

**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**

**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**

**二〇一一年六月**

## 【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新基金业绩表现的保证。

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。

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。

本招募说明书（更新）摘要所载内容截止日为 2011 年 6 月 1 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2011 年 3 月 31 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：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼

法定代表人：符学东

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：021-38992999

联系人：黄志钢

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）证券投资基金管理情况

截止2011年3月31日，公司旗下共管理13只基金：国联安德盛稳健证券投资基金（以下简称“国联安稳健混合”）、国联安德盛小盘精选证券投资基金（以下简称“国联安小盘精选混合”）、国联安德盛安心成长混合型证券投资基金（以下简称“国联安安心成长混合”）、国联安德盛精选股票证券投资基金（以下简称“国联安精选股票”）、国联安德盛优势股

票证券投资基金(以下简称“国联安优势股票”)、国联安德盛红利股票证券投资基金(以下简称“国联安红利股票”)、国联安德盛增利债券证券投资基金(以下简称“国联安增利债券”)、国联安主题驱动股票型证券投资基金(以下简称“国联安主题驱动股票”)、国联安双禧中证100指数分级证券投资基金(以下简称“国联安双禧中证100指数分级”)、国联安信心增益债券型证券投资基金(以下简称“国联安信心增益债券”)、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“商品ETF”)、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“国联安上证商品ETF联接”)和国联安货币市场证券投资基金(以下简称“国联安货币”)。

### (三) 主要人员情况

#### 1、董事会成员

(1) 符学东先生, 董事长, 经济学硕士, 高级经济师, 中共党员。历任国家体制改革委员会分配司副处长, 国泰证券有限公司总裁助理, 国泰君安证券股份有限公司副总裁。

(2) Andrew Douglas Eu(余义焜)先生, 副董事长, 工商管理硕士。历任怡富证券投资有限公司高级研究分析员、投资经理、董事(地区业务)、JF资产管理有限公司董事、行政总裁。现任德盛安联资产管理亚太区行政总裁、董事、德盛安联资产管理香港有限公司董事、德盛安联资产管理公司董事、德盛安联资产管理日本公司董事、德盛安联资产管理卢森堡公司董事、香港证券及期货事务监察委员会咨询委员会委员。

(3) George Alan McKay先生, 董事, 英国牛津A类等级标准(经济学和英文)。历任英国Save & Prosper 管理有限公司(富林明集团)董事, 怡富资产管理公司(香港) 营运董事、常务董事, 摩根富林明资产管理公司(香港) 常务董事, 纽约银行梅隆公司(原为梅隆国际投资管理公司) 执行董事。现担任德盛安联资产管理亚太区首席营运官。

(4) 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。现担任国泰君安证券股份有限公司资产负债管理委员会专职主任委员、子公司管理小组主任。

(5) 程静萍女士, 独立董事, 大专学历, 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、市物价局副主任兼局长, 上海市发展计划委员会、发展改革委员会副主任、第十届全国人大代表、上海市决策咨询委员会专职委员。现任上海市创业投资行业协会会长、上海银行独立董事、上海市宏观经济学会专家委员会主任。

(6) 王丽女士, 独立董事, 法学博士。德恒律师事务所主任, 首席全球合伙人, 兼德恒海牙分所主任, 德恒律师学院院长、教授, 清华大学、北京大学研究生导师。中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员, 中国证券监督管理委员会重组委员会第一届、第二届委员, 劳动部企业年金、全国社会保障基金理事会专家, 全国工商业联合会执委、法律委员会委员。

(7) Thilo Ketterer先生, 独立董事, 经济管理博士, 德国注册会计师, 历任德国NEXIA国际集团审计助理, Carl Zeiss Semiconductor Manufacturing Technologies(SMT)AG 会计主管, 以色列 Microspec Technologies Inc. 董事, 罗德会计师事务所(有限公司) 合伙集团驻上海代表处首席代表, 现任德国纽伦堡罗德会计师事务所(有限责任) 合伙集团的合伙人。

## 2、监事会成员

(1) 蒋忆明先生, 监事会主席, 会计师, 博士。历任深圳宇康太阳能有限公司财务部经理、君安证券公司经纪业务部副总经理、资金计划部副总经理、总经理、君安证券公司财务总监、国泰君安证券股份有限公司深圳分公司副总经理、国泰君安证券股份有限公司总会计师。现任国泰君安证券股份有限公司财务总监。

(2) 庄小慧女士, 监事, 法律硕士。历任Bell, Temple见习律师、McCague, Peacock, Borlack, McInnis & Lloyd大律师及事务律师助理、金杜律师事务所事务律师助理、瑞士再保险公司法律顾问。现任德盛安联资产管理(亚太)有限公司法律顾问。

