

中国太平洋人寿保险股份有限公司关于投资华宝中证医疗指数分级证券投资基金关联交易的信息披露公告

(2019-103)

根据《保险公司资金运用信息披露准则第1号：关联交易》（保监发〔2014〕44号）的相关规定，中国太平洋人寿保险股份有限公司（以下简称“本公司”）现将定期份额折算转入华宝基金管理有限公司（以下简称“华宝基金”）发行的华宝中证医疗指数分级证券投资基金（以下简称“华宝中证医疗”或“该基金”）关联交易情况披露如下：

一、交易概述及交易标的基本情况

（一）交易概述

华宝基金于2019年12月17日发布公告，以2019年12月13日为基金份额折算基准日，对在该日登记在册的华宝中证医疗指数分级证券投资基金份额（场内简称：医疗分级，代码：162412）和华宝中证医疗指数分级A证券投资基金份额（场内简称：医疗A，代码：150261）办理定期份额折算业务。定期份额折算后华宝医疗A份额的基金份额参考净值调整为1.0000元。基金份额折算基准日华宝医疗A份额参考净值超过1.0000元的部分，将折算为场内华宝医疗份额分配给华宝医疗A份额持有人。

本次定期份额折算后，本公司持有的华宝中证医疗指数分级A证券投资基金参考净值超过1.0000元的部分折算为华宝中证医疗指数分级证券投资基金，折算金额为人民币10.9678万元。

本次交易为资金运用类关联交易。

（二）交易标的基本情况

华宝中证医疗基金为股票型指数基金，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。在正常情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。该基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、资产支持证券、权证、股指期货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）。

二、交易各方的关联关系和关联方基本情况

（一）交易各方的关联关系

华宝基金为持有本公司 5%以上股权的法人华宝投资有限公司的控股股东中国宝武钢铁集团有限公司直接、间接控制的公司，构成我司关联方。

（二）关联方基本情况

关联方名称：华宝基金管理有限公司

企业类型：有限责任公司（中外合资）

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号
58 楼

法定代表人：孔祥清

经营范围：基金管理业务；发起设立基金及中国有关政府机构批准及同意的其他业务。

注册资本：人民币 1.5 亿元

统一社会信用代码：91310000710936321D

三、交易的定价政策及定价依据

（一）定价政策

本关联交易按照一般商业条款以及公平、公正的市场化原则进行运作，符合相关法律法规要求，不存在损害任何一方及其股东或相关方利益的情形。

（二）定价依据

华宝中证医疗指数分级证券投资基金根据《证券投资基金法》、《信托法》设立的契约型开放式基金产品，其定价依据产品估值后确定的资产净值计算出对应的份额净值，华宝基金根据《基金合同》从基金财产中列支管理费。本公司按照“金额申购、份额赎回”方式进行申购赎回，符合公平、公允原则。

四、交易协议的主要内容

（一）交易价格

2019年12月17日，华宝基金发布公告，以2019年12月13日为基金份额折算基准日，对在该日登记在册的华宝中证医疗指数分级证券投资基金份额和华宝中证医疗指数分级A证券投资基金份额办理定期份额折算业务。本次折算金额为人民币10.9678万元。

（二）交易结算方式

该产品申购、赎回金额结算方式为现金一次支付。

（三）协议生效条件、生效时间、履行期限

华宝基金于2019年12月17日对基金份额进行定期份额折算，本次折算比例为1.02479159，折算金额为10.9678万元，履行期限为不定期。

五、交易决策及审议情况

（一）决策的机构、时间、结论

本公司委托太平洋资产管理有限责任公司（以下简称“太保资产”）进行保险资金的管理运用。按照相关法律法规及监管规定，本公司与太保资产签订了《委托资产管理合同》，约定由太保资产负责本公司的资金运用事宜。太保资产根据《委托资产管理合同》、投资指引和本公司的资产管理投资需求，自主进行委托资产管理项下的资产配置、投资决策和资金运用操作，制定具体投资策略和风险控制策略，发出投资交易和其他相关指令。

（二）审议的方式和过程

本次定期份额折算由华宝基金根据基金合同的相关规定，以公告日期作为基金份额折算基准日办理定期份额折算业务，并公告份额折算确认结果。

六、其他需要披露的信息

无。

本公司承诺：已充分知晓开展此项交易的责任和风险，并对本公告所披露信息的真实性、准确性、完整性和合规性负责，愿意接受有关方面监督。对本公告所披露信息如有异议，可以于本公告发布之日起 10 个工作日内，向中国银行保险监督管理委员会资金运用监管部反映。