

上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金

[2012] 第三季度报告

基金管理人：国联安基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一二年十月二十五日

基金经理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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等数据，保证复核结果不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金经理的过往业绩并不代表其未来表现。投资人对基金的投资决策须自行阅读该基金的招募说明书。

本报告期自2012年7月1日起至9月30日止。

§ 6.2 基金产品概况

基金简称 上证大宗商品ETF

基金主代码 510170

交易代码 510170

基金运作方式 灵活配置型开放式

报告期末基金资产总额 309,228.71万元

报告期末基金份额总额 1,182,182,525.05份

投资目标 通过对商品类别的跟踪,追求跟踪误差和跟踪误差最小化,努力实现与标的指数相似的长期投资回报。

投资策略 本基金将采用完全复制法的指数化方法跟踪标的指数。通常情况下,本基金按照标的指数的构成比例构建基金总资产组合,并根据标的指数成分股及其权重的变化定期调整组合,以期在扣除交易成本后,使基金的净值增长率与标的指数的净值增长率尽可能地一致(不高于±2‰,即跟踪误差不超过±2‰)。如果指数编制机构或指数提供商因编制制度或规则的变更导致本基金的跟踪误差可能超过上述范围,基金管理人将根据实际情况,适时调整本基金的跟踪策略,以降低跟踪误差。

风险收益特征 本基金为股票型基金,其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

基金经理的过往业绩 本基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资人对基金的投资决策须自行阅读该基金的招募说明书。

基金的管理费 不代表其未来表现。投资人对基金的投资决策须自行阅读该基金的招募说明书。

本报告期自2012年7月1日起至9月30日止。

§ 6.3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年7月1日-2012年9月30日)

1.本期已实现收益 -72,337,355.78

2.本期利润 -14,600,832.45

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0293

4.期末基金资产净值 1,180,976,163.25

5.期末基金份额净值 2,190

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益减去费用后的余额,即本期利润=本期已实现收益+本期公允价值变动收益-本期费用;2.期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中表述的可供分配利润的孰低数,即未分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中表述的可供分配利润的孰低数减去提取盈余公积和应付普通股股利后的余额,该金额为期末可供分配利润;3.本基金的业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计算费用后实际收益要低于所列数字。

3.2 基金净值

3.3 期末基金资产配置情况及其占比

3.4 期末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

3.5 期末基金份额净值增长率和标准差

3.6 期末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

3.7 期末基金份额净值增长率和标准差

3.8 期末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

3.9 期末基金份额净值增长率和标准差

3.10 期末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

3.11 期末基金份额净值增长率和标准差

3.12 期末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

3.13 期末基金份额净值增长率和标准差

3.14 期末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

3.15 期末基金份额净值增长率和标准差

3.16 期末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

3.17 期末基金份额净值增长率和标准差

3.18 期末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

3.19 期末基金份额净值增长率和标准差

3.20 期末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

3.21 期末基金份额净值增长率和标准差

3.22 期末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

3.23 期末基金份额净值增长率和标准差

3.24 期末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

3.25 期末基金份额净值增长率和标准差

3.26 期末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

3.27 期末基金份额净值增长率和标准差

3.28 期末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

3.29 期末基金份额净值增长率和标准差

3.30 期末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

3.31 期末基金份额净值增长率和标准差

3.32 期末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

3.33 期末基金份额净值增长率和标准差

3.34 期末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

3.35 期末基金份额净值增长率和标准差

3.36 期末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

3.37 期末基金份额净值增长率和标准差

3.38 期末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

3.39 期末基金份额净值增长率和标准差

3.40 期末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

3.41 期末基金份额净值增长率和标准差

3.42 期末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

3.43 期末基金份额净值增长率和标准差

3.44 期末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

3.45 期末基金份额净值增长率和标准差

3.46 期末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

3.47 期末基金份额净值增长率和标准差

3.48 期末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

3.49 期末基金份额净值增长率和标准差

3.50 期末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

3.51 期末基金份额净值增长率和标准差

3.52 期末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

3.53 期末基金份额净值增长率和标准差

3.54 期末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

3.55 期末基金份额净值增长率和标准差

3.56 期末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

3.57 期末基金份额净值增长率和标准差

3.58 期末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

3.59 期末基金份额净值增长率和标准差

3.60 期末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

3.61 期末基金份额净值增长率和标准差

3.62 期末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

3.63 期末基金份额净值增长率和标准差

3.64 期末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

3.65 期末基金份额净值增长率和标准差

3.66 期末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

3.67 期末基金份额净值增长率和标准差

3.68 期末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

3.69 期末基金份额净值增长率和标准差

3.70 期末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

3.71 期末基金份额净值增长率和标准差

3.72 期末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

3.73 期末基金份额净值增长率和标准差

3.74 期末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

3.75 期末基金份额净值增长率和标准差

3.76 期末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

3.77 期末基金份额净值增长率和标准差

3.78 期末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

3.79 期末基金份额净值增长率和标准差

3.80 期末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

3.81 期末基金份额净值增长率和标准差

3.82 期末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

3.83 期末基金份额净值增长率和标准差

3.84 期末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

3.85 期末基金份额净值增长率和标准差

3.86 期末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

3.87 期末基金份额净值增长率和标准差

3.88 期末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

3.89 期末基金份额净值增长率和标准差

3.90 期末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

3.91 期末基金份额净值增长率和标准差

3.92 期末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

3.93 期末基金份额净值增长率和标准差

3.94 期末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

3.95 期末基金份额净值增长率和标准差

3.96 期末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

3.97 期末基金份额净值增长率和标准差

3.98 期末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

3.99 期末基金份额净值增长率和标准差

3.10 期末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

3.11 期末基金份额净值增长率和标准差

3.12 期末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

3.13 期末基金份额净值增长率和标准差

3.14 期末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

3.15 期末基金份额净值增长率和标准差

3.16 期末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

3.17 期末基金份额净值增长率和标准差

3.18 期末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

3.19 期末基金份额净值增长率和标准差

3.20 期末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

3.21 期末基金份额净值增长率和标准差

3.22 期末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

3.23 期末基金份额净值增长率和标准差

3.24 期末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

3.25 期末基金份额净值增长率和标准差

3.26 期末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

3.27 期末基金份额净值增长率和标准差

3.28 期末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

3.29 期末基金份额净值增长率和标准差

3.30 期末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

3.31 期末基金份额净值增长率和标准差

3.32 期末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

3.33 期末基金份额净值增长率和标准差

3.34 期末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

3.35 期末基金份额净值增长率和标准差

3.36 期末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

3.37 期末基金份额净值增长率和标准差

3.38 期末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

3.39 期末基金份额净值增长率和标准差

3.40 期末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

3.41 期末基金份额净值增长率和标准差

3.42 期末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

3.43 期末基金份额净值增长率和标准差

3.44 期末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

3.45 期末基金份额净值增长率和标准差

3.46 期末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

3.47 期末基金份额净值增长率和标准差

3.48 期末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

3.49 期末基金份额净值增长率和标准差

3.50 期末