国寿安保沪深300指数型证券市场基金更新招募说明书摘要

（2016年第1号）

国寿安保沪深300指数型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据2014年4月8日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于核准国寿安保沪深300指数型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2014]376号）注册和2014年4月24日《关于国寿安保沪深300指数型证券投资基金募集时间安排的确认函》（证券基金机构监管部部函［2014]76号）进行募集。本基金的基金合同于2014年6月5日正式生效。本基金为契约型开放式基金。

重要提示

国寿安保基金管理有限公司保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但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。基金管理人依照格尽职守、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。

本基金的基金合同于2014年6月5日生效。本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股。其中持有的股票资产占基金资产的比例不低于90%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%，本基金持有的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%。

本基金为股票型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，采用完全复制策略，跟踪标的指数市场表现，是股票型基金中处于中等风险水平的基金产品。

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，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、由于投资者连续大量赎回基金份额产生的流动性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等等。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书和基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力、理性判断市场、谨慎做出投资决策。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

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新基金业绩表现的保证。

基金招募说明书自基金合同生效日起，每6个月更新一次，并于每6个月结束之日后的45日内公告，更新内容截至每6个月的最后1日。

本更新招募说明书所载内容截止日为2015年12月4日，有关财务数据和净值表现截止日为2015年9月30日（财务数据未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：国寿安保基金管理有限公司

住所：上海市虹口区丰镇路806号3幢306号

办公地址：北京市西城区金融大街28号院盈泰商务中心2号楼11、12层

法定代表人：刘慧敏

设立日期：2013年10月29日

注册资本：5.88亿元人民币

存续期间：持续经营

客户服务电话：4009-258-258

联系人：耿馨雅

国寿安保基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证监会证监许可[2013]1308号文核准设立。公司股东为中国人寿资产管理有限公司，持有股份85.03%；AMP CAPITAL INVESTORS LIMITED（安保资本投资有限公司），持有股份14.97%。

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

刘慧敏先生，董事长，博士。曾任中国证监会办公室副主任，上海证券交易所副总经理，国泰君安证券公司总裁兼副董事长，中国人寿资产管理有限公司副总裁、总裁；现任中国人寿保险（集团）公司副总裁、中国人寿资产管理有限公司总裁、中国人寿富兰克林资产管理有限公司董事长。

尹兔先生，董事，博士。曾任农业银行总行信贷部乡镇企业处、综合处、信贷二部制度检查处处长、办公室副主任、主任、农业银行广东省分行副行长、行长、农业银行总行资产处置部负责人（正局级），特殊资产经营部总经理（正省行级）等。现任中国人寿资产管理有限公司党委委员、副总裁。

左季庆先生，董事，硕士。曾任中国人寿资金运用中心债券投资部总经理助理，中国人寿资产管理有限公司资产投资部总经理助理、总经理，中国人寿资产管理有限公司固定收益部总经理，并担任中国交易商协会债券专家委员会副主任委员；现任国寿安保基金管理有限公司总经理、国寿财富管理有限公司董事。

叶蕾女士，董事，硕士。曾任中华全国工商业联合会国际联络部副处长；现任澳大利亚安保集团北京代表处首席代表、国寿财富管理有限公司董事。

彭雪峰先生，独立董事，博士。曾任北京市燕山区律师事务所副主任律师，北京市第四律师事务所律师；现任北京大成律师事务所主任、律师。

杨金观先生，独立董事，硕士。曾任中央财经大学教授，会计学院副主任、副院长，学校党总支书记兼副院长；现任中央财经大学教务处处长、会计学教授。

周黎安先生，独立董事，博士。曾任北京大学光华管理学院副教授；现任北京大学光华管理学院应用经济系主任、教授。

2、基金管理人监事会成员

杨建梅先生，监事长，学士。曾任中国人寿保险公司办公室综合处副处长、中国人寿保险（集团）公司办公室总务处处长、中国人寿资产管理有限公司办公室副主任、中国人寿资产管理有限公司监审部副总经理（主持工作）、中国人寿资产管理有限公司纪委副书记、股东代表监事、监审部总经理。现任中国人寿资产管理有限公司纪委副书记、股东代表监事、办公室（党委办公室）主任。

张彬女士，监事，硕士。曾任毕马威华振会计师事务所审计员、助理经理、经理、高级经理及部门负责人；现任国寿安保基金管理有限公司综合管理部助理。

马胜强先生，监事，硕士。曾任中国人寿资产管理有限公司人力资源部助理、业务主办；现任国寿安保基金管理有限公司综合管理部助理。

3、高级管理人员

刘慧敏先生，董事长，博士。简历同上。

左季庆先生，总经理，硕士。简历同上。

申梦玉先生，督察长，硕士。曾任中国人寿保险公司资金运用中心基金投资部副总监，中国人寿资产管理有限公司交易管理部高级经理，中国人寿资产管理有限公司风险管理及合规部副总经理（主持工作）。

