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(更新)摘要

（2018年第1号）

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

【重要提示】

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（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会2010年10月12日证监许可 [2010]1394号文核准募集。本基金基金合同于2010年12月1日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益；因基金份额净值可升可跌，基金份额持有人赎回基金份额时，所得或会高于或低于能全数取回其原本投资。本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资者在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。

投资本基金可能遇到的风险包括：因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，本基金投资债券引发的信用风险，以及本基金投资策略所特有的风险等等。本基金为目标ETF的联接基金，通过投资目标ETF紧密跟踪上证大宗商品股票指数的表现，与目标ETF在投资方法、交易方式等方面存在着联系和区别。

本基金具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于混合基金、债券型基金和货币市场基金。

投资有风险，投资者在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。基金的过往业绩并不代表其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成本基金业绩表现的保证。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益；因基金份额净值及交易价格可升可跌，基金份额持有人赎回或卖出基金份额时，所得或会高于或低于其原本投资。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本招募说明书（更新）摘要所载内容截止日为2017年12月1日，有关财务数据和净值表现截止日为2017年9月30日（所载财务数据未经审计）。

一、基金合同生效日期：2010年12月1日

二、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：国联安基金管理有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼
法定代表人：庹启斌
成立日期：2003年4月3日
批准设立机关：中国证券监督管理委员会
批准设立文号：证监基金字[2003]42号
组织形式：有限责任公司
注册资本：1.5亿元人民币
存续期限：五十年或股东一致同意延长的其他期限
电话：021-38992888
联系人：茅斐
股权结构：

股东名称	持股比例
国泰君安证券股份有限公司	51%
德国安联集团	49%

（二）主要人员情况

1、现任董事会成员

庹启斌先生，董事长，经济学博士。历任华东师范大学国际金融系讲师、君安证券有限公司万航渡路营业部经理、资产管理公司研究部经理、香港公司研究策划部经理、研究发展中心主任、经纪管理部总经理、债券部总经理、副总裁、国泰君安证券股份有限公司副总裁。现任国联安基金管理有限公司董事长。

孟朝霞女士，公司总经理，硕士学位。历任新华人寿保险股份有限公司企业年金管理中心总经理、泰康养老保险股份有限公司副总经理、富国基金管理有限公司副总经理、融通基金管理有限公司总经理。现任国联安基金管理有限公司总经理。

Jiachen Fu（付佳晨）女士，董事，工商管理学士。2007年起进入金融行业，历任安联集团董事会事务主任、安联全球车险驻中国业务发展主管兼创始人、忠利保险公司内部顾问、戴姆勒东北亚投资有限公司金融及监控部成员、美国克赖斯勒汽车集团市场推广及销售部学员。现任安联资产管理公司驻中国业务董事兼业务拓展总监、管理董事会成员。

Eugen Loeffler先生，董事，经济与政治学博士。2017年3月底退休前，担任安联投资管理新加坡公司行政总裁/投资总监，负责监督安联亚洲保险实体的投资管理事务。1990年起进入金融行业，他历任安联全球投资韩国公司董事总经理/投资主管、安联全球投资亚太区投资总监、安联苏黎世公司投资总监、安联苏黎世房地产及安联资产管理苏黎世公司行政总裁、安联投资管理公司环球股票团队主管、安联全球投资韩国公司主席及行政总裁、安联人寿韩国公司投资总监、安联资产管理香港办事处投资总监兼主管、安联资产管理欧洲股票研究部主管、安联慕尼黑总部财务部工作（股票／长期参与计划投资管理）。

汪卫杰先生，董事，经济学硕士，会计师职称。1994年起进入金融行业，历任君安证券有限责任公司财务部主管、稽核部副总经理、资金计划部副总经理、长沙营业部总经理、财务总部总经理、深圳分公司总经理助理、计划财务总部总经理、国泰君安证券股份有限公司计划财务总部总经理、资产负债管理委员会专职主任委员、子公司管理小组主任。现任国泰君安证券股份有限公司纪委副书记、纪检监察室主任。

程静萍女士，独立董事，高级经济师职称。历任上海市财政局副科长、副处长、处长、局长助理，上海市财政局、税务局副局长、上海市计划委员会、上海市发展计划委员会副主任兼上海市物价局局长、上海市发展和改革委员会副主任、第十届全国人大代表、上海市决策咨询委员会专职委员。现任上海银行独立董事。

王鸿嫔女士，独立董事，法学士。历任台湾摩根资产管理旗下的怡富证券投资信托有限公司副总经理、怡富证券投资顾问公司总经理、中国摩根资产管理董事总经理、上投摩根基金管理有限公司总经理。现任上海富汇财富投资管理有限公司董事长。

胡斌先生，独立董事，特许金融分析师 (CFA)，美国伊利诺伊大学 (UIUC) 工商管理硕士（MBA）、上海交通大学管理工程博士。历任纽约银行梅隆资产管理公司担任Standish Mellon量化分析师、公司副总裁，Coefficient Global公司创始人之一兼基金经理。2007年11月起，担任梅隆资产管理中国区负责人。2010年7月起，于纽银梅隆西部基金管理有限公司担任首席执行官（总经理）。现任上海系数股权投资基金管理合伙企业（有限合伙）担任总经理。

