

## 上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金

## [2013] 第二季度报告

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:二〇一三年七月十八日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事局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2013年7月16日复权了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告内容,保证复权后的净值不存在虚假记载,误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

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

本报告期财务数据未经审计。

本报告期自2013年4月1日起至6月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金名称:国联安上证商品ETF

基金代码:510170

交易场所:上海证券交易所

契约型开放式

基金合同生效日:2010年11月26日

报告期末基金份额总额:258,728,711.00

报告期末基金份额净值:0.934

基金简称:国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金

投资目标:紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,努力实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。

投资策略:本基金主要采用完全复制的指数化跟踪策略,通过复制标的指数的成分股权重和权重变动来实现跟踪,但特殊情况下,本基金可以选择其他指数成分股或组合的替代品加以替换,这将导致本基金的跟踪偏离度和跟踪误差超过1.5%的限制。本基金将根据标的指数的成分股变动情况,对标的指数的成分股进行定期或不定期的调整,并根据标的指数的成分股变动情况,对标的指数的成分股进行定期或不定期的调整,以确保本基金的跟踪偏离度和跟踪误差不超过2.0%。如果因指数规则调整或本基金的调整,导致本基金的跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人将采取合理的措施避免跟踪偏离度和跟踪误差进一步扩大。

2. 债券投资策略

基于对宏观经济的判断,本基金可以投资于国债、央票、金融债等期限在一年以下的债券,债券的久期与本基金的流动性相匹配,并根据本基金的流动性需求,适时调整债券的久期。

3. 股票投资策略

本基金将根据标的指数的成分股的行业分布,以期保值为目的,主要选择波动较小、交易活跃的指数成分股。本基金力图利用指定期权的杠杆作用,降低股票仓位调整带来的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

4. 其他投资策略

本基金将根据标的指数的成分股的品种、风格及风险收益特征,充分了解指数成分股的品种和各种风格,以审慎的态度参与指数期货及其他衍生品的交易。

5. 基金份额净值的计算

上证大宗商品股票指数

风险收益特征:本基金为股票型基金,风险收益特征与股票市场相拟合,风险收益特征较高,预期收益较高的品种。

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

注:本表所列的基金代码510170为本基金二级市场交易代码,本基金一级市场申购赎回代码为510171。

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年4月1日-2013年6月30日)

1.本期已实现收益 -61,561,678.98

2.本期利润 -146,458,915.70

3.加权平均基金份额本期利润 -0.4556

4.期末基金资产净值 392,875,637.83

5.期末基金份额净值 0.934

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,包含停牌股票按公允价值调整的差额。

2.上述基金业绩指标不包括持有人现金分红的金额,预测收益不高于实际收益。

3.2.1 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金

累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势图对比如图

2010年11月26日至2013年6月30日

注:1.本基金业绩比较基准为上证大宗商品股票指数;

2.本基金合同于2010年11月26日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起6个月,建仓期结束时各项资产配置符合合同约定。

## § 4 管理人报告

4.1 基金经理或基金经理助理简介

姓名 职务 任职日期 离任日期 说明

黄欣 本基金基金经理,金融工程与风险管理硕士,中国银行总行金融市场部交易员,2003年10月加入国联安基金管理有限公司,历任产品经理、高级产品经理,2009年1月加入国联安基金管理有限公司,2010年4月加入国联安基金管理有限公司,2010年5月加入国联安基金管理有限公司,2010年12月起担任国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2011年6月起担任国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金(LOF)基金经理,2012年1月起担任国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金(LOF)基金经理,2013年4月起担任国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

注:1.基金合同生效日、基金经理的任职日期和离任日期均以公司对外公告日为准;

2.对基金业绩影响较大的基金经理变动日期以公司公告为准;

4.2 管理人对报告期内基金运作的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《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》及其他相关法律法规、法律、行政法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金,在严格控制风险的前提下,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金运作管理完全符合有关法律法规和基金合同的规定和约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 平等交易制度的执行情况

本基金严格按照相关法律法规、内部规章制度制定并完善了《国联安基金管理有限公司公平交易制度》(以下简称“公平交易制度”),用以规范包括投资授权、研究分析、投资决策、交易执行以及投资管理等在内的公平交易行为。