4、本基金基金经理

吴坚先生，博士研究生。曾任中国建设银行云南分行副经理，中国人寿资产管理有限公司一级研究员，现任国寿安保沪深300指数型证券投资基金基金经理、国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金、国寿安保智慧生活股票型证券投资基金、国寿安保成长优选股票型证券投资基金、国寿安保稳健增利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

李康先生，博士研究生。曾任中国国际金融有限公司量化投资研究员、长盛基金管理有限公司金融工程研究员，现任国寿安保沪深300指数型证券投资基金基金经理、国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理、国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

左季庆先生：国寿安保基金管理有限公司董事、总经理。

董瑞倩女士：国寿安保基金管理有限公司投资管理部总经理、基金经理。

段辰菊女士：国寿安保基金管理有限公司研究部总经理。

张琦先生：国寿安保基金管理有限公司股票投资部总监。

黄力先生：国寿安保基金管理有限公司基金经理。

吴坚先生：国寿安保基金管理有限公司基金经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。。

二、基金托管人

（一）基金托管人情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座

法定代表人：刘士余

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23号

注册资本：32,479,411.7万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：林慕

（二）主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工140余名，其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家10余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

（1）国寿安保基金管理有限公司直销中心

名称：国寿安保基金管理有限公司

住所：上海市虹口区丰镇路806号3幢306号

法定代表人：刘慧敏

办公地址：北京市西城区金融大街28号院盈泰商务中心2号楼11、12层

客户服务电话：4009-258-258

传真：010-50850777

联系人：孙瑶

（2）国寿安保基金管理有限公司网上直销系统（https://e.gsfunds.com.cn）

2、代销机构

（1）中国农业银行股份有限公司

名称：中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座9层

法定代表人：刘士余

客户服务电话：95599

网址：www.abchina.com

（2）中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：王洪章

联系人：王琳

电话：010-66275654

传真：010-66275654

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

（3）交通银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路188号

办公地址：上海市银城中路188号

法定代表人：牛锦明

联系人：裴学敏

电话：021-58781234

传真：021-58408483

网址：www.bankcomm.com

（4）上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路12号

法定代表人：吉晓辉

联系人：高天、姚磊

电话：021-61618888

传真：021-63604196

客户服务热线：95528

公司网址：www.spdb.com.cn

（5）江苏张家港农村商业银行股份有限公司

注册地址：江苏省张家港市人民中路66号

办公地址：江苏省张家港市人民中路66号

法定代表人：王自忠

联系人：孙瑜

电话：051256968188

传真：051256968259

网址：www.zrcbank.com

（6）申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层

办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层（邮编：200031）

法定代表人：李梅

联系人：钱达深

电话：021-33389888

传真：021-33388224

客户服务电话：95523或4008895523

网址：www.hysec.com

（7）中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：陈有安

联系人：邵海霞

电话：010-66568124

传真：010-66568990

客户服务电话：95551

网址：www.chinastock.com.cn

（8）长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：杨泽柱

联系人：李良

电话：027-65799999

传真：027-85481900

客户服务电话：95579

网址：www.95579.com

（9）中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、8层

办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、8层

法定代表人：黄扬录

联系人：刘军

电话：0755-82943755

传真：0755-82960582

客户服务电话：400-102-2011

网址：www.zszq.com.cn

（10）信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：高冠江

联系人：唐静

电话：010-63081000

传真：010-63080978

客户服务电话：400-800-8899

网址：www.cindasc.com

（11）国海证券股份有限公司

注册地址：广西壮族自治区桂林市辅星路13号

办公地址：广西壮族自治区南宁市滨湖路46号国海大厦

法定代表人：张雅锋

联系人：陈炬华

电话：0755-82047857

传真：0755-82833795

客户服务电话：95563

网址：www.ghzq.com.cn

（12）申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

法定代表人：李季

电话：010-88088858

传真：010-88085195

联系人：李巍

客户服务电话：400-800-0562

网址：www.hysec.com

（13）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路618号

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼

法定代表人：万建华

联系人：芮敏祺

电话：021-38676666

传真：021-38670666

客户服务电话：400-8888-666

网址：www.gtja.com/

(14) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝阳门内大街188号

法定代表人：张佑君

联系人：权唐

电话：010-85130588

传真：010-65182261

客户服务电话：400-888-8108

网址：www.csc108.com

（15）招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座39—45层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座39—45层

