风险，详见本基金招募说明书。”

（二）在基金合同“第二部分 释义”中增加：

“16、《指数基金指引》：指中国证监会 2021 年 1 月 22 日颁布、同年 2 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》及颁布机关对其不时做出的修订”。

（三）将基金合同“第三部分 基金的基本情况”中“八、标的指数”内容修订为：

“本基金的标的指数为中证沪港深 300 指数。

中证沪港深 300 指数由中证指数有限公司编制并发布，反映沪港深三地上市公司股票的整体表现。

未来若出现标的指数不符合法律法规及监管的要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机

构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决。

在指数停止编制发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照最近一个交易日的指数信息维持基金投资运作。

法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。”

（四）将基金合同“第十四部分 基金的投资”中“六、业绩比较基准”内容修订为：

“本基金的业绩比较基准为中证沪港深 300 指数。

未来若出现标的指数不符合法律法规及监管的要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决。

在指数停止编制发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照最近一个交易日的指数信息维持基金投资运作。

法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。”

二、招募说明书修改的内容

（一）在本基金招募说明书“重要提示”中增加有关指数的编制方法以及可供投资者免费查询指数信息的途径内容如下：

“本基金的标的指数为中证沪港深 300 指数。

1、样本空间

沪深市场：同中证全指指数的样本空间

香港市场：同中证港股通综合指数的样本空间

2、选样方法

（1）对样本空间内的沪深市场证券，按照过去一年日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 20%的证券；对样本空间内的香港市场证券，剔除过去一年日均成交金额不足 3000 万港币的证券；（2）对样本空间内剩余证券，按照过去一年日均总市值由高到低排名，选取排名前 300 的证券作为指数样本。

投资者可通过以下路径查询指数信息：<http://www.csindex.com.cn/zh-CN/indices/index-detail/931395>”

在本基金招募说明书“重要提示”中增加有关风险提示内容如下：

“本基金可能出现跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌等风险。”

(二) 在招募说明书“第一部分 绪言”增加订立招募说明书的依据:

“……《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》(以下简称“《指数基金指引》”)”

(三) 在本基金招募说明书“第二部分 释义”中增加:

“16、《指数基金指引》:指中国证监会2021年1月22日颁布、同年2月1日实施的《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》及颁布机关对其不时做出的修订”

(四) 将本基金招募说明书“第十一部分 基金的投资”中“六、业绩比较基准”内容修订为:

“本基金的业绩比较基准为中证沪港深300指数。

未来若出现标的指数不符合法律法规及监管的要求(因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外)、指数编制机构退出等情形,基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案,如更换基金标的指数、转换运作方式,与其他基金合并、或者终止基金合同等,并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决。

在指数停止编制发布至解决方案确定期间,基金管理人应按照最近一个交易日的指数信息维持基金投资运作。

法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。”

(五) 在本基金招募说明书“第十八部分 风险揭示”中“十六、本基金特有的风险”新增基金跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌的风险揭示内容如下:

“4、跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.2%以内,年化跟踪误差控制在2%以内,但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围,本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

5、指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护,未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护,本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案,如更换基金标的指数、转换运作方式,与其他基金合并、或者终止基金合同等,并在6个月

内召集基金份额持有人大会进行表决。投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定并实施前，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作，该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异，影响投资收益。

.....

11、成份股停牌的风险

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌，发生成份股停牌时可能面临如下风险：

1) 基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

2) 停牌成份股可能因其权重占比、市场复牌预期、现金替代标识等因素影响本基金二级市场价格的折溢价水平。

3) 若成份股停牌时间较长，在约定时间内仍未能及时买入或卖出的，则该部分款项将按照约定方式进行结算（具体见招募说明书“第十部分 基金份额的申购与赎回”之“七、申购赎回清单的内容与格式”相关约定），由此可能影响投资者的投资损益并使基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。

4) 在极端情况下，标的指数成份股可能大面积停牌，基金可能无法及时卖出成份股以获取足额的符合要求的赎回对价，由此基金管理人可能在申购赎回清单中设置较低的赎回份额上限或者采取暂停赎回的措施，投资者将面临无法赎回全部或部分 ETF 份额的风险。”

（六）其他因基金管理人信息更新等原因而对招募说明书作出的必要修改及更新。

三、基金管理人已履行了规定程序，符合相关法律法规的规定及本基金基金合同的约定。修改后的本基金基金合同全文将与本公告同日登载于基金管理人网站（www.gsfunds.com.cn）及中国证监会基金电子披露网站

（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）。根据修改的基金合同，基金管理人将更新本基金的招募说明书和基金产品资料概要相关内容，并揭示风险。

四、其他事项

1. 投资者可通过以下途径咨询有关详情客户服务电话：4009-258-258 网址：www.gsfunds.com.cn

2. 风险提示:

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分，并提出适当性匹配意见。投资者在投资基金前应认真阅读基金合同、招募说明书（更新）和基金产品资料概要（更新）等基金法律文件，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

特此公告。

国寿安保基金管理有限公司

2021年4月2日