

国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

基金产品资料概要更新

编制日期：2024 年 5 月 31 日

送出日期：2024 年 6 月 1 日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

基金简称	国寿安保沪港深 300ETF 联接	基金代码	012663
下属基金简称	国寿安保沪港深 300ETF 联接 A	下属基金交易代码	012663
下属基金简称	国寿安保沪港深 300ETF 联接 C	下属基金交易代码	012664
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司	基金托管人	招商银行股份有限公司
基金合同生效日	2022 年 2 月 25 日	上市交易所及上市日期	-
基金类型	股票型	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	李康	开始担任本基金基金经理的日期	2022 年 02 月 25 日
		证券从业日期	2009 年 10 月 12 日

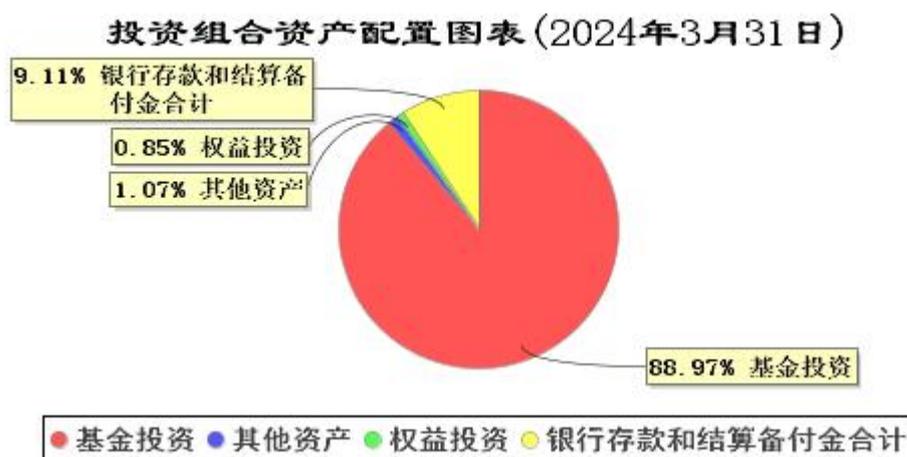
二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

投资目标	本基金通过对目标 ETF 基金份额的投资，追求跟踪标的指数，获得与指数收益相似的回报。
投资范围	<p>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（包含港股通标的股票、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、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、证券公司短期公司债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货、国债期货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的相关规定）。</p> <p>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%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例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。其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金投资港股通投资标的股票，未来如果港股通业务规则发生变化或出现法律法规或监管部门允许投资的其他模式，基金管理人可在履行适当程序后相应调整。</p>

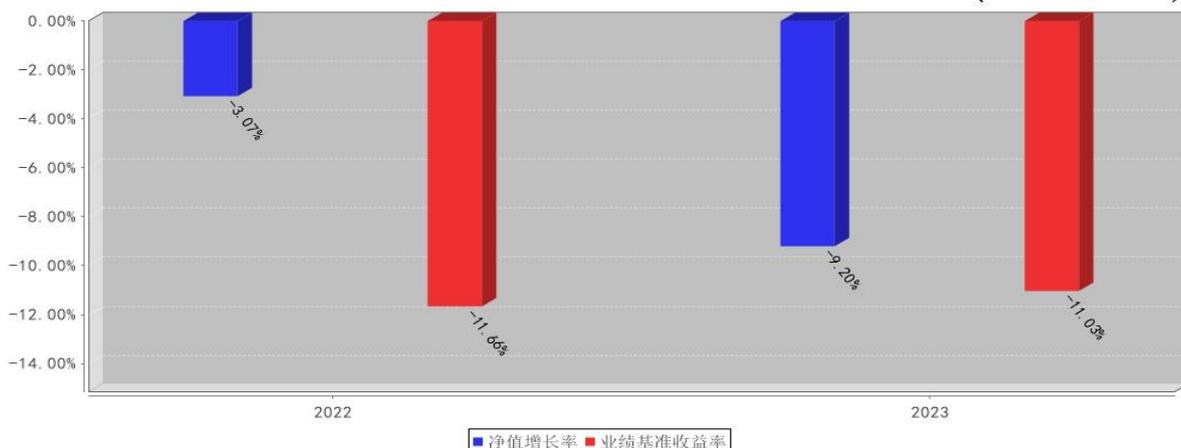
	<p>基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，参与转融通证券出借业务，以提高投资效率及进行风险管理。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p>
主要投资策略	<p>本基金主要投资于目标 ETF，方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金不参与目标 ETF 的投资管理。</p> <p>为实现投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90% 的资产投资于目标 ETF。其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、国内依法发行上市的非成份股（包括港股通标的股票、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、衍生工具、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。</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	中证沪港深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	<p>本基金为 ETF 联接基金，通过投资于目标 ETF 跟踪中证沪港深 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。</p> <p>本基金属于 ETF 联接基金，目标 ETF 为股票型基金，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。本基金投资标的包括港股通投资标的股票，还需承担汇率风险和港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

