

---

# 人保沪深 300 指数型证券投资基金

## 2020 年第 1 季度报告

### 2020 年 03 月 31 日

基金管理人:中国人保资产管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

报告送出日期:2020 年 04 月 22 日

## 目录

|   |    |
|---|----|
| §1 重要提示.....                                  | 3  |
| §2 基金产品概况.....                                | 3  |
| §3 主要财务指标和基金净值表现.....                         | 4  |
| 3.1 主要财务指标.....                               | 4  |
| 3.2 基金净值表现.....                               | 4  |
| §4 管理人报告.....                                 | 5  |
| 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介.....                      | 5  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....               | 6  |
| 4.3 公平交易专项说明.....                             | 6  |
| 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析.....                     | 6  |
| 4.5 报告期内基金的业绩表现.....                          | 7  |
| 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....                | 7  |
| §5 投资组合报告.....                                | 7  |
| 5.1 报告期末基金资产组合情况.....                         | 7  |
| 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                     | 8  |
| 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细.....     | 9  |
| 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....                   | 10 |
| 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....     | 11 |
| 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细..... | 11 |
| 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....    | 11 |
| 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....     | 11 |
| 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....                 | 11 |
| 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....                | 11 |
| 5.11 投资组合报告附注.....                            | 11 |
| §6 开放式基金份额变动.....                             | 13 |
| §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况.....                    | 13 |
| 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况.....                     | 13 |
| 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细.....                 | 13 |
| §8 影响投资者决策的其他重要信息.....                        | 13 |
| 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....        | 13 |
| 8.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                       | 14 |
| §9 备查文件目录.....                                | 14 |
| 9.1 备查文件目录.....                               | 14 |
| 9.2 存放地点.....                                 | 14 |
| 9.3 查阅方式.....                                 | 14 |

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年4月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2020年1月1日起至3月31日止。

## §2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 人保沪深300   |
| 基金主代码      | 006600  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2019年02月28日   |
| 报告期末基金份额总额 | 165,896,046.93份   |
| 投资目标       | 本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪沪深300指数，在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。  |
| 投资策略       | 本基金原则上采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。本基金主要按照标的指数的成份股及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以达到复制和跟踪标的指数的目的。本基金在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。 |
| 业绩比较基准     | 沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%  |
| 风险收益特征     | 本基金属于采用指数化操作的股票型基金，其  |

|       |                              |
|-------|------------------------------|
|       | 预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金。 |
| 基金管理人 | 中国人保资产管理有限公司                 |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司                   |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2020年01月01日 - 2020年03月31日） |
|-----------------|--------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 13,952,749.05                  |
| 2. 本期利润         | -16,760,703.22                 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0686                        |
| 4. 期末基金资产净值     | 170,284,750.28                 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0265                         |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、上述本基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如：基金的申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段    | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③   | ②-④    |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | -7.87% | 1.85%     | -9.49%     | 1.86%         | 1.62% | -0.01% |

##### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

人保沪深300指数型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于2019年2月28日生效。根据基金合同规定，本基金建仓期为6个月，建仓期满，本基金的各项投资比例应符合基金合同的有关约定。

2、本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率\*95%+银行活期存款利率(税后)\*5%

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务   | 任本基金的基金经理期限 |            | 证券从业年限 | 说明  |
|-----|------|-------------|------------|--------|---|
|     |      | 任职日期        | 离任日期       |        |   |
| 刘笑明 | 基金经理 | 2019-02-28  | 2020-04-02 | 5年     | 北京大学化学学士、经济学学士，哥伦比亚大学运筹学硕士。曾任建信基金衍生品及量化投资部研究员、投资经理，北京极至投资管理有限公司投资经理。2017年6月加入中国人保资产管理有限公司公募基金事业部，2018年9月2 |

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | 7日起至2020年4月2日任人保量化基本面混合型证券投资基金基金经理，2018年12月7日起至2020年4月2日任人保中证500指数型证券投资基金基金经理，2019年2月28日起至2020年4月2日任人保沪深300指数型证券投资基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---|

注:1、基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日。

2、非首任基金经理,其“任职日期”为公告确定的聘任日期。

3、2020年4月8日,公司发布了《人保沪深300指数型证券投资基金基金经理变更公告》,自2020年4月2日起增聘彬彬为本基金的基金经理、解聘刘笑明担任本基金的基金经理,上述事项已按规定在中国证券投资基金业协会办理变更手续,并报中国证监会北京证监局备案。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《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》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、基金合同和其他有关法律法规,本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人公平对待旗下所有公募基金投资组合,建立了公平交易制度和流程。报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,在研究分析、投资决策、交易执行等各个环节,公平对待旗下所有公募基金投资组合,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内,未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，基金管理人根据基金依据约定，以被动指数化投资为原则进行基金的投资运作，并通过定量技术对基金跟踪误差进行监控。报告期内基金跟踪误差来源主要是：1) 标的指数成份股中法律法规禁止本基金投资的股票；2) 基金的申购赎回；

