

# 中国太平洋人寿保险股份有限公司关于投资华宝 标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金关联交易的 信息披露公告 (2020-38)

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）及相关规定，现将中国太平洋人寿保险股份有限公司（以下简称“本公司”）申购华宝基金管理有限公司（以下简称“华宝基金”）发行的华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金（以下简称“华宝香港上市中国中小盘 A 基金”或“该基金”）关联交易的有关信息披露如下：

## 一、交易概述及交易标的基本情况

### （一）交易概述

2020 年 3 月 24 日，本公司申购华宝香港上市中国中小盘 A 基金，申购金额人民币 0.20 亿元。根据中国银保监会相关规定，该交易属于资金运用类关联交易。

### （二）交易标的基本情况

华宝香港上市中国中小盘 A 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。正常情况下，本基金力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 5%。该基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成分股、备选成分股、已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的其他股票、固定收益类证券、银行存款、货币市场工具、回购、证券借贷、跟踪同一

标的指数的股指期货等金融衍生品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)。该基金投资于标的指数成分股、备选成分股的资产不低于基金资产的 80%。本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

## 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

中国宝武钢铁集团有限公司间接持有本公司 5%以上股份，华宝基金受控于中国宝武钢铁集团有限公司，故本公司与华宝基金构成关联方。

### (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

该基金根据《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**

基金申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算，申购金额为人民币 0.20 亿元。该基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.0% 年费率计提。

##### **（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。基金管理费每日计提，按月支付。

##### **（三）协议生效条件、生效时间、履行期限**

本公司于 2020 年 3 月 23 日申请申购，于 2020 年 3 月 24 日确认生效并完成交易，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。本次投资决策于 2020 年 3 月 23 日经相关投资决策流

程审批通过。

## （二）审议的方式和过程

本次投资由太保资产投资管理部门以投资操作申请的形式发起，按照太保资产相关投资交易权限，经相关投资决策流程审批通过。

## 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。