法定代表人：宫少林

联系人：林生迎

传真：0755-82943636

电话：0755-82943666

客户服务热线：4008888111、95565

公司网址：www.newone.com.cn

（16）广发证券股份有限公司

注册地址：广州市天河北路183—187号大都会广场43楼

办公地址：广州天河北路大都会广场18、19、36、38、41和42楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

电话：020-87555888

传真：020-87555305

客户服务电话：95575

网址：http://www.gf.com.cn

（17）中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期北座）

法定代表人：王东明

联系人：顾凌

电话：010-60838888

传真：010-60833739

客户服务电话：95548

网址：www.cs.ecitic.com

（18）海通证券股份有限公司

注册地址：上海淮海中路98号

法定代表人：王开国

联系人：李英鸣

电话：021—23219000

传真：021— 23219100

客户服务电话：95553、400—8888—001

网址：www.htsec.com

（19）兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路268号

办公地址：浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼21层

法定代表人：兰荣

联系人：谢高得

电话：021-38565785

传真：021-38565955

客户服务电话：95562

网址：www.xyzq.com.cn

（20）中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层

办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层

法定代表人：杨宝林

联系人：吴忠超

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

客户服务电话：95548

网址：www.citicssd.com

（21）长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人：黄耀华

联系人：龚峰

电话：0755-83516094

传真：0755-83515567

客户服务热线：0755-33680000、4006-666-888

公司网址：www.cgws.com

（22）中泰证券有限公司

注册地址：山东省济南市市中区经七路86号

办公地址：山东省济南市市中区经七路86号

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531-68889155

传真：0531-68889752

客服电话：95538

网址：http://www.zts.com.cn/

（23）中国国际金融有限公司

注册地址：北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

办公地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦27层及28层

法定代表人：金立群

联系人：肖婷

电话：010-65051166

传真：010-65058065

客户服务电话：010-85679238；010-85679169

网址：www.cicc.com.cn

（24）上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层

法定代表人：其实

联系人：丁珊珊

电话：010-65980408-8009

传真：010-65980408-8000

客户服务电话：400-1818-188

网址：http://www.1234567.com.cn

（25）杭州数米基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街文一西路1218号1栋202室

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼

法定代表人：陈柏青

联系人：张裕

电话：021-60897840

传真：0571-26697013

客户服务电话：4000-766-123

网址：http://www.fund123.cn/

（26）浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室

办公地址：浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼

法定代表人：凌顺平

联系人：杨翼

电话：0571-88911818

传真：0571-86800423

客户服务电话：4008-773-772

网址：http://www.ijijin.cn

（27）和讯信息科技有限公司概况

注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层

办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层

法定代表人：王莉

联系人：岳倩倩

电话：010-85650578

传真：021-20835879

客户服务电话：4009-200-022

网址：http:// www.hexun.com

（28）一路财富（北京）信息科技有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702室

办公地址：北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208

法定代表人：吴雪秀

联系人：投京璐

电话：010-88312877

传真：010-88312885

客户服务电话：400-001-1566

网址：www.yilucaifu.com

（29）北京中天嘉华基金销售有限公司

注册地址：北京市石景山区八大处高科技园区西井路3号3号楼7457房间

办公地址：北京市朝阳区京顺路5号曙光大厦C座一层

法定代表人：黄俊辉

联系人：张立新

电话：010-58276999

传真：010-58276998

客户服务电话：400-650-9972

网址：www.5ilicai.cn

（30）上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室

办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903～906室

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

电话：021-20613999

传真：021-68596916

客户服务电话：400-700-9665

网址：www.ehowbuy.com

（31）深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行25层H单元

办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行25层H单元

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

电话：0755-33227950

传真：0755-82080798

客户服务电话：400-678-8887

网址：www.zlfund.cn，www.jjmmw.com

（32）北京展恒基金销售有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号

办公地址：北京市朝阳区华严北里2号民建大厦6层

法定代表人：闫振杰

联系人：韩晓彤

电话：010-62020088-7071

传真：010-62020355

客户服务电话：400-888-6661

网址：www.myfund.com

（33）深圳腾元基金销售有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路2028号卓越世纪中心1号楼1806-1808