本基金作为一只跟踪沪深300指数的被动指数产品，基金管理人将运用指数化投资策略，紧密跟踪基准，在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末人保沪深300基金份额净值为1.0265元，本报告期内，基金份额净值增长率为-7.87%，同期业绩比较基准收益率为-9.49%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)          | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 160,247,480.66 | 93.05         |
|    | 其中：股票             | 160,247,480.66 | 93.05         |
| 2  | 基金投资              | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 8,919,397.50   | 5.18          |
|    | 其中：债券             | 8,919,397.50   | 5.18          |
|    | 资产支持证券            | -              | -             |
| 4  | 贵金属投资             | -              | -             |
| 5  | 金融衍生品投资           | -              | -             |
| 6  | 买入返售金融资产          | -              | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 2,385,053.63   | 1.38          |
| 8  | 其他资产              | 658,679.25     | 0.38          |
| 9  | 合计                | 172,210,611.04 | 100.00        |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值(元)        | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 3,015,363.00   | 1.77         |
| B  | 采矿业              | 4,426,931.80   | 2.60         |
| C  | 制造业              | 69,350,350.29  | 40.73        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,828,180.29   | 2.25         |
| E  | 建筑业              | 4,167,689.00   | 2.45         |
| F  | 批发和零售业           | 1,880,337.00   | 1.10         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 4,190,163.32   | 2.46         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 5,965,510.20   | 3.50         |
| J  | 金融业              | 49,630,983.69  | 29.15        |
| K  | 房地产业             | 6,967,577.59   | 4.09         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 1,520,843.00   | 0.89         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 785,453.20     | 0.46         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 208,372.00     | 0.12         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -            |
| P  | 教育               | 195,822.00     | 0.11         |
| Q  | 卫生和社会工作          | 1,352,536.58   | 0.79         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 787,167.10     | 0.46         |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 158,273,280.06 | 92.95        |

### 5.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别        | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-------------|--------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业    | -            | -            |
| B  | 采矿业         | -            | -            |
| C  | 制造业         | 1,937,500.31 | 1.14         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生 | -            | -            |



|   |                 |              |      |
|---|-----------------|--------------|------|
|   | 产和供应业           |              |      |
| E | 建筑业             | -            | -    |
| F | 批发和零售业          | 19,147.31    | 0.01 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业     | -            | -    |
| H | 住宿和餐饮业          | -            | -    |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | -            | -    |
| J | 金融业             | -            | -    |
| K | 房地产业            | -            | -    |
| L | 租赁和商务服务业        | -            | -    |
| M | 科学研究和技术服务业      | 17,552.98    | 0.01 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | -            | -    |
| O | 居民服务、修理和其他服务业   | -            | -    |
| P | 教育              | -            | -    |
| Q | 卫生和社会工作         | -            | -    |
| R | 文化、体育和娱乐业       | -            | -    |
| S | 综合              | -            | -    |
|   | 合计              | 1,974,200.60 | 1.16 |

### 5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

#### 5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)   | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 601318 | 中国平安 | 135,121 | 9,346,319.57 | 5.49         |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 6,036   | 6,705,996.00 | 3.94         |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 142,396 | 4,596,542.88 | 2.70         |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 4  | 600276 | 恒瑞医药 | 42,234  | 3,886,795.02 | 2.28 |
| 5  | 000651 | 格力电器 | 62,522  | 3,263,648.40 | 1.92 |
| 6  | 000333 | 美的集团 | 65,700  | 3,181,194.00 | 1.87 |
| 7  | 000858 | 五粮液  | 27,011  | 3,111,667.20 | 1.83 |
| 8  | 600030 | 中信证券 | 111,600 | 2,473,056.00 | 1.45 |
| 9  | 600887 | 伊利股份 | 79,592  | 2,376,617.12 | 1.40 |
| 10 | 600016 | 民生银行 | 380,200 | 2,170,942.00 | 1.27 |

### 5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)  | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------|------------|--------------|
| 1  | 688139 | 海尔生物 | 13,249 | 395,880.12 | 0.23         |
| 2  | 688037 | 芯源微  | 3,028  | 317,122.44 | 0.19         |
| 3  | 688208 | 道通科技 | 10,736 | 289,227.84 | 0.17         |
| 4  | 688101 | 三达膜  | 13,483 | 242,154.68 | 0.14         |
| 5  | 688100 | 威胜信息 | 11,602 | 196,653.90 | 0.12         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|--------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -            | -            |
| 2  | 央行票据      | -            | -            |
| 3  | 金融债券      | 8,919,397.50 | 5.24         |
|    | 其中：政策性金融债 | 8,919,397.50 | 5.24         |
| 4  | 企业债券      | -            | -            |

|    |           |              |      |
|----|-----------|--------------|------|
| 5  | 企业短期融资券   | -            | -    |
| 6  | 中期票据      | -            | -    |
| 7  | 可转债（可交换债） | -            | -    |
| 8  | 同业存单      | -            | -    |
| 9  | 其他        | -            | -    |
| 10 | 合计        | 8,919,397.50 | 5.24 |

