

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	国寿安保沪深 300ETF 联接	基金代码	000613
下属基金简称	国寿安保沪深 300ETF 联接 A	下属基金交易代码	000613
下属基金简称	国寿安保沪深 300ETF 联接 C	下属基金交易代码	021103
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司	基金托管人	中国农业银行股份有限公司
基金合同生效日	2014 年 6 月 5 日	上市交易所及上市日期	未上市
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	2015 年 03 月 20 日
		证券从业日期	2009 年 10 月 12 日

注：本基金由国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金于 2018 年 8 月 13 日转型而来。

二、基金投资与净值表现

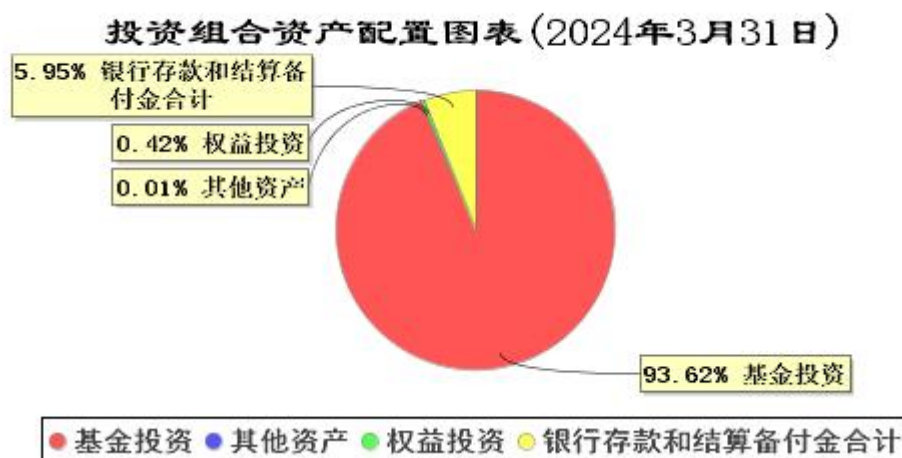
(一) 投资目标与投资策略

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。
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）。</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> <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，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。</p> <p>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。</p>

<p>主要投资策略</p>	<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（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。</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>
<p>业绩比较基准</p>	<p>沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>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。</p> <p>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。</p>

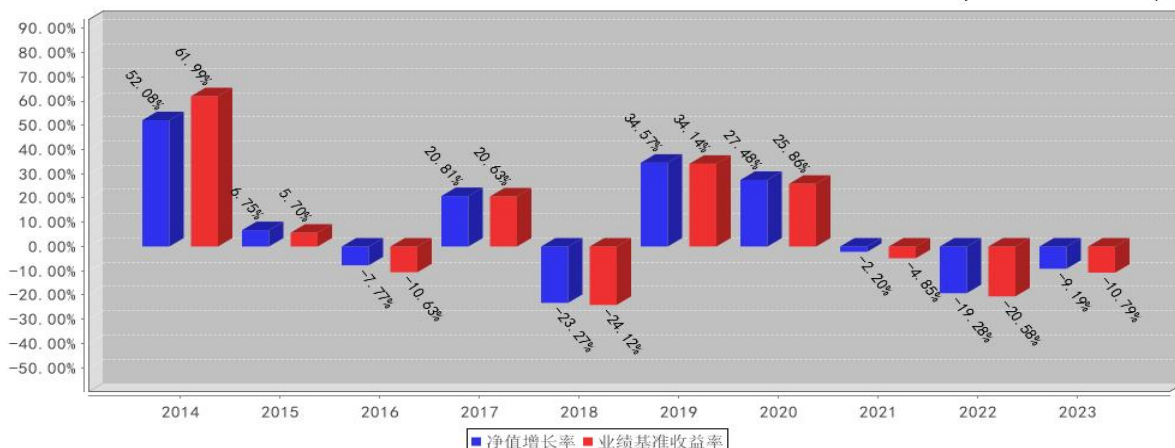
注：注：请投资者阅读本基金《招募说明书》“基金的投资”部分了解详细情况。

(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）



注：自 2024 年 4 月 3 日起，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增设 C 类基金份额。故本次产品资料概要更新暂无国寿安保沪深 300ETF 联接 C 类基金份额的业绩。

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	1.0%	-
	1,000,000 ≤ M < 5,000,000	0.6%	-
	M ≥ 5,000,000	1,000 元/笔	按笔收取
赎回费	N < 7 天	1.50%	-
	7 天 ≤ N < 365 天	0.50%	-
	1 年 ≤ N < 2 年	0.25%	1 年指 365 天, 2 年指 730 天
	N ≥ 2 年	0%	-

国寿安保沪深 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%
	N ≥ 7 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	0.5%	基金管理人和销售机构

托管费	0.1%		基金托管人
销售服务费	国寿安保沪深 300ETF 联接 C	0.1%	销售机构
审计费用	70,000.00 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：

国寿安保沪深 300ETF 联接 A

	基金运作综合费率（年化）
持有期间	0.62%

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。

国寿安保沪深 300ETF 联接 C

	基金运作综合费率（年化）
持有期间	-

注：本基金自 2024 年 4 月 8 起增设 C 类基金份额。

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。

本基金面临的风险主要有市场风险、指数化投资风险、跟踪偏离风险、投资标的过分集中的风险、巨额申购赎回所隐含的风险、流动性风险、操作或技术风险、政策变更风险和其他风险。

本基金特定投资策略带来的风险包括：

（1）指数化投资风险

本基金的主要投资标的为被动跟踪标的指数的沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金。本基金的资产净值会随标的指数的波动而波动。

1) 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。

2) 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。

3) 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。

(2) 跟踪偏离风险

以下因素可能导致基金投资组合的收益率无法紧密跟踪标的指数的收益率：

1) 基金有投资成本、各种费用及税收，而指数编制不考虑费用和税收，这将导致基金收益率落后于标的指数收益率，产生负的跟踪偏离度。

2) 指数成份股派发现金红利、新股市值配售收益等因素将导致基金收益率超过标的指数收益率，产生正的跟踪偏离度。

3) 当标的指数调整成份股构成，或成份股公司发生配股、增发等行为导致该成份股在指数中的权重发生变化，或标的指数变更编制方法时，基金在相应的组合调整中可能暂时扩大与标的指数的构成差异，而且会产生相应的交易成本，导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

4) 投资者申购、赎回可能带来一定的现金流或变现需求，在遇到标的指数成份股停牌、摘牌或流动性较差等情形时，基金可能无法及时调整投资组合或承担冲击成本，导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

5) 在基金进行指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对基金收益产生影响，从而影响基金跟踪偏离度和跟踪误差。

6) 其他因素产生的偏离。如因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较高；因指数发布机构指数编制错误等产生的跟踪偏离度和跟踪误差。

(3) 投资标的的过分集中的风险

本基金对目标 ETF 的投资比例不低于本基金资产净值的 90%，投资标的的单一且过分集中有可能会给本基金带来风险。

(4) 巨额申购赎回所隐含的风险

本基金对目标 ETF 的投资比例不低于基金资产净值的 90%。在巨额申购发生时，可能会出现短期内对标的指数成份股的投资比例或者对目标 ETF 份额的投资比例被迫处于较低水平的状况，从而导致跟踪误差的大幅增加；在巨额赎回发生时，可能会出现短期内被迫卖出大量的标的指数成份股或者被迫卖出大量的目标 ETF 份额，这种流动性买卖压力也可能导致跟踪误差的大幅增加。

(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