2、现任监事会成员

王越先生，监事会主席，大专学历。1975年3月参加工作，历任上海民生中学会计、上海城市建设学院财务科副科长等职务。1993年7月加入原国泰证券，历任国泰证券国际业务部副经理、国际业务部经理、国际业务部副总经理等职务，1999年8月公司合并后至2000年9月任国泰君安证券公司会计部副总经理；现任国泰君安证券稽核审计部副总经理。

Uwe Michel先生，监事，法律硕士。历任慕尼黑Allianz SE亚洲业务部主管、主席办公室主管、Allianz Life Insurance Japan Ltd.主席及日本全国主管、德国慕尼黑Group OPEX安联集团内部顾问主管。现任慕尼黑Allianz SE业务部H5投资与亚洲主管。

朱慧女士，职工监事，经济学学士，历任国泰证券有限公司、国泰君安证券股份有限公司财务部副经理，现任国联安基金管理有限公司财务部总监。

刘涓女士，职工监事，经济学学士，现任国联安基金管理有限公司基金事务部副总监。

3、现任高级管理人员

庹启斌先生，董事长，经济学博士。历任华东师范大学国际金融系讲师、君安证券有限公司万航渡路营业部经理、资产管理公司研究部经理、香港公司研究策划部经理、研究发展中心主任、经纪管理部总经理、债券部总经理、副总裁、国泰君安证券股份有限公司副总裁。现任国联安基金管理有限公司董事长。

孟朝霞女士，公司总经理，硕士学位。历任新华人寿保险股份有限公司企业年金管理中心总经理、泰康养老保险股份有限公司副总经理、富国基金管理有限公司副总经理、融通基金管理有限公司总经理。现任国联安基金管理有限公司总经理。

李柯女士，副总经理，经济学学士。历任中国建设银行上海分行国际业务部、上海联合财务有限公司资金财务部副经理、经理、营运负责人兼内部审计师、公司副总经理、国联安基金管理有限公司财务总监、总经理助理。现任国联安基金管理有限公司副总经理。

魏东先生，副总经理，经济学硕士。曾任职于平安证券有限责任公司和国信证券股份有限公司；2003年1月加盟华宝兴业基金管理有限公司，先后担任交易部总经理、华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理和华宝兴业先进成长股票型证券投资基金基金经理、投资副总监及国内投资部总经理职务。2009年6月加入国联安基金管理有限公司，先后担任基金经理、总经理助理、投资总监等职务。现任国联安基金管理有限公司副总经理并兼任国联安德盛精选混合型证券投资基金、国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

满黎先生，副总经理，硕士学位。历任华安基金管理有限公司上海分公司高级投资顾问、西安分公司总经理、华东业务总部总经理、北京总部高级董事总经理；国联安基金管理有限公司市场总监。现任国联安基金管理有限公司副总经理。

刘轶先生，督察长，博士学位。曾任职于中国建设银行辽宁省分行、中国民生银行北京管理部、中国证券监督管理委员会、全国人民代表大会财政经济委员会证券法修改工作小组，并曾在南开大学等从事研究工作。现任国联安基金管理有限公司督察长。

4、基金经理

黄欣先生，伦敦经济学院会计金融专业硕士，于2002年11月加入兴业证券投资部任投资分析员。2003年10月加入国联安基金管理有限公司，历任产品开发部经理助理、总经理特别助理、投资组合管理部债券投资助理、国联安德盛精选股票证券投资基金及国联安德盛安心混合型证券投资基金基金经理助理。2010年4月起担任国联安双禧中证100指数分级证券投资基金基金经理，2010年5月至2012年9月兼任国联安德盛安心混合型证券投资基金基金经理，2010年11月起兼任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，2010年12月起兼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联接基金基金经理。2016年8月起兼任国联安中证医药100指数证券投资基金和国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）基金经理。

5、投资决策委员会成员

投资决策委员会是公司基金投资的最高投资决策机构。投资决策委员会由公司总经理、主管投资的副总经理、投资组合管理部负责人、固定收益业务负责人、研究部负责人及高级基金经理1-2人（根据需要）组成。投资决策委员会成员为：

孟朝霞（总经理）投委会主席
魏东（投资总监、副总经理）投委会执行主席
邹新进（投资组合管理部总监）
杨子江（研究部总监）
高级基金经理1-2人(根据需要)

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

三、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）
住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期：1983年10月31日
注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整
法定代表人：陈四清
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号
托管部门信息披露联系人：王永民
传真：（010）66594942
中国银行客服电话：95566

（二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

（三）证券投资基金托管情况

截至2017年09月30日，中国银行已托管637只证券投资基金，其中境内基金600只，QDII基金37只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

（四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起，中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于 “SAS70”、“AAF01/06” “ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

四、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

1、直销机构

名称：国联安基金管理有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼
法定代表人：庹启斌
成立时间：2003年4月3日
联系人：茅斐
客户服务电话：021-38992888
网址：www.gtja-allianz.com

投资人可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购、申购及赎回等业务，具体交易细则请参阅本公司网站公告。

2、代销机构

1) 中国银行股份有限公司
住所：复兴门内大街1号
办公地址：北京市复兴门内大街1号
法定代表人：陈四清
电话：010-66594587
联系人：张建伟
客户服务电话：95566
网址：www.boc.cn

2) 招商银行股份有限公司
住所：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦
办公地址：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人：李建红
电话：（0755）82960167
联系人：邓炯鹏
客户服务电话：95555
网址：www.cmbchina.com

3) 中国工商银行股份有限公司
住所：北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人：易会满
电话：010-66107913
联系人：李鸿岩
客户服务电话：95588
网址：www.icbc.com.cn