办公地址：深圳市福田区金田路2028号卓越世纪中心1号楼1806-1808

法定代表人：曾革

联系人：叶健

电话：0755-33376922

传真：0755-33065516

客服电话：400-687-7899

公司网站：www.tenyuanfund.com

（二）登记机构

名称：国寿安保基金管理有限公司

住所：上海市虹口区丰镇路806号3幢306号

办公地址：北京市西城区金融大街28号院盈泰商务中心2号楼11、12层

法定代表人：刘慧敏

客户服务电话：4009-258-258

传真：010-50850966

联系人：于晓阿

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：安冬

经办律师：安冬、孙睿

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

首席合伙人：吴港平

电话：010-58153000

传真：010-85188298

联系人：黄悦栋

四、基金的名称

国寿安保沪深300指数型证券投资基金

五、基金的类型

股票型

六、基金的投资目标

本基金采用被动式指数化投资策略，通过控制基金组合相对于标的指数的偏离度和跟踪误差，实现对标的指数的有效跟踪，以为投资者带来与指数收益相似的长期回报。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之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。

七、投资范围

本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股。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）、权证、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、央行票据、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、政府支持债券、地方政府债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产，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。

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。

基金的投资组合比例为：本基金持有的股票资产占基金资产的比例不低于90%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%，本基金持有的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%。

八、投资策略

本基金采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况（如市场流动性不足、成份股被限制投资等）导致基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。

1、股票资产指数化投资策略

本基金股票资产投资原则上采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数。通常情况下，本基金根据标的指数成份股票在指数中的权重确定成份股票的买卖数量，并根据标的指数成份股及其权重变动对股票投资组合进行相应调整。在特殊情况下，本基金将选择其它股票或股票组合作为标的指数中的股票加以替换，这些情况包括但不限于以下情形：

（1）法律法规的限制；

（2）标的指数成份股流动性严重不足；

（3）本基金资产规模过大导致本基金持有该股票比例过高；

（4）成份股上市公司存在重大虚假陈述等违规行为、或者面临重大的不利行政处罚或司法诉讼；

（5）有充分而合理的理由认为其市场价格被操纵等。

进行此等替换遵循的原则如下：

（1）优先考虑用以替换的股票与被替换的股票属于同一行业；

（2）替换后，该成份股票所在行业在基金股票资产组合中的权重与标的指数中该行业权重相一致；

（3）用以替换的股票或股票组合与被替换的股票在考查期内日收益率序列风险收益特征高度相关，能较好地代表被替代股票的收益率波动情况。

2、股票指数化投资日常投资组合管理

（1）组合调整原则

本基金为指数型基金，基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制，申购赎回变动情况、新股增发因素等变化，对基金投资组合进行适时调整，以保证基金净值增长率与标的指数间的跟踪误差最小化。

（2）投资组合调整方法

本基金将对标的指数进行定期与不定期的跟踪调整，同时也会结合限制性调整措施对基金资产进行适当调整。

（3）跟踪偏离度的监控与管理

每日跟踪基金组合与标的指数表现的偏离度，定期分析基金的实际组合与标的指数表现的累计偏离度、跟踪误差变化情况及其原因，并优化跟踪偏离度管理方案。

3、债券投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于国债、金融债等期限在一年期以下的债券，保证基金资产流动性，提高基金资产的投资收益。

4、其他金融工具投资策略

在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则运用权证等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以提高投资效率，控制基金投资组合风险水平，更好地实现本基金的投资目标。本基金管理人运用上述金融衍生工具必须是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的，不得应用于投机交易目的，或用作杠杆工具放大基金的投资。

九、基金的业绩比较基准

本基金投资组合的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×95%＋银行活期存款利率（税后）×5%。

沪深300指数是由中证指数有限公司编制，上海证券交易所和深圳证券交易所于2005年4月8日联合发布的反映A股市场整体走势的指数。沪深300指数编制的目标是反映中国证券市场股票价格变动的概貌和运行状况，并能够作为投资业绩的评价标准，为指数化投资和指数衍生产品创新提供基础条件。

如果指数发布机构变更或者停止上述标的指数编制及发布，或者上述标的指数由其它指数代替，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，通过适当的程序变更本基金的标的指数及投资对象，并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。若变更业绩比较基准涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更业绩比较基准召开基金份额持有人大会，并按中国证监会届时有效的有关规定执行。若标的指数变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应在取得基金托管人同意后，报中国证监会备案，并应及时在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。

十、基金的风险收益特征

本基金为股票型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，采用完全复制策略，跟踪标的指数市场表现，是股票型基金中处于中等风险水平的基金产品。