(3) 陆康芸女士, 职工监事, 法学硕士。历任中国工商银行上海市分

行法律顾问、上海市海华永泰律师事务所律师。现任国联安基金管理有限公司监察稽核部总监。

### 3、公司高级管理人员

(1) 许小松先生，总经理，经济学博士。历任深圳证券交易所综合研究所副所长、南方基金管理有限公司首席经济学家、副总经理。（注：自2011年7月13日起，许小松先生不再担任本公司总经理。该公告于2011年7月13日披露。）

(2) 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。（注：自2011年7月13日起，李柯女士担任本公司代理总经理。该公告于2011年7月13日披露。）

(3) 谢荣兴先生，督察长，高级会计师，上海市政协委员，民主党派。历任上海万国证券公司黄埔营业部总经理、上海万国证券公司总经理助理、董事和交易总监、君安证券有限责任公司副总裁、董事、国泰君安证券股份有限公司总经济师、国泰君安投资管理股份有限公司副董事长兼总裁。

(4) 王峰先生，副总经理，经济学硕士。历任渤海证券研究所金融工程部研究员、天同证券研究所金融创新部主管、上海浦东发展银行股份有限公司基金托管部产品主管、上投摩根基金管理有限公司市场部总监、业务发展部总监、国联安基金管理有限公司总经理助理。

(5) 周泉恭先生，副总经理，金融学博士。历任中国银行深圳市分行科长、中国银行总行基金托管部主管、中融基金管理有限公司（现为国投瑞银基金管理有限公司）总经理助理、荷兰荷银梅隆环球金融服务有限公司北京代表处首席代表、国联安基金管理有限公司首席市场官。

### 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月起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。

#### 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。

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

变更注册登记日期：2004年8月26日

注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元

法定代表人：肖钢

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门负责人：李爱华

托管部门信息披露联系人：唐州徽

电话：010-66594855

传真：010-66594942

发展概况：

1912年2月,经孙中山先生批准,中国银行正式成立。从1912年至1949年,中国银行先后履行中央银行、国际汇兑银行和外贸专业银行职能,坚持以服务社会民众、振兴民族金融为己任,稳健经营,锐意进取,各项业务取得了长足发展。新中国成立后,中国银行长期作为国家外汇专业银

行，成为我国对外开放的重要窗口和对外筹资的主要渠道。1994 年，中国银行改为国有独资商业银行。2003 年，中国银行启动股份制改造。2004 年 8 月，中国银行股份有限公司挂牌成立。2006 年 6 月、7 月，先后在香港联交所和上海证券交易所成功挂牌上市，成为国内首家在境内外资本市场上发行上市的商业银行。

中国银行是中国国际化和多元化程度最高的银行，在中国内地、香港澳门台湾及 31 个国家和地区为客户提供全面的金融服务，主要经营商业银行业务，包括公司金融业务、个人金融业务和金融市场业务，并通过全资子公司中银国际开展投资银行业务，通过全资子公司中银集团保险及中银保险经营保险业务，通过全资子公司中银集团投资从事直接投资和投资管理业务，通过控股中银基金管理有限公司从事基金管理业务，通过中银航空租赁私人有限公司经营飞机租赁业务。

在近百年的发展历程中，中国银行始终秉承追求卓越的精神、稳健经营的理念、客户至上的宗旨、诚信为本的传统和严谨细致的作风，得到了业界和客户的广泛认可和赞誉，树立了卓越的品牌形象。2010 年度，中国银行被 Global Finance（《环球金融》）评为 2010 年度中国最佳公司贷款银行和最佳外汇交易银行，被 Euromoney（《欧洲货币》）评为 2010 年度房地产业“中国最佳商业银行”，被英国《金融时报》评为最佳私人银行奖，被 The Asset（《财资》）评为中国最佳贸易融资银行，被 Finance Asia（《金融亚洲》）评为中国最佳私人银行、中国最佳贸易融资银行，被《21 世纪经济报道》评为亚洲最佳全球化服务银行、最佳企业公民、年度中资优秀私人银行品牌。面对新的历史机遇，中国银行将积极推进创新发展、转型发展、跨境发展，向着国际一流银行的战略目标不断迈进。

## 2、主要人员情况

中国银行于 1998 年设立基金托管部，为进一步树立以投资者为中心的服务理念，中国银行于 2005 年 3 月 23 日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部，下设覆盖集合类产品、机构类产品、全球托管产品、投资分析及监督服务、风险管理与内控、核算估值、信息技术、资金和证券交收等各层面的多个团队，现有员工 110 余人，其中，90%以上的员工具备本科以上学历。另外，中国银行在重点分行已开展托管业务。