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称   | 数量（张）  | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|--------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 018007 | 国开1801 | 88,530 | 8,919,397.50 | 5.24         |

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末无股指期货投资。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 贵州茅台（代码：600519.SH）为人保沪深300前十大持仓证券。2019年5月7日贵州茅台受到上海证券交易所上市公司监管一部监管关注。公司因多篇媒体报道其控股股东中国贵州茅台酒厂（集团）有限责任公司成立营销公司，造成投资者关注，被下发《关于贵州茅台酒股份有限公司媒体报道相关事项的监管工作函》，被要求披露相关内容。

中信证券（代码：600030.SH）为人保沪深300前十大持仓证券。2019年7月16日中信证券受到证监会行政监督管理措施。公司因在保荐上海柏楚电子科技有限公司科

创业板首次公开发行股票申请过程中以落实“对招股说明书披露内容进行整理和精炼”的问询问题为由，对前期间询要求披露的“综合毛利率、销售净利率及净资产收益率大幅高于同行业可比上市公司，期间费用率远低于同行业可比上市公司等事项的差异原因分析”等内容在招股说明书注册稿（6月28日）中擅自进行了删减，并且其从7月1日到3日提交的7版招股说明书注册稿及反馈意见落实函的签字盖章日期均为2019年7月1日，日期签署与实际时间不符，被出具警示函。

伊利股份（代码：600887.SH）为人保沪深300前十大持仓证券。2019年4月12日伊利股份受到上海证券交易所监管处分。公司因就媒体报道相关事项明确监管要求，被下发《关于内蒙古伊利实业集团股份有限公司股份回购事项的监管工作函》。

本基金投资贵州茅台、中信证券、伊利股份的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除贵州茅台、中信证券、伊利股份外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查，且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.11.2 本基金投资的前十名股票未超过基金合同规定的备选股票库。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 52,050.96  |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 206,394.78 |
| 5  | 应收申购款   | 400,233.51 |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 其他      | -          |
| 8  | 合计      | 658,679.25 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的股票。

#### 5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|------------|---------------|----------|
| 1  | 688139 | 海尔生物 | 395,880.12 | 0.23          | 新股锁定     |
| 2  | 688037 | 芯源微  | 317,122.44 | 0.19          | 新股锁定     |
| 3  | 688208 | 道通科技 | 289,227.84 | 0.17          | 新股锁定     |
| 4  | 688101 | 三达膜  | 242,154.68 | 0.14          | 新股锁定     |
| 5  | 688100 | 威胜信息 | 196,653.90 | 0.12          | 新股锁定     |

#### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |                |
|---------------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 315,813,433.82 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 26,657,435.24  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 176,574,822.13 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -              |
| 报告期期末基金份额总额               | 165,896,046.93 |

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；  
2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### § 8 影响投资者决策的其他重要信息

#### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投 | 报告期内持有基金份额变化情况 | 报告期末持有基金情况 |
|---|----------------|------------|
|---|----------------|------------|

| 资<br>者<br>类<br>别  | 序<br>号 | 持有基金<br>份额比例<br>达到或者<br>超过20%<br>的时间区<br>间 | 期初份额          | 申购份额 | 赎回份额          | 持有份额          | 份额占比   |
|---|--------|--|---------------|------|---------------|---------------|--------|
| 机<br>构  | 1      | 20200219<br>-2020033<br>1                  | 50,667,815.16 | -    | 0.00          | 50,667,815.16 | 30.54% |
|   | 2      | 20200101<br>-2020030<br>1                  | 81,758,474.20 | -    | 71,403,070.33 | 10,355,403.87 | 6.24%  |
| 产品特有风险  |        |  |               |      |               |               |        |
| <p>本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，该类投资者大额赎回所持有的基金份额时，将可能产生流动性风险，即基金资产不能迅速变现，或者未能以合理的价格变现基金资产以支付投资者赎回款，对资产净值产生不利影响。</p> <p>当开放式基金发生巨额赎回，基金管理人认为基金组合资产变现能力有限或认为因应对赎回导致的资产变现对基金单位份额净值产生较大的波动时，为了切实保护存量基金份额持有人的合法权益，可能出现延期支付赎回款等情形。同时为了公平对待所有投资者合法权益不受损害，管理人有权根据基金合同和招募说明书的约定，暂停或者拒绝申购、暂停赎回，基金份额持有人存在可能无法及时赎回持有的全部基金份额的风险。</p> <p>在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。此外，当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。</p> |        |  |               |      |               |               |        |

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予人保沪深300指数型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《人保沪深300指数型证券投资基金基金合同》；
- 3、《人保沪深300指数型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 5、报告期内人保沪深300指数型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告的原稿。

### 9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

### 9.3 查阅方式

基金管理人办公地址：北京市西城区西长安街88号中国人保大厦

基金托管人办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人中国人保资产管理有限公司。

客户服务中心电话：400-820-7999

基金管理人网址：[fund.piccamc.com](http://fund.piccamc.com)

中国人保资产管理有限公司

2020年04月22日