4) 中国建设银行股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人：田国立
电话：010-67596084
联系人：王琳
客户服务电话：95533
网址：www.ccb.com

5) 交通银行股份有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
法定代表人：牛锡明
电话：021-58781234
联系人：曹榕
客户服务电话：95559
网址：www.bankcomm.com

6) 华夏银行股份有限公司
住所：北京市东城区建国门内大街22号
办公地址：北京市东城区建国门内大街22号
法定代表人：吴建
电话：010-85238428
联系人：刘军祥
客户服务电话：95577
网址：www.hxb.com.cn

7) 上海浦东发展银行股份有限公司
住所：上海市中山东一路12号
办公地址：上海市中山东一路12号
法定代表人：高国富
电话： 021-61616192
联系人：吴斌
客户服务电话：95528
网址：www.spdb.com.cn

8) 国泰君安证券股份有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号
办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人：杨德红
电话：021-38032284
联系人：钟伟镇
客户服务电话： 95521
网址： www.gtja.com

9) 中信建投证券股份有限公司
住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址：北京市东城区朝阳门内大街188号
法定代表人：王常青
电话：010-85130577
联系人：刘芸
客户服务电话： 400-8888-108或95587
网址：www.csc108.com

10) 招商证券股份有限公司
住所：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人：宫少林
电话：0755-82943079
联系人：黄婵君
客户服务电话：95565或400-8888-111
网址：www.newone.com.cn

11) 中国银河证券股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街35号2-6层
办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座2-6层
法定代表人：陈共炎
电话：010-66568292
联系人：邓颜
客户服务电话：95551或400-8888-888
网址： www.chinastock.com.cn

12) 国信证券股份有限公司
住所：深圳市红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址：深圳市红岭中路1012号国信证券大厦
法定代表人：何如
电话：0755-82133066
联系人：李颖
客户服务电话：95536
网址：www.guosen.com.cn

13) 广发证券股份有限公司
住所：广州市天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）
办公地址：广州市天河北路183号大都会广场36、38、41、42楼
法定代表人：孙树明
电话：0755-82558305
联系人：黄岚
客户服务电话：95575
网址：www.gf.com.cn

14) 兴业证券股份有限公司
住所：福州市湖东路268号
办公地址：福建省福州市湖东路268号
法定代表人：兰荣
电话：0591-38281515
联系人：黄颖
客户服务电话： 95562
网址：www.xyzq.com.cn

15) 华泰联合证券有限责任公司
住所： 深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层（01A、02、03、04）、17A、18A、24A、25A、26A
办公地址： 深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层（01A、02、03、04）、17A、18A、24A、25A、26A
法定代表人：吴晓东
电话：0755-82492193
联系人：庞晓芸
客户服务电话： 95597
网址：www.lhzq.com

16) 新时代证券股份有限公司
住所： 北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
办公地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
法定代表人：叶顺德
电话：010-83561146
联系人：田芳芳
客户服务电话： 95399
网址： www.xsdzq.cn

17) 中信证券股份有限公司
住所：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座
办公地址：广东省深圳市福田区中心三路8号中信证券大厦
北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人：张佑君
电话：010-60834772
联系人：周雪晴
客户服务电话：95548
网址：www.cs.ecitic.com

18) 华泰证券股份有限公司
住所：南京市江东中路228号
办公地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人：周易
电话：025-84579763
联系人：万鸣
客户服务电话：95597
网址：www.htsc.com.cn

19) 安信证券股份有限公司
住所：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层
法定代表人：牛冠兴
电话：0755-82558038
联系人：郑向溢
客户服务电话： 95517
网址： www.essence.com.cn

20) 海通证券股份有限公司
住所：上海市广东路689号
办公地址：上海市广东路689号
法定代表人：周杰
电话：021-23219275
联系人：李楠
客户服务电话：95553
网址：www.htsec.com.cn

21) 宁波银行股份有限公司
住所：浙江省宁波市鄞州区宁南南路700号
办公地址：浙江省宁波市鄞州区宁南南路700号
法定代表人：陆华裕
电话：0574-87011947
联系人：朱海亚
客户服务电话：95574
网址：www.nbcb.com.cn

22) 山西证券股份有限公司
住所：太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
办公地址：太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼29层
法定代表人：侯巍
电话：0351-8686602
联系人：孟婉娉
客户服务电话：400-6661-618
网址：www.i618.com.cn

23) 中信银行股份有限公司
住所：北京市东城区朝阳门北大街9号
办公地址：北京市东城区朝阳门北大街9号
法定代表人：李庆萍
电话：010-89937333
联系人：迟卓
客户服务电话：95558
网址：www.bank.ecitic.com

24) 中泰证券股份有限公司
住所：山东省济南市经七路86号
办公地址：山东省济南市经七路86号23层
法定代表人：李玮
电话：0531-68889157
联系人：王霖
客户服务电话：95538
网址：www.zts.com.cn

25) 平安银行股份有限公司
住所：深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号
法定代表人：谢永林
电话：0755-22197874
联系人：叶佳
客户服务电话：95511
网址：www.bank.pingan.com

26) 光大证券股份有限公司
住所：上海市静安区新闸路1508号
办公地址：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：薛峰
电话：021-22169089
联系人：李晓皙
客户服务电话：95525
网址：www.ebscn.com

27) 信达证券股份有限公司
住所：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人：张志刚
电话：010-63081493
联系人：尹旭航
客户服务电话：400-8008-899
网址：www.cindasc.com

