

上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	140,467,103.66	99.39
	其中:股票	140,467,103.66	99.39
2	固定收益投资	--	--
	其中:债券	--	--
	资产支持证券	--	--
3	货币类投资	--	--
4	金融衍生品投资	--	--
5	买入返售金融资产	--	--
	其中:买入返售的买入逆回购金融资产	--	--
6	银行承兑汇票及支付合计	916,500.00	0.01
7	其他类资产	276.00	0.00
8	合计	140,384,482.64	100.00

注：上述权益投资股票项投资金额包含可退替代款估值增值。			
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合			
5.2.1 指数投资按行业分类的股票投资组合			
序号	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,037,000.59	1.21
B	采矿业	76,400,633.17	52.59

C	制造业	64,543,819.20	43.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	--	--
E	建筑业	--	--
F	批发和零售业	2,235,790.60	1.50
G	交通运输、仓储和邮政业	--	--
H	住宿和餐饮业	--	--

I	信息传输、软件和信息技术服务业	--	--
J	金融业	--	--
K	房地产业	--	--
L	租赁和商务服务业	--	--
M	科学研究和技术服务业	--	--
N	水利、环境和公共设施管理业	--	--

O	居民服务、修理和其他服务业	--	--
P	教育	--	--
Q	卫生和社会工作	--	--
R	文化、体育和娱乐业	--	--
S	综合	1,480,016.00	0.00
	合计	140,467,900.56	99.50

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601019	中国神华	434,729	8,417,437.60	5.66

2	600028	中国石化	1,381,781	7,031,422.94	5.32
3	601857	中国石油	971,392	7,644,855.04	5.13
4	601899	紫金矿业	2,120,193	7,166,252.34	4.91
5	601600	中国铝业	1,459,811	6,789,121.15	4.55
6	600309	万华化学	241,200	6,538,932.00	4.39
7	600547	山东黄金	166,874	5,899,191.72	3.95

8	600111	北方稀土	483,985	5,961,068.36	3.03
9	600489	中金黄金	383,094	4,489,961.68	3.01
10	600157	永泰能源	1,103,504	4,369,675.04	2.93

5.3.2 期末股权投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股权投资股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。

5.7 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。

5.8 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贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.9 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。

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货，没有相关投资政策。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货,没有相关投资政策。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货,没有相关投资评价。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内,经查询上海证券交易所、深圳证券交易所等机构公开信息披露平台,以及经核实托管人提供的报告期内基金投资前十名证券发行主体无涉及被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5254
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	22250
5	应收账款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	276.04
5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明 本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。 5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明 本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。		

§ 6 开放式基金份额变动		单位:份
本报告期初基金份额总额		86,228,711.00
报告期基金总申购份额		-
减:报告期基金总赎回份额		2,500,000.00
报告期基金净变动份额		-

本报告期末基金份额总额	83,728,711.00									
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 本报告期内,本基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金。 §8影响投资者决策的其他重要信息										
8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况										
<table> <tr> <th data-bbox="1614 1642 1684 1642">投资者类别</th><th data-bbox="1684 1642 1833 1642">报告期内持有基金份额变化情况</th><th data-bbox="1833 1642 2003 1642">报告期末持有基金份额</th></tr> <tr> <th data-bbox="1614 1642 1684 1645">序号</th><th data-bbox="1684 1642 1833 1645">持有基金份额比例达到或超过20%的区间内</th><th data-bbox="1833 1642 2003 1645">期初份额 申购份额 赎回份额 持有份额 份额占比</th></tr> <tr> <td></td><td></td><td></td></tr> </table>		投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金份额	序号	持有基金份额比例达到或超过20%的区间内	期初份额 申购份额 赎回份额 持有份额 份额占比			
投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金份额								
序号	持有基金份额比例达到或超过20%的区间内	期初份额 申购份额 赎回份额 持有份额 份额占比								

[illegible]

(2) 基金规模较小的情况下，可能因基金资产净值较小，可能对基金资产的流动性造成较大影响。

(3) 机构投资者赎回时，可能导致基金规模较小，从而使基金经理及运作管理的难度增加。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准《上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金》发行及募集的文件

2、《上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

3、《上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》

4、《上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

5、基金管理人业务资格批件和营业执照

6、基金托管人业务资格批件和营业执照

7、中国证监会要求的其他文件

92 存放地点

中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼

93 查阅方式

网站: <http://www.gtiq.com>

网址: www.gdmmfz.com

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	601088	中国神华	500	9,680.00	0.01
2	600028	中国石化	1,600	9,184.00	0.01
3	601857	中国石油	1,100	8,657.00	0.01
4	600300	华鲁化学	300	8,133.00	0.01
5	603580	金能化学	3,400	8,113.00	0.03

6	600189	美丰纸业	6,116,000	0,116,000	0.01
6	600673	东阳光科	1,100	8,019,000	0.01
7	601600	中国铝业	1,700	7,906,000	0.01
8	600111	北方稀土	600	7,269,000	0.01
9	600547	山东黄金	200	7,156,000	0.01
10	600489	中金黄金	500	5,860,000	0.00

本基金本报告期末未持有债券。
5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。
5.7 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。
5.8 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贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属投资。
5.9 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

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货。
5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末未持有股指期货，没有相关投资政策。
5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 本期国债期货投资政策
本基金本报告期末未持有国债期货,没有相关投资政策。
5.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。
5.11.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货,没有相关投资评价。
5.12 投资组合报告附注
5.12.1 报告期内,经查询上海证券交易所、深圳证券交易所等机构公开信息披露平台,以及经核实托管

人提供的信息,本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查,或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.12.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.12.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	084.04
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	1,743.96
5	应收申购款	118,226.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	120,966.24
---	----	------------

5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
 本期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600673	东方阳光	8,019.00	0.01	重大事项

§ 6 开放式基金份额变动		单位:份
本报告期初基金份额总额		233,892,970.16
报告期基金总申购份额		5,853,702.00
减:报告期基金总赎回份额		12,826,020.59
本报告期基金总申购份额		-

注：总申购份额包含本报告期内发生的转换入和红利再投资份额；总赎回份额包含本报告期内发生的转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准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联接基金发行及募集的文

2、《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联接基金基金合同》
3、《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联接基金招募说明书》
4、《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联接基金托管协议》
5、基金管理人业务资格批件和营业执照
6、基金托管人业务资格批件和营业执照
7、中国证监会要求的其他文件
9.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼
833查阅方式
网址：www.gtja-allianz.com

国联安基金管理有限公司
二〇一七年四月二十二日