

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:二〇一四年八月二十九日

1.1 重要提示

本基金的基金管理人、董事会、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,并对基金的真实性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字并由董事长签署。

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2014年8月27日复核了本报告中的财务报表、净值表现、财务分析、风险分析、收益分配政策、投资组合报告等内容,保证复核的内容不存在虚假记载、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。

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

本年度报告所载数据自半年度报告正式公告之日起至半年度报告期末,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称:国联安上证商品ETF

基金简称:国联安上证商品ETF

基金代码:510701

交易代码:510707

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2010年11月26日

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

报告期末基金资产总额:196,228,711.71份

基金份额净值:不适用

基金资产净值:上海市证交易所

上市日期:2011年6月26日

2.2 基金产品说明

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。

1. 投资策略:

本基金将主要采用完全复制法的指数跟踪法的指数化投资。通常情况下,本基金将按照标的指数的构成及其权重,通过一级市场或二级市场买入股票,并根据标的指数的变动进行相应的调整,但特殊情况下,本基金将根据实际情况,通过现金、股票、债券、货币市场工具等资产的配置,在严格控制跟踪误差的前提下,对标的指数进行适当的调整。

本基金将通过定期和不定期的指数成分股的调整,对标的指数进行定期和不定期的调整。

(1)定期调整:定期对标的指数的构成股进行定期调整。

(2)不定期调整:当标的指数成份股发生变动时,根据调整方案,对标的指数进行相应的调整。

导致本基金投资于标的指数的成分股的资产比例限制。

3. 投资范围:

本基金主要投资于标的指数的成份股,以及可能被调入成份股的股票和可能被剔除的股票。

本基金将根据标的指数的构成,在可能的情况下,投资于标的指数的成份股,以及可能被调入成份股的股票和可能被剔除的股票。

4. 投资限制:

本基金在任何交易日买入权证的金额,不得超过基金资产净值的1%。

本基金在任何交易日买入股票的金额,不得超过基金资产净值的10%。

本基金在任何交易日买入权证的金额,不得超过基金资产净值的1%。

本基金在任何交易日买入股票的金额,不得超过基金资产净值的10%。

本基金在任何交易日买入股票的金额,