28) 渤海银行股份有限公司
住所：天津市河东区海河东路218号
办公地址：天津市河东区海河东路218号
法定代表人：李伏安
电话：022-58314846
联系人：王宏
客户服务电话：95541或400-8888-811
网址：www.cbhb.com.cn

29) 东海证券股份有限公司
住所：常州市延陵西路23号投资广场18层
办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人：赵俊
电话：021-50586660-8644
联系人：霍晓飞
客户服务电话：95531
网址：www.longone.com.cn

30) 华福证券有限责任公司
住所：福州五四路新天地大厦7至10层
办公地址：福州五四路新天地大厦7至10层
法定代表人：黄金琳
电话：0591-87383623
联系人：张腾
客户服务电话：400-8896-326
网址：www.gfhfzq.com.cn

31) 平安证券股份有限公司
住所：深圳市福田区金田路4036号荣超大厦16-20层
办公地址：深圳市福田区金田路4036号荣超大厦16-20楼
法定代表人：曹实凡
电话：0755-22626391
联系人：郑舒丽
客户服务电话：95511
网址：www.stock.pingan.com

32) 东北证券股份有限公司
住所：长春市生态大街6666号
办公地址：吉林省长春市人民大街1138号
法定代表人：李福春
电话：0431-82006251
联系人：付静雅
客户服务电话：400-6000-686
网址：www.nesc.cn

33) 长江证券股份有限公司
住所：湖北省武汉市新华路特8号
办公地址：湖北省武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人：尤习贵
电话：027-65799999
联系人：李良
客户服务电话： 95579
网址：www.95579.com

34) 华融证券股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街8号
办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街18号中国人保寿险大厦11至18层
法定代表人：祝献忠
电话：（010）58566100
联系人： 李慧灵
客户服务电话：400-898-9999
网址： www.hrsec.com.cn

35) 国元证券股份有限公司
住所：安徽省合肥市梅山路18 号
办公地址：安徽省合肥市梅山路18 号
法定代表人：蔡咏
电话：0551-2257034
联系人：李伟卫
客户服务电话：95578
网址：www.gyzq.com.cn

36) 西南证券股份有限公司
住所：重庆市江北区桥北苑8号
办公地址：重庆市江北区桥北苑8号
法定代表人：吴坚
电话：（023）63786464
联系人：陈诚
客户服务电话：400-8096-096，95355
网址：www.swsc.com.cn

37) 红塔证券股份有限公司
住所：云南昆明市北京路155号附1号
办公地址：云南昆明市北京路155号附1号红塔大厦7-11层
法定代表人：况雨林
电话：0871-63577946
联系人：高国泽
客户服务电话：400-871-8880
网址:www.hongtastock.com

38) 中信万通证券有限责任公司
住所：青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001
办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼21层
法定代表人：杨宝林
电话：0532-85022326
联系人：吴忠超
客户服务电话：95548
网址： www.zxwt.com.cn

39) 东莞银行股份有限公司
住所：东莞市莞城区体育路21号
办公地址：东莞市莞城区体育路21号
法定代表人：卢国锋
电话：0769-2211811
联系人：张技辉
客户服务电话：96228（省内），4001196228（省外）
网址：www.dongguanbank.cn

40) 天风证券股份有限公司
住所：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼
法定代表人：余磊
电话：027-87618882
联系人：翟璟
客户服务电话：95330
网址：www.tfzq.com

41) 江海证券有限公司
住所：哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址：哈尔滨市松北区创新三路833号
法定代表人：孙名扬
电话：0451-85863726
联系人：周俊
客户服务电话：400-6662-288
网址： www.jhzq.com.cn

42) 银泰证券有限责任公司
住所：深圳市福田区竹子林四路紫竹七道18号光大银行大厦18楼
办公地址：深圳市福田区竹子林四路紫竹七道18号光大银行大厦18楼
法定代表人：黄冰
电话：0755-83053731
联系人：刘翠玲
客户服务电话：4008-8505-505
网址：www.ytzq.net

43) 华宝证券有限责任公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号57层
办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层
法定代表人：陈林
电话：021-68778081
联系人：胡星煜
客户服务电话：400-8209-898
网址：www.cnhbstock.com

44) 名称：中国国际期货有限公司
住所：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层
办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层
法定代表人：王兵
联系人：李昊恒
电话：010-65807856
客服电话：95162、400-8888-160
网址：www.cifco.net

45）名称：中山证券有限责任公司
住所：深圳市南山区科技中一路华强高新技术发展大厦7层、8楼层
办公地址：深圳市南山区科技中一路华强高新技术发展大厦7-8楼
法定代表人：黄扬录
联系电话：0755-82570586
联系人：罗艺琳
客户服务电话：95329
网址：www.zszq.com

46）名称：中国国际金融股份有限公司
住所：北京市建国门外大街1号国贸写字楼2座27层及28层
办公地址：北京市建国门外大街1号国贸写字楼2座27层及28层
法定代表人：丁学东
联系人：杨涵宇
联系电话：010-65051166
客户服务电话：4009101166
网址：www.cicc.com.cn

47）名称：第一创业证券股份有限公司
住所：深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼
办公地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦15-20楼
法定代表人：刘学民
电话：0755-25832583
联系人：毛诗莉、王立洲
客户服务电话：95358
网址：www.firstcapital.com.cn

