

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

（2019年第2号）

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备案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、备选成份股的投资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,投资者认购(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者基金投资的“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,由投资人自行承担。

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个月的最后一日。

本更新招募说明书所载内容截止日为2019年5月28日,有关财务数据和净值表现截止日为2019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号国融泰商务中心2号楼11、12层
法定代表人:王军辉
设立日期:2013年10月29日
注册资本:12.88亿元人民币
存续期间:持续经营
客户服务电话:4009-258-258
联系人:耿嘉鑫

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85.02%;AMP CAPITAL INVESTORS LIMITED(安保本资本管理有限公司),持有股份14.97%。
（二）主要人员情况
1.基金管理人董事会成员
王军辉先生,董事长,博士。曾任嘉实基金管理有限公司基金经理、总经理助理兼投资部总监、投资决策委员会执行委员,中国人寿资产管理有限公司总裁助理、副总裁,党委书记,国寿投资控股有限公司总裁、党委书记。现任中国人寿保险(集团)公司首席投资官,中国人寿资产管理有限公司总裁、党委书记,国寿安保基金管理有限公司董事长,中国人寿富兰克林资产管理有限公司董事长。

朱子洲先生,董事,本科。曾任中国人寿资金运用中心副总经理,并曾在澳大利亚安联集团(北京)代表处首席代表、中国人寿养老保险股份有限公司董事、国寿财富管理有限公司董事。

李庆夫先生,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长。
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部长;现任澳大利亚安联集团(北京)代表处首席代表、中国人寿养老保险股份有限公司董事、国寿财富管理有限公司董事。
罗琦先生,独立董事,博士。曾任武汉造船专用设备厂助理经济师,华中科技大学管理学院讲师、博士后,武汉大学经济与管理学院金融系副教授。现任武汉大学经济与管理学院金融系教授、博士生导师,《经济评论》副主编,教育部新世纪优秀人才支持计划入选者,南京农商银行独立董事,深圳财富趋势科技股份有限公司独立董事。
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。

李蕾女士,董事,硕士。曾任中国人寿保险(集团)公司办公室主任、国寿养老保险股份有限公司董事、国寿财富管理有限公司董事。

罗琦先生,独立董事,博士。曾任武汉造船专用设备厂助理经济师,华中科技大学管理学院讲师、博士后,武汉大学经济与管理学院金融系副教授。现任武汉大学经济与管理学院金融系教授、博士生导师,《经济评论》副主编,教育部新世纪优秀人才支持计划入选者,南京农商银行独立董事,深圳财富趋势科技股份有限公司独立董事。

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。

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合规管理部总经理。

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、业务专员;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
王军辉先生,董事长,博士。简历同上。
左李庆夫先生,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(集团)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,国寿财富管理有限公司董事。

石伟先生,资产配置总监,学士。曾任兴全基金公司固定收益首席投资官兼固收总监、中国人寿资产管理有限公司固定收益部副总经理(主持工作);现任国寿安保基金管理有限公司资产配置总监及投资管理部二部总经理。

张琦先生,股票投资总监,硕士。曾任中银基金管理有限公司基金经理、基金经理助理;现任国寿安保基金管理有限公司股票投资总监、股票投资部总监及基金经理。

董瑞倩女士,固定收益投资总监,硕士。曾任工银瑞信基金管理有限公司专户投资部基金经理,中银国际证券有限责任公司定息收益部副总经理、执行总经理;现任国寿安保基金管理有限公司固定收益投资总监、投资管理部总经理及基金经理。

王文英女士,总经理助理,硕士。曾任中国人寿保险股份有限公司财务主管,中国人寿资产管理有限公司财务会计经理,国寿安保基金管理有限公司综合管理部副总经理、总经理;现任国寿安保基金管理有限公司总经理助理、综合管理部总经理。

王福新先生,总经理助理,博士后。曾任中国海洋大学教师、大公报国际信评咨询有限公司金融机构部副总经理,中国人民财产保险股份有限公司博士后工作站研究员,中国人寿保险股份有限公司内控合规部高级

主管、投资管理部评估分析处经理、人民币投资管理处高级经理、委托投资管理一处资深经理;现任国寿安保基金管理有限公司总经理助理。

王大勇先生,总经理助理,硕士MBA。曾任华安基金管理有限公司零售业务总部总经理、上海丰佳集团罗马尼亚EVERFRESH公司总经理、巨田证券有限公司客户部职员。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
李旗先生,博士,5年证券投资基金从业经验。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。2015年3月至2018年8月任国寿安保沪深300指数型证券投资基金基金经理,2015年5月起任国寿安保中证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,2018年1月至2019年3月任国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金基金经理,2018年1月起任国寿安保沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2018年8月起任国寿安保沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,2019年4月起任国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金基金经理。

5、投资决策委员会成员
张琦先生:国寿安保基金管理有限公司股票投资总监、股票投资部总监。

董瑞倩女士:国寿安保基金管理有限公司固定收益投资总监、投资管理部总经理。

段辰娟女士:国寿安保基金管理有限公司研究部总经理。

黄力先生:国寿安保基金管理有限公司基金经理。

桑迎迎先生: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:周慕冰
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:贺倩
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日依法设立。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,成为国内资产最大、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,并获准无保留意见的SAS70审计报告。自2010年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准(ISAIE3402)认证,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、内部控制制度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”。2012年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号;2013年至2017年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号;2015年、2016年荣获中国银行业协会授予的“养老业务最佳发展奖”称号;2018年荣获中国基金报授予的公募基金20年“最佳基金托管银行”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,2014年更名为托管业务部/养老金管理中心,内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发及信息技术部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控监管部、账户管理部,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近240名,其中具有高级职称的专家30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）基金托管业务经营情况
截止到2019年3月31日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共440只。

