

长江养老保险股份有限公司
关于认购华宝兴业基金中证医疗指数分级基金关联交易的
信息披露公告

(2016-001)

根据中国保监会《保险公司资金运用信息披露准则第1号：关联交易》及相关规定，现将长江养老保险股份有限公司（以下简称“我司”）管理的养老保障产品认购华宝兴业基金管理有限公司（以下简称“华宝兴业基金”）发行的中证医疗指数分级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的基本情况

（一）交易概述

2016年1月6日，由我司以管理的养老保障管理产品资金出资购买华宝兴业中证医疗指数分级基金，认购金额人民币20277.44元。2016年1月8日，由我司以管理的养老保障管理产品资金出资购买华宝兴业中证医疗指数分级基金，认购金额人民币801885.05元。2016年1月13日，由我司以管理的养老保障管理产品资金出资购买华宝兴业中证医疗指数分级基金，认购金额人民币212772.00元。

此三笔交易为公司作为养老保障管理产品发行人的正常投资行为，对公司正常经营活动及财务状况无重大影响。

（二）交易标的的基本情况

华宝兴业中证医疗指数分级基金分为母基金华宝兴业中证医疗指数分级证券投资基金（162412）、子份额华宝医疗A份额（二级市场交易代码：150261）与华宝医疗B份额（二级市场交易代码：150262）。

其中母基金为跟踪中证医疗指数的指数基金，只可申赎，子份额华宝医疗 A 份额与华宝医疗 B 份额只可在二级市场交易，并于 2015 年 6 月 8 日起在深圳证券交易所上市交易。

华宝医疗 A 份额约定年基准收益率为“同期银行人民币一年期定期存款利率（税后）+4.0%”，同期银行人民币一年期定期存款利率（税后）以最近一次发生份额折算的份额折算基准日（包括定期份额折算基准日和不定期份额折算基准日）中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率为准。

基金每 2 份华宝医疗份额所代表的基金资产净值等于 1 份华宝医疗 A 份额和 1 份华宝医疗 B 份额的基金资产净值之和。计算出华宝医疗 A 份额的基金份额参考净值后，根据上述关系，计算出华宝医疗 B 份额的基金份额参考净值。

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

我司股东宝钢集团有限公司为华宝兴业基金的实际控制人，我司与华宝兴业基金构成以股权关系为基础的关联关系。

（二）关联方基本情况

关联方名称：华宝兴业基金管理有限公司

法定代表人：郑安国

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

经营范围：一、在中国境内从事基金管理、发起设立基金；二、中国证监会批准的其他业务。【依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】

三、交易的定价政策及定价依据

（一）定价政策

开放式基金的母基金定价规则为申购当日的基金单位净值，即基金资产净值除以基金单位的总数，其中基金的管理费和托管费每日计提并从基金资产净值中扣除。分级基金的子份额，如本次交易对象华宝医疗 A 份额（二级市场交易代码：150261）与华宝医疗 B 份额（二级市场交易代码：150262）不可单独申购赎回，而是在二级市场竞价交易，交易价格定价反映当时的市场竞价情况。

（二）定价依据

华宝兴业中证医疗指数分级基金 A 份额（二级市场交易代码：150261）为二级市场的分级基金子份额，通过公开市场竞价方式确定价格，择机交易，且 A 份额的交易价格通常不等于交易当时的基金份额净值，即有可能溢价交易也有可能折价交易。

四、交易协议的主要内容

（一）交易价格

1月6日，我司以交易价格1.012元/份场内买入20037份华宝兴业中证医疗指数分级基金A份额（二级市场交易代码：150261），合计支付人民币20277.44元。

1月8日，我司以交易价格1.0183元/份场内买入787472份华宝兴业中证医疗指数分级基金A份额（二级市场交易代码：150261），合计支付人民币801885.05元。

1月13日，我司以交易价格1.02元/份场内买入208600份华宝兴业中证医疗指数分级基金A份额（二级市场交易代码：150261），合计支付人民币212772.00元。

（二）交易结算方式

我司在申购日15:00前将资金转入基金公司指定的基金托管账户。

（三）协议生效条件、生效时间、履行期限

该交易为场内交易，根据交易系统实时完成。

五、交易决策及审议情况

本次投资由我司投资管理部门以投资操作申请的形式发起，按照公司相关投资交易权限，经相关投资决策流程审批通过。

六、其他需要披露的信息

无。

我公司承诺：已充分知晓开展此项交易的责任和风险，并对本公司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，向中国保监会保险资金运用监管部反映。

长江养老保险股份有限公司