48）名称：东亚银行（中国）有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路66号25楼2501室、26楼、27楼2701室、28楼、37楼、38楼（名义楼层28楼2801室、29楼、30楼3001室、31楼、41楼、42楼）
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路66号东亚银行大厦29楼
法定代表人：李国宝
电话：021-38663713
联系人：顾文君
客户服务电话：95382
网址：http://www.hkbea.com.cn/

49）名称：申万宏源证券有限公司
住所：上海市徐汇区长乐路989号45层
办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人：李梅
电话：021-33388211
联系人：黄莹
客服电话：95523或4008895523
网址：www.swhysc.com

50）名称：天相投资顾问有限公司
住所：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701室
办公地址：北京市西城区新街口外大街28号C座5层
法定代表人：林义相
电话：010-66045182
联系人：谭磊
客户服务电话：010-66045678
网址：www.txsec.com

51）名称：诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司
住所：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路32号c栋
法定代表人：汪静波
电话：021-38509735
联系人：张裕
客户服务电话：400-821-5399
网址：www.noah-fund.com

52）名称：上海好买基金销售有限公司
住所：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
办公地址：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903—906室
法定代表人：杨文斌
电话：021-58870011
联系人：张茹
客户服务电话：400-700-9665
网址：www.ehowbuy.com

53）名称：上海天天基金销售有限公司
住所：上海市徐汇区龙田路195号3C-9楼
办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C-9楼
法定代表人：其实
电话：021-54509998
联系人：朱玉
客户服务电话：400-181-8188
网址：www.1234567.com.cn

54）名称：北京展恒基金销售股份有限公司
住所：北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦2层
办公地址：北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦2层
法定代表人：闫振杰
电话：010-62020088
联系人：翟飞飞
客户服务电话：400-818-8000
网址：www.myfund.com

55）名称：蚂蚁（杭州）基金销售有限公司
住所：杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室
办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F
法定代表人：陈柏青
联系人：韩爱彬
客服电话：4000-766-123
公司网址：www.fund123.cn

56）名称：深圳众禄金融控股股份有限公司
住所：广东省深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
办公地址：广东省深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
法定代表人：薛峰
电话：0755-33227950
联系人：童彩平
客户服务电话：400-678-8887
网址：www.zlfund.cn

57）名称：和讯信息科技有限公司
住所：北京市朝阳区朝外大街22号1002室
办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人：王莉
电话：01085650628
联系人：刘洋
客户服务电话：400-920-0022
网址：licaike.hexun.com

58）众升财富（北京）基金销售有限公司
住所：北京市朝阳区望京东园四区13号楼A座9层908室
办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08
法定代表人：李招弟
电话：010-59497361
联系人：李艳
客户服务电话：400-876-9988
网址：www.wy-fund.com

59）名称：上海长量基金销售投资顾问有限公司
住所：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人：张跃伟
联系电话：021-20691832
联系人：胡雪芹
客户服务电话：400-820-2899
网址：www.erichfund.com

60）名称：北京增财基金销售有限公司
住所：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208
办公地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208
法定代表人：罗细安
电话：010-67000988
联系人：李皓
客户服务电话：400-001-8811
网址： http://www.zcvc.com.cn

61）名称：上海利得基金销售有限公司
住所：上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
法定代表人：李兴春
电话：021-50583533
联系人：曹怡晨
客户服务电话：400-921-7755
网址： www.leadfund.com.cn

62）名称：浙江同花顺基金销售有限公司
住所：浙江省杭州市文二西路1号元茂大厦903室
办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺路18号同花顺大楼
法定代表人：凌顺平
电话：0571-88911818
联系人：吴强
客户服务电话：4008-773-772
网址：www.5ifund.com

63）名称：北京恒天明泽基金销售有限公司
住所：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
办公地址：北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层
法定代表人：周斌
电话：400-898-0618
联系人：张晔
客户服务电话：400-898-0618
网址： www.chtfund.com

64）名称：北京钱景基金销售有限公司
住所：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
办公地址：北京市海淀区丹棱街丹棱SOHO1006-1008
法定代表人：赵荣春
电话：010-57418813
联系人：崔丁元
客户服务电话：400-893-6885
网址：www.qianjing.com

65）名称：浙江金观诚财富管理有限公司
住所：杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室
办公地址：杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室
法定代表人：徐黎云
电话：0571-88337529
联系人：邵俊
客户服务电话：400-068-0058
网址：www.jincheng-fund.com

66）名称：海银基金销售有限公司
住所：上海市浦东新区东方路1217号陆家嘴金融服务广场16楼B单元
办公地址：上海市浦东新区银城中路8号4楼
法定代表人：刘惠
电话：021-80133828
联系人：徐烨琳
客户服务电话：400-808-1016
网址：www.fundhaiyin.com

67）名称：深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
住所：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦16层A区
法定代表人：马勇
电话：15810206817
联系人：张燕
客户服务电话：400-166-1188
网址：http://8.jrj.com.cn/

68）名称：上海陆金所资产管理有限公司
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号15楼
法定代表人：鲍东华
电话：021-20665952
联系人：宁博宇
客户服务电话：400-821-9031
网址：www.lufunds.com

69）名称：北京虹点基金销售有限公司
住所：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙楼2层222单元
办公地址：北京市朝阳区工体北路甲2号盈科中心B座裙房2层
法定代表人：胡伟
电话：010- 85643600
联系人：葛亮
客户服务电话：400-068-1176
网址：www.hongdianfund.com