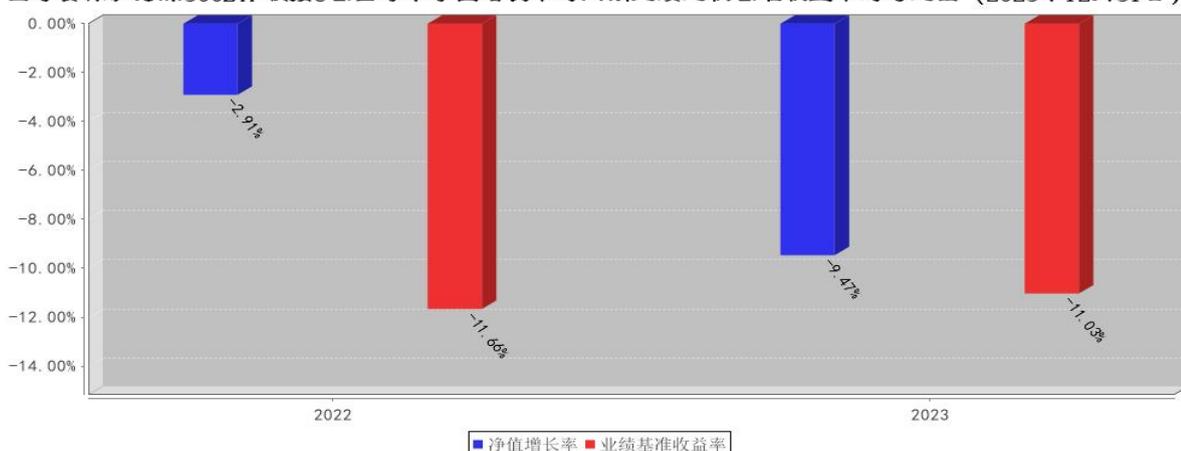


(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

国寿安保沪港深300ETF联接A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图 (2023年12月31日)



国寿安保沪港深300ETF联接C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图 (2023年12月31日)



三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

国寿安保沪港深 300ETF 联接 A

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) /持有期限 (N)	收费方式/费率	备注
申购费 (前收费)	M < 1,000,000	1.20%	-
	1,000,000 ≤ M < 5,000,000	0.80%	-
	5,000,000 ≤ M < 10,000,000	0.30%	-
	M ≥ 10,000,000	1,000 元/笔	按笔收取
赎回费	N < 7 天	1.50%	-
	7 天 ≤ N < 30 天	0.50%	-
	N ≥ 30 天	0%	-

国寿安保沪港深 300ETF 联接 C

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) /持有期限 (N)	收费方式/费率
------	-----------------------------	---------

申购费 (前收费)	-	0%
赎回费	N<7 天	1.50%
	7 天≤N<30 天	0.50%
	N≥30 天	0%

(二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率或金额		收取方
管理费	0.50%		基金管理人和销售机构
托管费	0.10%		基金托管人
销售服务费	国寿安保沪港深 300ETF 联接 C	0.30%	销售机构
审计费用	30,000.00 元		会计师事务所
信息披露费	120,000.00 元		规定披露报刊
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的律师费、基金份额持有人大会费用、基金的证券交易费用、基金的银行汇划费用、基金相关账户的开户及维护费用等费用，以及按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。费用类别详见本基金《基金合同》及《招募说明书》或其更新。		

注：1、本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

2、审计费用、信息披露费、指数许可使用费（若有）为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

(三) 基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

国寿安保沪港深 300ETF 联接 A

	基金运作综合费率（年化）
持有期间	0.72%

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

国寿安保沪港深 300ETF 联接 C

	基金运作综合费率（年化）
持有期间	1.02%

四、风险揭示与重要提示

(一) 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险。

本基金面临的主要风险有本基金的特有风险、市场风险、信用风险、债券收益率曲线变动风险、证券公司短期公司债投资风险、资产支持证券投资风险、股指期货投资风险、国债期货投资风险、再投资风险、流动性风险、管理风险、操作或技术风险、合规性风险、基金估值风险、港股投资风险、不可抗力等。

本基金的特有风险包括：

1、联接基金风险

本基金为 ETF 联接基金，基金资产主要投资于目标 ETF，在多数情况下将维持较高的目标 ETF 投资比例，基金净值可能会随目标 ETF 的净值波动而波动，目标 ETF 的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。

2、跟踪偏离风险

本基金主要投资于目标 ETF 基金份额，追求跟踪标的指数，获得与指数收益相似的回报。以下因素可能会影响到基金的投资组合与跟踪基准之间产生偏离：

- ①目标 ETF 与标的指数的偏离。
- ②基金买卖目标 ETF 时所产生的价格差异、交易成本和交易冲击。
- ③基金调整资产配置结构时所产生的跟踪误差。
- ④基金申购、赎回因素所产生的跟踪误差。
- ⑤基金现金资产拖累所产生的跟踪误差。
- ⑥基金的管理费和托管费所产生的跟踪误差。
- ⑦其他因素所产生的偏差。

3、与目标 ETF 业绩差异的风险

本基金为目标 ETF 的联接基金，但由于投资方法、交易方式等方面与目标 ETF 不同，本基金的业绩表现与目标 ETF 的业绩表现可能出现差异。

(二) 重要提示

中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成本基金业绩表现的保证。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

本基金的争议解决方式：在中国国际经济贸易仲裁委员会申请仲裁。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站。

网址：<http://www.gsfunds.com.cn> 客服电话：4009-258-258

- 1、基金合同、托管协议、招募说明书
- 2、定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 3、基金份额净值
- 4、基金销售机构及联系方式
- 5、其他重要资料