

国寿安保基金管理有限公司关于国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金联接基金根据《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《国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的约定，经与国寿安保国证创业板中盘精选 88 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”；A 类基金份额简称：国寿安保创精选 88ETF 联接 A，基金代码：008898；C 类基金份额简称：国寿安保创精选 88ETF 联接 C，基金代码：008899）基金托管人中信证券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：

“本基金主要投资于目标 ETF，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。”

删除不适用的条款：“六、本基金合同关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行。”

（二）在基金合同“第二部分 释义”中增加：

“15、《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“五、本基金的目标 ETF 及标的指数”内容修订为：

“本基金的目标 ETF 为国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金，标的指数是国证创业板中盘精选 88 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，但下文“目标 ETF 的变更”另有约定的除外。

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“第十二部分 基金的投资”中“五、业绩比较基准”内容修订为：

“本基金的业绩比较基准为：

国证创业板中盘精选 88 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

国证创业板中盘精选 88 指数由深圳证券信息有限公司编制并发布，反映创业板市场财务较为稳健的中盘成长股的运行表现。

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，但下文“目标 ETF 的变更”另有约定的除外。

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国证创业板中盘精选 88 指数。

1、选样空间

在深圳证券交易所创业板上市交易且满足下列条件的所有 A 股：

- (1) 上市时间超过六个月；
- (2) 公司最近一年无重大违规、财务报告无重大问题；
- (3) 公司最近一年经营无异常、无重大亏损；
- (4) 考察期内股价无异常波动。

2、选样方法

首先，剔除近半年日均成交金额排名后 10%的股票；

其次，剔除最新大股东累计质押比例超过 70%的股票，剔除商誉占净资产比例超过 100%的股票；

然后，对选样空间剩余股票按近半年日均总市值从高到低排序，选取前 188 名股票构成指数初选池；

最后，剔除排名前 100 名的股票，剩余 88 只股票构成指数样本股。

投资者可通过以下路径查询指数信息：

http://www.cnindex.com.cn/module/index-detail.html?act_menu=1&indexCode=399291”

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：

“15、《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“第九部分 基金的投资”中“五、业绩比较基准”内容修订为：

“本基金的业绩比较基准为：

国证创业板中盘精选 88 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

国证创业板中盘精选 88 指数由深圳证券信息有限公司编制并发布，反映创业板市场财务较为稳健的中盘成长股的运行表现。

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，但下文“目标ETF的变更”另有约定的除外。

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“第十七部分 风险揭示”中“一、投资于本基金的主要风险”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0.3%以内，年化跟踪误差控制在4%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，但前文“目标ETF的变更”另有约定的除外。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。

6、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，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。”

（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