70）名称：上海联泰资产管理有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8号楼3层
法定代表人：燕斌
电话：021-52822063
联系人：兰敏
客户服务电话： 4000-466-788
网址：http：//www.66zichan.com

71）名称：大泰金石基金销售有限公司
住所：南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室
办公地址：上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15层
法定代表人：袁顾明
电话：021-22267943
联系人：朱真卿
客户服务电话：4009-282-266
网址：www.dtfunds.com

72）名称：一路财富（北京）信息科技有限公司
住所：北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
办公地址：北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
法定代表人：吴雪秀
电话：88312877
联系人：段京璐
客户服务电话：400-001-1566
网址：http://www.yilucaifu.com/

73）名称：珠海盈米财富管理有限公司
住所：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203
法定代表人：肖雯
电话：020-89629099
联系人：吴煜浩
客户服务电话：020-89629066
网址：www.yingmi.cn

74）名称：奕丰金融服务（深圳）有限公司
住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1115室，1116室及1307室
法定代表人： TAN YIK KUAN
联系人：叶健
电话：0755-8946 0507；0755-8946 0500
客户服务电话：400-684-0500
网址：www.ifastps.com.cn

75）名称：深圳市金斧子投资咨询有限公司
住所：广东省深圳市南山区智慧广场第A栋11层1101-02
办公地址：广东省深圳市南山区科苑路18号东方科技大厦18楼
法定代表人：赖任军
电话：0755-84034499
联系人：张烨
客户服务电话：4009-500-888
网址：http://www.jfzinv.com/

76）名称：武汉市伯嘉基金销售有限公司
住所：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第七幢23层1号4号
办公地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第七幢23层1号4号
法人代表：陶捷
电话： 027-87006003（8026）
联系人：陆锋
客户服务电话：400-027-9899
网址：www.buyfunds.cn

77）名称： 上海万得基金销售有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址：上海市浦东新区福山路33号8楼
法人代表：王廷富
电话： 021-51327185
联系人：021-50710161
客户服务电话：400-821-0203
网址：--

78）名称：深圳富济财富管理有限公司
住所：深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期418室
办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期418室
法人代表：刘鹏宇
电话： 0755-83999907-819
联系人：马力佳
客户服务电话：0755-83999907
网址：www.jinqianwo.cn

79）名称：北京微动利投资管理有限公司(北京微动利)
住所：北京市石景山区古城西路113号景山财富中心341
办公地址：北京市石景山区古城西路113号景山财富中心341
法人代表：梁洪军
电话：010-52609656
联系人：季长军
客户服务电话：400-819-6665
网址：www.buyforyou.com.cn

80）名称： 北京电盈基金销售有限公司
住所：北京市朝阳区呼家楼（京广中心）1号36层3603室
办公地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦F座12层B室
法人代表：程刚
电话：010-56176118
联系人：张旭
客户服务电话：400-100-3391
网址：www.dianyingfund.com

81）名称： 北京汇成基金销售有限公司
住所：北京市海淀区中关村大街11号11层1108室
办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108室
法人代表：王伟刚
电话：010-62680827
联系人：丁向坤
客户服务电话：400-619-9059
网址：www.hcjijin.com

82）名称：北京晟视天下投资管理有限公司
住所：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲六号万通中心D座21&28层
法人代表：蒋煜
电话：010-58170876
联系人：徐晓荣/刘聪慧
客户服务电话：400-818-8866
网址：http://www.shengshiview.com/

83）名称：深圳前海微众银行股份有限公司
住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址：广东省深圳市南山区田厦金牛广场A座36楼、37楼
法人代表：顾敏
电话： 0755-89462447
联系人：罗曦
客户服务电话：400-999-8877
网址：www.webank.com

84）名称：上海基煜基金销售有限公司
住所：上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）
办公地址：上海市杨浦区昆明路518号A1002室
法人代表：王翔
电话： 021-65370077-209
联系人：俞申莉
客户服务电话：021-65370077
网址：www.jiyufund.com.cn

85）名称：杭州科地瑞富基金销售有限公司
住所：杭州市下城区武林时代商务中心1604室
办公地址：杭州市下城区上塘路15号武林时代20楼
法人代表：陈刚
电话：0571-85267500
联系人：胡璇
客户服务电话：0571-86655920
网址：www.cd121.com

86）名称：上海凯石财富基金销售有限公司
住所：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
办公地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼
法人代表：陈继武
电话： 021-63333389
联系人：王哲宇
客户服务电话：4006-433-389
网址：https://www.lingxianfund.com

87）名称：深圳前海凯恩斯基金销售有限公司
住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址：深圳市福田区深南大道6019号金润大厦23A
法人代表：高锋
电话： 0755-83655588
联系人：廖苑兰
客户服务电话：400-804-8688
网址：www.keynesasset.com

88）名称：贵州华阳众惠基金销售有限公司
住所：贵州省黔东南苗族侗族自治州丹寨县金钟经济开发区C栋标准厂房
办公地址：贵州省贵阳市云岩区北京路9号君派大厦16楼
法人代表：李陆军
电话：0851-86909950
联系人：陈敏
客户服务电话：400-839-1818
网址：www.hyzhfund.com

89）名称： 北京蛋卷基金销售有限公司
住所： 北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
办公地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
法人代表： 钟斐斐
电话：010-61840688
联系人： 戚晓强
客户服务电话： 4000618518
网址： https://danjuanapp.com/