十一、基金的投资组合报告

国寿安保基金管理公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人根据本基金合同规定，复核了本报告中的净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2015年9月30日，本财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	712,501,478.77	92.76
	其中：股票	712,501,478.77	92.76
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中：债券	–	–
	资产支持证券	–	–
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	55,016,392.07	7.16
8	其他各项资产	563,381.89	0.07
9	合计	768,081,252.73	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,732,988.00	0.23
B	采矿业	29,662,821.28	3.87
C	制造业	234,762,245.74	30.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	25,438,139.46	3.32
E	建筑业	31,724,879.79	4.14
F	批发和零售业	15,835,354.00	2.06
G	交通运输、仓储和邮政业	27,765,719.28	3.62
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	37,610,898.99	4.90
J	金融业	248,332,941.45	32.37
K	房地产业	35,139,617.00	4.58
L	租赁和商务服务业	6,882,462.70	0.90
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	5,763,804.00	0.75
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	941,059.08	0.12
R	文化、体育和娱乐业	9,247,124.00	1.21
S	综合	1,661,424.00	0.22
	合计	712,501,478.77	92.89

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	941,400	28,110,204.00	3.66
2	600036	招商银行	1,434,300	25,487,511.00	3.32
3	600016	民生银行	2,568,400	21,702,980.00	2.83
4	600000	浦发银行	972,700	16,176,001.00	2.11
5	601166	兴业银行	993,500	14,465,360.00	1.89
6	601398	工商银行	2,930,724	12,660,727.68	1.65
7	000002	万 科A	843,000	10,731,390.00	1.40
8	601328	交通银行	1,705,700	10,370,656.00	1.35
9	601766	中国中车	796,710	10,333,328.70	1.35
10	600030	中信证券	684,000	9,288,720.00	1.21

3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

无。

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

11、投资组合报告附注

11.1报告期内基金投资的前十名证券的发行主体除中信证券外没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

中信证券于2015年1月19日公告称，因存在为到期融资融券合约展期的问题（根据相关规定，融资融券合约期限最长为6个月），公司被中国证监会采取暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。

11.2 基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

11.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	521,148.75
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	11,232.63
5	应收申购款	31,000.51
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	563,381.89

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十二、基金的业绩

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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

历史各时间段基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2015年1月1日至2015年9月30日	-7.99%	2.41%	-8.61%	2.57%	0.62%	-0.16%
2014年6月5日至2014年12月31日	52.08%	1.13%	61.99%	1.21%	-9.91%	-0.08%
2014年6月5日至2015年9月30日	39.93%	1.99%	48.05%	2.08%	-8.12%	-0.09%

十三、费用概览

（一）与基金运作有关的费用

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、标的指数使用许可费；

4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；

6、基金份额持有人大会费用；

7、基金的证券交易费用；

8、基金的银行汇划费用；

9、证券账户开户费用和银行账户维护费；

10、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。

（二）与基金销售有关的费用

1、申购费用由投资人承担，不列入基金资产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

本基金的申购费率不高于1.0%，随申购金额的增加而递减，适用以下前端收费费率标准：

申购金额（M）	申购费率
M<100万	1.0%
100万≤M<500万	0.6%
M≥500万	按笔收取，1,000元/笔

基金管理人对通过直销中心申购本基金的机构投资者实施优惠申购费率。机构投资者通过本公司直销中心开户并申购本基金，享受认购费率 1 折优惠；申购费率为固定金额的，按原费率执行，不再享有费率折扣。

2、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的25%应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

本基金的赎回费率不高于0.50%，随持有期限的增加而递减。

持有时间（Y）	赎回费率
Y<1年	0.50%
1年≤Y<2年	0.25%
Y≥2年	0

注：就赎回费而言，1年指365天，2年指730天。

3、本基金的申购费率、赎回费率最高不得超过法律法规规定的限额。基金管理人可以在履行相关手续后，在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

4、基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划，定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以对促销活动范围内的投资者调低基金的费率。

（三）基金管理费和托管费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。调低基金管理费率、基金托管费率等相关费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须依照《信息披露办法》的有关规定于新的费率实施前在指定媒体上刊登公告。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，对本基金管理人于2014年4月30日刊登的本基金原招募说明书（《国寿安保沪深300指数型证券投资基金招募说明书》）进行了更新，并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要更新的内容如下：

1、在“第二部分、基金管理人”中，对基金管理人国寿安保基金管理有限公司的基本情况进行了更新；

2、在“第四部分、基金托管人”中，对基金托管人中国农业银行股份有限公司的基本情况及相关业务经营情况进行了更新；

3、在“第五部分、相关服务机构”中，增加了部分代销机构并更新了相关服务机构的内容；

4、在“第八部分、基金份额的申购与赎回”中，更新了申购费率的情况；

5、在“第九部分、基金的投资”中，更新了“十二、基金投资组合报告”，数据内容截止时间为2015年9月30日，财务数据未经审计；

6、更新了“第十部分、基金的业绩”，相关数据内容截止时间为2015年9月30