

# 国寿安保沪深300指数型证券投资基金更新招募说明书摘要

(2015年第2号)

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

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,以投资者带来与指数收益相类似的长期回报。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%,年跟踪误差率不超过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、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,并根据标的指数的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方法构建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投资数量,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债券组合对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) 标的指数的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诉讼;  
(5) 有充分和合理的理由认为其市场价格被操纵等。

进行以下替代替换的原则如下:  
(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察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风险收益波动情况。  
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的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的跟踪误差最小化。

(2) 投资组合调整方式  
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的跟踪偏离度,定期分析基金的实际情况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指数的编制及发布,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指数的指数及投资对象,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和投资标的实质性变更,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,并报中国证监会备案且及时在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。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  
国寿安保基金管理有限公司的董事会及董事对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3月31日,本财务数据未经审计。

1.报告期末基金资产组合情况

		金额单位:人民币元	
序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,895,263,807.00	94.50
其中:股票		1,895,263,807.00	94.50
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	50,030,000.00	2.49
其中:债券		50,030,000.00	2.49
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	57,381,368.14	2.88
8	其他资产	2,369,648.11	0.12
9	合计	2,005,046,825.25	100.00

3.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

		金额单位:人民币元	
序号	股票代码	股票名称	数量(股)
1	601318	中国平安	1,054,100
2	600016	民生银行	5,265,700
3	600000	招商银行	1,529,000
4	600036	招商银行	3,206,000
5	601166	兴业银行	2,220,700
6	600837	海通证券	1,572,000
7	600000	招商银行	2,174,200
8	601398	工商银行	5,512,500
9	000002	万科A	1,884,200
10	601601	中国光大	732,100

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

		金额单位:人民币元	
序号	股票代码	股票名称	数量(股)
1	601318	中国平安	1,054,100
2	600016	民生银行	5,265,700
3	600000	招商银行	1,529,000
4	600036	招商银行	3,206,000
5	601166	兴业银行	2,220,700
6	600837	海通证券	1,572,000
7	600000	招商银行	2,174,200
8	601398	工商银行	5,512,500
9	000002	万科A	1,884,200
10	601601	中国光大	732,100

3.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

		金额单位:人民币元	
序号	股票代码	股票名称	数量(股)
1	601318	中国平安	1,054,100
2	600016	民生银行	5,265,700
3	600000	招商银行	1,529,000
4	600036	招商银行	3,206,000
5	601166	兴业银行	2,220,700
6	600837	海通证券	1,572,000
7	600000	招商银行	2,174,200
8	601398	工商银行	5,512,500
9	000002	万科A	1,884,200
10	601601	中国光大	732,100

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

		金额单位:人民币元	
序号	股票代码	股票名称	数量(股)
1	601318	中国平安	1,054,100
2	600016	民生银行	5,265,700
3	600000	招商银行	1,529,000
4	600036	招商银行	3,206,000
5	601166	兴业银行	2,220,700
6	600837	海通证券	1,572,000
7	600000	招商银行	2,174,200
8	601398	工商银行	5,512,500
9	000002	万科A	1,884,200
10	601601	中国光大	732,100

3.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

		金额单位:人民币元	
序号	股票代码	股票名称	数量(股)
1	601318	中国平安	1,054,100
2	600016	民生银行	5,265,700
3	600000	招商银行	1,529,000
4	600036	招商银行	3,206,000
5	601166	兴业银行	2,220,700
6	600837	海通证券	1,572,000
7	600000	招商银行	2,174,200
8	601398	工商银行	5,512,500
9	000002	万科A	1,884,200
10	601601	中国光大	732,100

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

		金额单位:人民币元	
序号	股票代码	股票名称	数量(股)
1	601318	中国平安	1,054,100
2	600016	民生银行	5,265,700
3	600000	招商银行	1,529,000
4	600036	招商银行	3,206,000
5	601166	兴业银行	2,220,700
6	600837	海通证券	1,572,000
7	600000	招商银行	2,174,200
8	601398	工商银行	5,512,500
9	000002	万科A	1,884,200
10	601601	中国光大	732,100