90）名称：北京植信基金销售有限公司
住所：北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106室-67
办公地址：北京市朝阳区四惠盛世龙源国食苑10号楼
法定代表人：杨纪峰
电话：187-0135-8525
联系人：吴鹏
客户服务电话：400-680-2123
网址：www.zhixin-ivn.com

（二）注册登记机构

名称：国联安基金管理有限公司
住所：中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼
办公地址：中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼
法定代表人：庹启斌
联系人：茅斐
电话：021-38992888

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所
住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人：韩炯
联系人：黎明
电话：021-31358666
传真：021-31358600
经办律师：吕红、黎明

（四）审计基金资产的会计师事务所

名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：上海市静安区南京西路1266号恒隆广场50楼
办公地址：上海市静安区南京西路1266号恒隆广场50楼
负责人：蔡廷基
联系人：黎俊文
联系电话：021-53594666
传真：021-62881889
经办注册会计师：王国蓓、陈彦君

五、基金的名称

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联接基金

六、基金的类型

股票型基金

七、基金的投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

八、基金的投资方向

本基金以上证大宗商品股票ETF、上证大宗商品股票指数成份股、备选成份股为主要投资对象，其中投资于上证大宗商品股票ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金可少量投资于新股（首次发行或增发等，包括创业板新股）、债券、股指期货及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

九、基金的投资策略

（一）基金的投资策略

本基金为上证大宗商品股票ETF的联接基金，主要通过投资于上证大宗商品股票ETF以求达到投资目标。当本基金申购赎回和在二级市场买卖上证大宗商品股票ETF或本基金自身的申购赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，基金经理会对投资组合进行适当调整，降低跟踪误差。

本基金对业绩比较基准的跟踪目标是：在正常情况下，本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。

1、资产配置策略

本基金主要投资于上证大宗商品股票ETF、上证大宗商品股票指数成份股和备选成份股。本基金投资于上证大宗商品股票ETF的比例不低于基金资产净值的90%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；中国证监会允许的其他金融工具的投资比例不高于基金资产净值的5%。

2、目标ETF投资策略

（1）基金组合的构建原则

本基金对基金的投资仅限于指定的目标ETF，现时目标ETF仅指上证大宗商品股票ETF。

（2）基金组合的构建方法

本基金可以以成份股实物形式在一级市场申购及赎回上证大宗商品股票ETF基金份额；本基金可在二级市场上买卖上证大宗商品股票ETF基金份额，本基金在二级市场上买卖上证大宗商品股票ETF基金份额是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的。

本基金作为上证大宗商品股票ETF的联接基金，主要通过成份股实物形式从一级市场申购ETF份额来构建ETF投资组合。不足一级市场最小申购赎回单位资产净值的部分可以从二级市场买入ETF份额或者投资于上证大宗商品股票指数的成份股和备选成份股等。每个交易日进行ETF份额二级市场现金买卖的交易金额原则上不超过当日目标ETF一个最小申购赎回单位的净值。

本基金通过租用的特定交易单元申购、赎回目标ETF份额。当上证大宗商品股票ETF申购、赎回或交易模式进行了变更或调整，本基金也将作相应的变更或调整，无须召开基金份额持有人大会。

（3）基金组合的调整

本基金为ETF联接基金，基金所构建的ETF投资组合将根据目标ETF的变动而发生相应变化。本基金将根据法律法规中的投资比例限制、申购和赎回情况、现金头寸，对基金投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数。

3、股票投资策略

本基金对成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建股票组合以申购上证大宗商品股票ETF。因此对可投资于成份股、备选成份股的资金头寸，主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以选择其他证券或证券组合加以替换。

针对我国证券市场新股发行制度的特点，本基金将参与一级市场新股认购。

4、债券投资策略

基于流动性管理的需要，本基金可以投资于国债、央票、金融债等期限在一年期以下的债券，债券投资的目的是保证基金资产流动性和提高基金资产的投资收益。

5、股指期货及其他金融衍生品的投资策略

本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

本基金管理人对股指期货及其他金融衍生品的运用将进行充分的论证，充分了解股指期货及其他金融衍生品的特点和各种风险，以审慎的态度参与股指期货及其他金融衍生品。

（二）投资决策流程

1、投资依据

(1) 有关法律、法规、基金合同等的相关规定；
(2) 经济运行态势和证券市场走势。

2、投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员会负责制定基金投资方面的整体投资计划与投资原则；决定有关标的指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理根据投资决策委员会的决策，负责投资组合的构建、调整和日常管理等工作。

3、投资程序

(1) 首先运用数量化模型以及各种风险监控指标，结合公司内外的研究报告，对市场预期风险和指数化投资组合风险进行风险测算与归因分析，提出研究分析报告。

(2) 投资决策委员会依据相关研究分析报告，定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议，决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，进行基金投资管理的日常决策。

(3) 基金经理根据标的指数，结合研究分析报告，原则上依据指数成份股的权重构建资产组合。在追求跟踪误差最小化的前提下，基金经理将采取适当的技术和方法，降低交易成本，控制投资风险。

(4) 交易部根据基金经理下达的交易指令制定交易策略，完成具体证券品种的交易。

(5) 根据市场变化，定期和不定期评估基金投资绩效。风险管理部对基金投资计划的执行进行日常监督和风险控制。

(6) 基金经理密切跟踪标的指数的变动，结合成份股情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况、绩效评估报告等内容，对投资组合进行监控和调整，以实现对跟踪误差的有效控制。

(7) 本基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下，有权根据市场环境变化和实际需要调整上述投资程序，并予以公告。

