

国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资

基金更新招募说明书摘要

国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2015 年 3 月 30 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金注册的批复》（证监许可[2015]485 号）注册和 2015 年 4 月 27 日《关于国寿安保中证 500 交易型开放式指数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 [2015]1130 号）进行募集。本基金的基金合同于 2015 年 5 月 29 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。

本基金的基金合同于 2015 年 5 月 29 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。其中投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%。

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2016年5月28日，有关财务数据和净值表现截止日为2016年3月31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。

尹矣先生，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债券投资部总经理助理、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务处处长、会计学院党总支书记兼副院长；现任中央财经大学会计学院教授。

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

杨建海先生，监事长，本科。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、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监察稽核部总经理。

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）；现任国寿安保基金管理有限公司督察长。

封雪梅女士，总经理助理，硕士。曾任中国工商银行股份有限公司经理，大成基金管理有限公司高级经理，信达澳银基金管理有限公司总经理助理兼机构业务总监；现任国寿安保基金管理有限公司总经理助理。

4、本基金基金经理

李康，博士，5年证券基金从业经验。2009年10月至2012年12月，中国国际金融有限公司量化投资研究员。2012年12月至2013年11月，长盛基金管理有限公司金融工程研究员。

2013年11月至今，国寿安保基金管理有限公司投资管理部指数基金经理，现任国寿安保沪深300指数型证券投资基金、国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金

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。

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

成立日期：2009 年 1 月 15 日

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：林葛

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分, 总行设在北京。经国务院批准, 中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡, 成为国内网点最多、业务辐射范围最广, 服务领域最广, 服务对象最多, 业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外, 中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉, 每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行, 中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念, 坚持审慎稳健经营、可持续发展, 立足县域和城市两大市场, 实施差异化竞争策略, 着力打造“伴你成长”服务品牌, 依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品, 致力为广大客户提供优质的金融服务, 与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行, 经验丰富, 服务优质, 业绩突出, 2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计, 并获得无保留意见的 SAS70 审计报告, 表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风

险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在 2010 年首届“‘金牌理财’ TOP10 颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2004 年 9 月更名为托管业务部，内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

（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、剪务能力强，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）基金份额销售机构

1、申购赎回代理券商（简称“一级交易商”）

（1）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

法定代表人：万建华

联系人：芮敏祺

电话：021—38676666

传真：021—38670161

客户服务电话：95521

网址：<http://www.gtja.com/>

(2) 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：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：权唐

电话：010—85130588

传真：010—65182261

客户服务电话：4008888108

网址：<http://www.csc108.com/>

(3) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层
至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层
至二十六层

法定代表人：何如

联系人：周杨

电话：0755—82130833

传真：0755—82133952

客户服务电话：95536

网址：<http://www.guosen.com.cn/>

(4) 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 38—45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：宫少林

联系人：林生迎

电话：0755-82960223

传真：0755—82943636

客户服务电话：4008888111；95565

网址：<http://www.newone.com.cn/>

(5) 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)

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

联系人：顾凌

电话：010—60838888

传真：010—60833739

客户服务电话：95548

网址：<http://www.cs.ecitic.com/>

(6) 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 2—
6 层

法定代表人：陈有安

联系人：田薇

电话：010-66568430

传真：010-66568990

客户服务电话：4008888888

网址：<http://www.chinastock.com.cn/>

(7) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人：王开国

联系人：李笑鸣

电话：4008888001

传真：021-63602722

客户服务电话：95553

网址：<http://www.htsec.com/>

(8) 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

法定代表人：储晓明

联系人：曹晔

电话：021-33389888

传真：021-33388224

客户服务电话：95523 或 4008895523

网址：<http://www.sywg.com/>

(9) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 99 号标力大厦

办公地址：上海市浦东民生路 1199 弄五道口广场 1 号楼 21 层

法定代表人：兰荣

联系人：谢高得

电话：021-38565785

传真：021-38565783

客户服务电话：4008888123

网址：<http://www.xyzq.com.cn/>

(10) 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;4008-888-999

网址：<http://www.95579.com/>

(11) 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 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 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：[http:// www.citicssd.com](http://www.citicssd.com)

(12) 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 23 层

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531-81283938

传真：0531-81283900

客户服务电话：95538

网址：[http://www.zts.com.cn/ /](http://www.zts.com.cn/)

(13) 东吴证券股份有限公司

注册地址：江苏省苏州市翠园路 181 号

办公地址：江苏省苏州市星阳街 5 号

法定代表人：范力

联系人：方晓丹

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

客户服务电话：4008601555

网址：<http://www.dwjq.com.cn>

(14) 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：张志刚

联系人：唐静

电话：010-63080985

传真：010-63080978

客户服务电话：4008008899

网址：<http://www.cindasc.com>

(15) 国海证券股份有限公司

注册地址：广西桂林市辅星路 13 号

办公地址：深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦 3 楼

法定代表人：何春梅

联系人：武斌

电话：0755-83707413

传真：0755-83700205

客户服务电话：4008888100（全国），96100（广西）

网址：<http://www.ghzq.com.cn>

2、二级市场交易代理券商

包括具有经纪业务资格及上海证券交易所会员资格的所有证券公司。

3、基金管理人可根据有关法律法规，选择其他符合要求的机构代理发售本基金，并及时公告。

（二）登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所、办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