3.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

		金额单位:人民币元	
序号	股票代码	股票名称	数量(股)
1	601318	中国平安	1,054,100
2	600016	民生银行	5,265,700
3	600000	招商银行	1,529,000
4	600036	招商银行	3,206,000
5	601166	兴业银行	2,220,700
6	600837	海通证券	1,572,000
7	600000	招商银行	2,174,200
8	601398	工商银行	5,512,500
9	000002	万科A	1,884,200
10	601601	中国光大	732,100

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

		金额单位:人民币元	
序号	股票代码	股票名称	数量(股)
1	601318	中国平安	1,054,100
2	600016	民生银行	5,265,700
3	600000	招商银行	1,529,000
4	600036	招商银行	3,206,000
5	601166	兴业银行	2,220,700
6	600837	海通证券	1,572,000
7	600000	招商银行	2,174,200
8	601398	工商银行	5,512,500
9	000002	万科A	1,884,200
10	601601	中国光大	732,100

3.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

		金额单位:人民币元	
序号	股票代码	股票名称	数量(股)
1	601318	中国平安	1,054,100
2	600016	民生银行	5,265,700
3	600000	招商银行	1,529,000
4	600036	招商银行	3,206,000
5	601166	兴业银行	2,220,700
6	600837	海通证券	1,572,000
7	600000	招商银行	2,174,200
8	601398	工商银行	5,512,500
9	000002	万科A	1,884,200
10	601601	中国光大	732,100

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

		金额单位:人民币元	
序号	股票代码	股票名称	数量(股)
1	601318	中国平安	1,054,100
2	600016	民生银行	5,265,700
3	600000	招商银行	1,529,000
4	600036	招商银行	3,206,000
5	601166	兴业银行	2,220,700
6	600837	海通证券	1,572,000
7	600000	招商银行	2,174,200
8	601398	工商银行	5,512,500
9	000002	万科A	1,884,200
10	601601	中国光大	732,100

3.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

		金额单位:人民币元	
序号	股票代码	股票名称	数量(股)
1	601318	中国平安	1,054,100
2	600016	民生银行	5,265,700
3	600000	招商银行	1,529,000
4	600036	招商银行	3,206,000
5	601166	兴业银行	2,220,700
6	600837	海通证券	1,572,000
7	600000	招商银行	2,174,200
8	601398	工商银行	5,512,500
9	000002	万科A	1,884,200
10	601601	中国光大	732,100

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

		金额单位:人民币元	
序号	股票代码	股票名称	数量(股)
1	601318	中国平安	1,054,100
2	600016	民生银行	5,265,700
3	600000	招商银行	1,529,000
4	600036	招商银行	3,206,000
5	601166	兴业银行	2,220,700
6	600837	海通证券	1,572,000
7	600000	招商银行	2,174,200
8	601398	工商银行	5,512,500
9	000002	万科A	1,884,200
10	601601	中国光大	732,100

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:蒋超良  
客户服务电话:95659  
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:牛锡明  
联系人:姜成敏  
电话:021-58781234  
传真:021-58409483  
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、姚嘉  
电话:021-61618888  
传真:021-63604196  
客户服务电话:95628  
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:05126968188  
传真:05126968259  
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:钱琛琛  
电话:021-33389888  
传真:021-33388224  
客户服务电话:956213或4008956523  
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:010-66568900  
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:杨泽华  
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大厦7层、  
办公地址:深圳市南山区科技中一路西华强高新大厦7层、

2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

(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:陈兆雄  
联系人:陈张华  
电话:0755-82047857  
传真:0755-82835785  
客户服务电话:95563  
网址:www.gqhzq.com.cn

(12) 申万宏源证券有限公司  
注册地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29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:唐静  
电话:010-85130588  
传真:010-85162261  
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  
电话:0755-82943636  
电话:0755-82943666  
客户服务电话:4008881111,95565  
公司网址:www.newone.com.cn

(16) 广发证券股份有限公司  
注册地址:广州市天河区河北路183-187号大都会广场43楼  
办公地址:广州天河区路大都会广场18,19,36,38,41和42楼  
法定代表人:孙树明  
联系人:黄良  
电话