4.3.2 报告期内本基金不存在不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内本基金的公平交易策略运作分析

报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金公平交易制度》,在公平交易制度的框架内,对不同投资组合公平对待,使各投资组合获得的投资机会基本相同,不存在利益输送和不公平交易行为。

4.5 公平交易制度的执行情况

从上证商品指数的各个板块表现来看,第二季度石油石化等行业表现相对较好,煤炭、黄金等行业表现相对较差。本基金根据基金合同的约定,保持在相当比例的仓位,并以完全复制的方式跟踪上证商品指数,将跟踪误差控制在合理范围。

4.5.报告期内基金的业绩表现

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,包含停牌股票按公允价值调整的差额。

2.上述基金业绩指标不包括持有人现金分红的金额,预测收益不高于实际收益。

3.2.1 本基金报告期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

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势图对比如图

2010年6月28日至2013年6月30日

注:1.本基金业绩比较基准为上证大宗商品股票指数;

2.本基金合同于2010年6月28日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起6个月,建仓期结束时各项资产配置符合合同约定。

## § 5 管理人报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年4月1日-2013年6月30日)

1.本期已实现收益 3,254,381.48

2.本期利润 -16,060,642.00

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0578

4.期末基金资产净值 249,413,535.94

5.期末基金份额净值 0.934

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,包含停牌股票按公允价值调整的差额。

2.上述基金业绩指标不包括持有人现金分红的金额,预测收益不高于实际收益。

3.2.1 本基金报告期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

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势图对比如图

2010年6月28日至2013年6月30日

注:1.本基金业绩比较基准为上证大宗商品股票指数;

2.本基金合同于2010年6月28日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起6个月,建仓期结束时各项资产配置符合合同约定。

## § 6 备查文件目录

1.中国证监会批准基金募集的文件

2.《国联安上证商品ETF基金合同》

3.《国联安上证商品ETF基金招募说明书》

4.《国联安上证商品ETF基金托管协议》

5.基金管理人业务资格批件和营业执照

6.基金业协会登记备案证明

7.中国证监会要求的其他文件

7.2.存放地点

上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼

7.3.查阅方式

网址:www.gta-allianz.com或www.ip-funds.com

国联安基金管理有限公司

二〇一三年七月十八日

国联安基金管理有限公司

报告送出日期:二〇一三年七月十八日

§ 7 备查文件

1.中国证监会批准基金募集的文件

2.《国联安上证商品ETF基金合同》

3.《国联安上证商品ETF基金托管协议》

4.《国联安上证商品ETF基金招募说明书》

5.基金管理人业务资格批件和营业执照

6.基金业协会登记备案证明

7.中国证监会要求的其他文件

7.2.存放地点

广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

7.3.查阅方式

网址:www.gta-allianz.com或www.vip-funds.com

国联安基金管理有限公司

二〇一三年七月十八日

§ 8 备查文件

1.中国证监会批准基金募集的文件

2.《国联安上证商品ETF基金合同》

3.《国联安上证商品ETF基金托管协议》

4.《国联安上证商品ETF基金招募说明书》

5.基金管理人业务资格批件和营业执照

6.基金业协会登记备案证明

7.中国证监会要求的其他文件

7.2.存放地点

广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

7.3.查阅方式

网址:www.gta-allianz.com或www.vip-funds.com

国联安基金管理有限公司

二〇一三年七月十八日

§ 9 备查文件

1.中国证监会批准基金募集的文件

2.《国联安上证商品ETF基金合同》

3.《国联安上证商品ETF基金托管协议》

4.《国联安上证商品ETF基金招募说明书》

5.基金管理人业务资格批件和营业执照

6.基金业协会登记备案证明

7.中国证监会要求的其他文件

7.2.存放地点

广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

7.3.查阅方式

网址:www.gta-allianz.com或www.vip-funds.com

国联安基金管理有限公司

二〇一三年七月十八日

§ 10 备查文件

1.中国证监会批准基金募集的文件

2.《国联安上证商品ETF基金合同》

3.《国联安上证商品ETF基金托管协议》

4.《国联安上证商品ETF基金招募说明书》

5.基金管理人业务资格批件和营业执照

6.基金业协会登记备案证明

7.中国证监会要求的其他文件

7.2.存放地点

广州市海珠区琶洲