联系人：陈文祥

电话：021-68419095

传真：021-68870311

（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

法人代表：毛鞍宁

电话：010-58153000

传真：010-85188298

联系人：郭燕

经办注册会计师：辜虹、郭燕

四、基金的名称国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金

五、基金的类型股票型

六、基金的投资目标紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。七、投资范围本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投

投资于非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、衍生工具（权证等）、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、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、中小企业私募债、证券公司短期公司债券等）、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）。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

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。

八、投资策略本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。

本基金可投资其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如权证

以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具，包括融资融券等。

九、基金的业绩比较基准本基金的业绩比较基准为标的指数。

本基金标的指数为中证 500 指数。

如果指数编制单位变更或停止中证 500 指数的编制、发布或授权，或中证 500 指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致本基金管理人认为中证 500 指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资人合法权益的原则，在按监管部门要求履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。若变更标的指数、业绩比较基准对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。若变更业绩比较基准、标的指数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、标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案。

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基金管理人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 2016 年 3 月 31 日，报告期间为 2016 年 1 月 1 日至 3 月 31 日。本报告财务数据未经审计。

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 408,568,672.05 99.28

其中：股票 408,568,672.05 99.28

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 2,824,429.33 0.69

8 其他资产 123,560.03 0.03
9 合计 411,516,661.41 100.00

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 8,179,590.72 1.99%
B 采矿业 13,910,791.84 3.38%
C 制造业 246,782,730.69 60.05%
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 11,496,082.20 2.80%
E 建筑业 11,683,689.22 2.84%
F 批发和零售业 26,027,735.46 6.33%
G 交通运输、仓储和邮政业 12,080,718.51 2.94%
H 住宿和餐饮业 927,726.67 0.23%
I 信息传输、软件和信息技术服务业 24,018,578.88 5.84%
J 金融业 4,074,390.50 0.99%
K 房地产业 27,081,339.74 6.59%
L 租赁和商务服务业 7,199,349.90 1.75%
M 科学研究和技术服务业 1,777,240.00 0.43%
N 水利、环境和公共设施管理业 3,379,959.50 0.82%
O 居民服务、修理和其他服务业 - -
P 教育 - -
Q 卫生和社会工作 1,192,500.00 0.29%

R 文化、体育和娱乐业 5,518,070.78 1.34%

S 综合 3,238,177.44 0.79%

合计 408,568,672.05 99.41%

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

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	002466	天齐锂业	18,200	3,053,960.00	0.74
---	--------	------	--------	--------------	------

2	002018	华信国际	58,200	2,565,456.00	0.62
---	--------	------	--------	--------------	------

3	600654	中安消	75,500	2,177,420.00	0.53
---	--------	-----	--------	--------------	------

4	600584	长电科技	97,000	2,135,940.00	0.52
---	--------	------	--------	--------------	------

5	600201	生物股份	66,400	2,054,416.00	0.50
---	--------	------	--------	--------------	------

6	600122	宏图高科	104,600	2,031,332.00	0.49
---	--------	------	---------	--------------	------

7	600079	人福医药	104,220	1,938,492.00	0.47
---	--------	------	---------	--------------	------

8	002085	万丰奥威	52,800	1,881,792.00	0.46
---	--------	------	--------	--------------	------

9	002405	四维图新	69,800	1,849,002.00	0.45
---	--------	------	--------	--------------	------

10	000748	长城信息	75,400	1,775,670.00	0.43
----	--------	------	--------	--------------	------

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

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

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。

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	122,757.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	802.21
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	123,560.03

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	流通受限情况 说明
1	002018	华信国际	2,565,456.00	0.62	公告重大事项
2	600654	中安消	2,177,420.00	0.53	公告重大事项
3	600584	长电科技	2,135,940.00	0.52	公告重大事项

4 600122 宏图高科 2,031,332.00 0.49 公告重大事项

5 002405 四维图新 1,849,002.00 0.45 公告重大事项

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。

自基金合同生效开始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：

期间 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

2016/1/1-2016/3/31 -18.84% 3.18% -19.19% 3.25% 0.35% -0.07%

2015/5/29-2015/12/31 -27.71% 3.20% -22.81% 3.30% -4.90% -0.10%

2015/5/29-2016/3/31 -41.32% 3.19% -37.62% 3.28% -3.70% -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、基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议约定的指数使用费；
- 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、基金上市费及年费；
- 10、基金的开户费用、账户维护费用；
- 11、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） 不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

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》、《公开募集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 2015 年 5 月 29 日刊登的本基金原招募说明书（《国寿安保中证 500 交易型开放式指数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“第三部分、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，更新了代销机构与相关服务机构的内容；
- 4、在“第十一部分、基金的投资”中，更新了“九、基金投资组合报告”，数据内容截止时间为 2016 年 3 月 31 日，财务数据未经审计；
- 5、更新了“第十二部分、基金的业绩”，相关数据内容截止时间为 2016 年 3 月 31 日；
- 6、更新了“第二十四部分、其它应披露的事项”，披露了报告

期内我公司在指定信息披露媒体上披露的与本基金相关的所有公告。

国寿安保基金管理有限公司

2016年7月13日