

2017年12月31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
报告送出日期:二〇一八年一月二十日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会在报告期间所获得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2018年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

本报告期自2017年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金产品概况

基金名称 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

基金代码 510170

基金运作方式 灵活配置型开放式基金

基金份额发售日 2010年12月4日

报告期基金份额总额 188,925,183.01份

资产规模 188,925,183.01元

投资目标 本基金通过投资于上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标ETF”)来实现其投资目标。本基金主要通过投资于目标ETF来实现对大宗商品股票的间接投资，同时通过现金头寸、股票仓位调整、分红派息、申购赎回等操作，力争实现对目标ETF净值的跟踪误差降低。

业绩比较基准 99%以上的大商品股票指数+ETF的管理费+银行存款利率(税后)

报告期费率 货币市场基金赎回费率：0.50%

基金管理费 0.50%/年

基金托管费 0.10%/年

其他费用 0.00元/年

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称 上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金

基金代码 510170

基金运作方式 交易型开放式(LOF)

基金份额发售日 2010年11月26日

上市交易地 上海证券交易所

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

报告期基金份额总额 69,728,711.00份

报告期金额 10.0170元/份

报告期净值 1.00170元/份

报告期份额净增减量 -305,983份

报告期金额净增减量 -305.983元

报告期类别 主动管理型

报告期投资风格 价值型

报告期投资策略 价值型

报告期投资主题 价值型

报告期投资范围 价值型

报告期投资工具 价值