十、投资业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：95%×上证大宗商品股票指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）。

随着市场环境的变化，如果标的指数不适用于本基金或投资的目标ETF变更标的指数时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，履行适当的程序变更本基金的标的指数，同时变更本基金的基金名称与业绩比较基准。其中，若标的指数变更涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案且在指定的媒体上刊登公告；若标的指数变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应在取得基金托管人同意后，报中国证监会备案并及时公告。

十一、基金的风险收益特征

本基金为上证大宗商品股票ETF的联接基金，风险与预期收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。同时，本基金为指数型基金，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。

十二、基金投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证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。

本基金的托管人——中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。本投资组合报告所载数据截至2017年9月30日，本报告财务资料未经审计师审计。

1报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	650,210.10	0.46
	其中：股票	650,210.10	0.46
2	基金投资	131,397,136.92	92.08
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	10,514,935.55	7.37
8	其他各项资产	140,338.43	0.10
9	合计	142,702,621.00	100.00

2期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金	股票型	契约型开放式(ETF)	国联安基金管理有限公司	131,397,136.92	92.43

3报告期末按行业分类的股票投资组合

3.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	17,780.00	0.01
C	制造业	632,430.10	0.44
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	-	-
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	-	-
	合计	650,210.10	0.46

3.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

4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股票投资明细

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	600111	北方稀土	20,300	327,439.00	0.23
2	600392	盛和资源	7,700	158,697.00	0.11
3	600549	厦门钨业	4,200	134,946.00	0.09
4	601020	华钰矿业	700	17,780.00	0.01
5	600673	东阳光科	1,100	8,019.00	0.01
6	600309	万华化学	60	2,529.00	0.00
7	600172	黄河旋风	60	508.20	0.00
8	600219	南山铝业	50	199.50	0.00
9	603077	和邦生物	40	92.40	0.00

5 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。

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。

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。

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。

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。

10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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。

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。

11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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。

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。

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。

12投资组合报告附注

12.1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，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。

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。

12.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	12,805.10
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,103.74
5	应收申购款	125,429.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	140,338.43

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债。

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	东阳光科	8,019.00	0.01	重大事项

十三、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩不代表未来表现。投资有风险，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

	基金份额净值增长率①	同期业绩比较基准收益率③	①-③	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率标准差④	②-④
2010-12-1至2010-12-31	-0.40%	5.17%	-5.57%	0.79%	1.70%	-0.91%
2011-1-1至2011-12-31	-33.13%	-32.93%	-0.20%	1.49%	1.52%	-0.03%
2012-1-1至2012-12-31	4.50%	4.45%	0.05%	1.59%	1.61%	-0.02%
2013-1-1至2013-12-31	-33.33%	-33.91%	0.58%	1.39%	1.41%	-0.02%
2014-1-1至2014-12-31	26.29%	26.05%	0.24%	1.24%	1.24%	0.00%
2015-1-1至2015-12-31	1.88%	1.33%	0.55%	2.77%	2.77%	0.00%
2016-1-1至2016-12-31	-7.37%	-6.58%	-0.79%	1.68%	1.72%	-0.04%
2017-1-1至2017-6-30	2.71%	3.31%	-0.60%	0.75%	0.75%	0.00%
2017-1-1至2017-9-30	23.80%	24.19%	-0.39%	1.04%	1.06%	-0.02%
2010-12-1至2017-9-30	-31.54%	-27.84%	-3.70%	1.69%	1.72%	-0.03%

十四、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；
2、基金托管人的托管费；
3、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
4、基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费；
5、基金份额持有人大会费用；
6、基金的证券交易费用；
7、基金的银行汇划费用；
8、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

（二）基金费用的费率、计提方法、计提标准和支付方式

1、与基金运作有关的费用：

（1）基金管理人的管理费

本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费。在通常情况下，按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取0）的0.6%年费率计提基金管理费。计算方法如下：

$H=E\times0.6\%\div$当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产净值后的剩余部分；若为负数，则E取0。

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

（2）基金托管人的托管费

本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费。在通常情况下，按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取0）的0.1%年费率计提基金托管费。计算方法如下：

$H=E\times0.1\%\div$当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产净值后的剩余部分；若为负数，则E取0。

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

基金管理人和基金托管人可磋商酌情调低基金管理费率、基金托管费率，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但基金管理人必须最迟于新的费率实施前2个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。提高上述费率需经基金份额持有人大会决议通过。

（3）前款第3至第8项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

2、与基金销售有关的费用

（1）申购费

本基金申购费的费率水平、计算公式和收取方式等内容详见招募说明书“八、基金份额的申购与赎回”部分的内容。

（2）赎回费

本基金赎回费的费率水平、计算公式和收取方式等内容详见招募说明书“八、基金份额的申购与赎回”部分的内容。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
3、《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十五、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，对本基金管理人于2017年7月15日刊登的本基金招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

1、更新了“三、基金管理人”部分的内容。
2、更新了“四、基金托管人” 部分的内容。
3、更新了“五、相关服务机构” 部分的内容。
4、更新了“八、基金的申购与赎回”部分的内容。
5、更新了“九、基金的投资” 部分的内容。
6、更新了“十、基金的业绩”部分的内容。
7、更新了“十二、基金资产的估值”部分的内容。
8、更新了“二十、基金托管协议的内容摘要”部分的内容。
9、更新了“二十二、其他应披露事项”部分的内容。

国联安基金管理有限公司
二〇一八年一月十三日