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:中国(上海)自由贸易试验区商城路618号
办公地址:上海市浦东新区商城路618号
法定代表人:杨德红
联系人:芮畅
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:北京市朝阳门内大街188号
法定代表人:王常青
联系人:权唐
电话:010-85130688
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:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45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:霍达
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.cscecitic.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
法定代表人:陈共炎
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
（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:周杰
联系人:李奕鸣
电话:021-23219000
传真:021-63602722
客户服务电话:95553,4008880001
网址:http://www.htsec.com/
（8）申万宏源证券股份有限公司
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:钱琛琛
电话:021-33398988
传真:021-33388224
客户服务电话:95523或400895523
网址:www.swhysc.com
（9）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:上海市浦东新区长柳路36号
法定代表人:吕利刚
联系人:乔琳雪
电话:021-38565547
传真:010-68121816
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:湖北省武汉市新华路特8号长江证券大厦
办公地址:湖北省武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:尤习贵
联系人:李良
电话:027-65799999
传真:027-85481900
客户服务电话:95579或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:张磊
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
（12）中泰证券股份有限公司
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/
（13）东吴证券股份有限公司
注册地址:江苏省苏州工业园区星阳街5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:4008001555
网址:http://www.dwzq.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:010-63081078
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:何春梅
联系人:陈织华
电话:0755-82047857
传真:0755-82835785
客户服务电话:95563
网址:http://www.gzhq.com.cn
（16）珠海华润银行股份有限公司
注册地址:广东省珠海市吉大九州大道东1346号珠海华润银行大厦
办公地址:珠海市吉大九州大道东1346号珠海华润银行大厦
法定代表人:刘聪勇
联系人:陈思远
电话:(86-756) 812-1199/812-1100
传真:(86-756) 812-1118
客户服务电话:4008900338
网址:www.crbank.com.cn/
（17）南京苏宁基金销售有限公司
注册地址:江苏省南京市玄武区苏宁大道1-5号
办公地址:江苏省南京市玄武区苏宁大道1-5号
法定代表人:刘汉青
联系人:冯鹏鹏
电话:025-66969699-881523
传真:025-66008800-889221
客户服务电话:95177
网址:www.snjjin.com/
（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:霍达
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

（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、孙睿
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
执行事务合伙人:毛鞍宁
电话:010-58153000
传真:010-58188298
联系人:范新紫
经办注册会计师:黄悦栋、郭燕、吴军、范新紫、范玉军、夏欣然

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、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法法律法规或监管机构的规定执行。

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,或证券市场有其他替代指数更强、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
基金管理人承诺基金管理人承诺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2019年3月31日,报告期间为2019年1月1日至3月31日。本投资组合报告未经审计。

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	208,111,562.06	99.26
2	其中:股票	208,111,562.06	99.26
3	债券投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
4	其中:中期票据	-	-
5	其中:资产支持证券	-	-
4	金融负债投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,562,000.28	0.74
8	其他资产	7,842.01	0.003
9	合计	209,673,004.34	100.00

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧业	2,022,027.00	0.99
B	采矿业	6,050,319.67	2.92
C	制造业	136,821,402.88	66.81
D	电力、热力、燃气及生产供应业	6,112,500.00	2.93
E	建筑业	3,076,950.03	1.50
F	批发和零售业	10,676,215.99	5.16
G	交通运输、仓储和邮政业	7,081,369.78	3.44
H	住宿和餐饮业	796,266.00	0.38
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,622,472.14	9.98
J	金融业	7,703,802.01	3.69
K	房地产业	11,968,390.02	5.67
L	租赁和商务服务业	3,244,227.81	1.57
M	科学研究和技术服务业	246,150.00	0.12
N	水利、环境和公共设施管理业	1,316,495.60	0.63
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	106,000.00	0.05
Q	卫生和社会工作	1,022,206.40	0.49
R	文化、体育和娱乐业	5,262,464.96	2.54
S	综合	2,963,779.00	1.43
	合计	208,111,562.06	99.26

2.2.报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金本报告期末未投资港股通股票。
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
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。

（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、孙睿
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
执行事务合伙人:毛鞍宁
电话:010-58153000
传真:010-58188298
联系人:范新紫
经办注册会计师:黄悦栋、郭燕、吴军、范新紫、范玉军、夏欣然

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、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法法律法规或监管机构的规定执行。

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,或证券市场有其他替代指数更强、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
基金管理人承诺基金管理人承诺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2019年3月31日,报告期间为2019年1月1日至3月31日。本投资组合报告未经审计。

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	208,111,562.06	99.26
2	其中:股票	208,111,562.06	99.26
3	债券投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
4	其中:中期票据	-	-
5	其中:资产支持证券	-	-
4	金融负债投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,562,000.28	0.74
8	其他资产	7,842.01	0.003
9	合计	209,673,004.34	100.00

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧业	2,022,027.00	0.99
B	采矿业	6,050,319.67	2.92
C	制造业	136,821,402.88	66.81
D	电力、热力、燃气及生产供应业	6,112,500.00	2.93
E	建筑业	3,076,950.03	1.50
F	批发和零售业	10,676,215.99	5.16
G	交通运输、仓储和邮政业	7,081,369.78	3.44
H	住宿和餐饮业	796,266.00	0.38
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,622,472.14	9.98
J	金融业	7,703,802.01	3.69
K	房地产业	11,968,390.02	5.67
L	租赁和商务服务业	3,244,227.81	1.57
M	科学研究和技术服务业	246,150.00	0.12
N	水利、环境和公共设施管理业	1,316,495.60	0.63
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	106,000.	