目前,中国银行拥有证券投资基金、一对多专户、一对一专户、社保基金、保险资产、QFII 资产、QDII 资产、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、信托资产、年金资产、理财产品、海外人民币基金、私募基金等门类齐全的托管产品体系。在国内,中国银行率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,为各类客户提供个性化的托管服务。2010 年末中国银行在中国内地托管的资产突破万亿元,居同业前列。

### 3、证券投资基金托管情况

截止 2011 年 3 月末,中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合(LOF)、大成 2020 生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选封闭、大成景宏封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深 300 指数、国泰金鹿保本混合、国泰金鹏蓝筹混合、国泰区位优势股票、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选贰号混合、海富通收益增长混合、海富通中证 100 指数(LOF)、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票(LOF)、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深 300 指数(LOF)、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票型、金鹰成份优选股票、金鹰行业优势股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证 100ETF、易方达中小盘股票、易方达深证 100ETF 联接、万家 180 指数、万家稳健增利债券、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票(LOF)、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、泰达宏利中证财富大盘指数、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞货币、华泰柏瑞量化现行股票型、南方高增长股票(LOF)、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方

核心动力股票、华安行业轮动股票型、摩根士丹利华鑫强收益债券型、诺德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时宏观回报债券型、易方达岁丰添利债券型、富兰克林国海中小盘股票型、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数、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、上证中小盘交易型开放式指数、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接、长城中小盘成长股票型、易方达医疗保健行业股票型、景顺长城稳定收益债券型、上证 180 金融交易型开放式指数、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接、工银全球股票(QDII)、嘉实海外中国股票(QDII)、银华全球优选(QDII-FOF)、长盛环球景气行业大盘精选股票型(QDII)、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型(QDII)、信诚金砖四国积极配置(QDII)、海富通大中华精选股票型(QDII)、招商标普金砖四国指数(LOF-QDII)、华宝兴业成熟市场动量优选(QDII)、大成标普 500 等权重指数(QDII)、长信标普 100 等权重指数(QDII)等 107 只证券投资基金，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。

## （二）托管业务的内部控制制度

中国银行开办各类基金托管业务均获得相应的授权，并在辖内实行业务授权管理和从业人员核准资格管理。中国银行自 1998 年开办托管业务以来严格按照相关法律法规的规定以及监管部门的监管要求，以控制和防范基金托管业务风险为主线，制定并逐步完善了包括托管业务授权管理制度、业务操作规程、员工职业道德规范、保密守则等在内的各项业务管理制度，将风险控制落实到每个工作环节；在敏感部位建立了安全保密区和隔离墙，安装了录音监听系统，以保证基金信息的安全；建立了有效核对和监控制度、应急制度和稽查制度，保证托管基金资产与银行自有资产以及各类托管资产的相互独立和资产的安全；制定了内部信息管理制度，严格遵循基金信息披露规定和要求，及时准确地披露相关信息。

最近一年内，中国银行的基金托管业务部门及其高级管理人员无重大违法违规行为，未受到中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。

### （三）基金托管人对基金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》、《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，立即通知基金管理人，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，应当立即通知基金管理人，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：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大楼9楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大楼9楼

法定代表人：符学东

成立时间：2003年4月3日

联系人：茅斐

客户服务电话：021-38784766或400-7000-365（免长途话费）

网址：[www.vip-funds.com](http://www.vip-funds.com)或[www.gtja-allianz.com](http://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：北京市西城区复兴门内大街1号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：肖钢

客户服务电话：95566

网址：[www.boc.cn](http://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：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：傅育宁

电话：0755-83195475

联系人：邓炯鹏

客户服务电话：95555

网址：[www.cmbchina.com](http://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：姜建清

电话：010-66107900

传真：010-66107914

联系人：王霖

客户服务电话：95588

网址：[www.icbc.com.cn](http://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：郭树清

电话：010-67596093

联系人：何奕

客户服务电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

5) 交通银行股份有限公司

住所：上海市银城中路 188 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

电话：021-58766688

联系人：蔡雪

客户服务电话：95559

网址：[www.bankcomm.com](http://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：010-85238423

联系人：刘军祥

客户服务电话：95577

网址：[www.hxb.com.cn](http://www.hxb.com.cn)

7) 上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

电话：021-61618888

联系人：虞谷云

客户服务电话：95528

网址：[www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

8) 国泰君安证券股份有限公司

住所：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：祝幼一

联系人：芮敏琪

咨询电话：021-38676161

传真：021-38670666

客户服务电话：400-8888-666 或 95521

网址：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

9) 中信建投证券有限责任公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人：张佑君

电话：010-85130577

联系人：魏明

客户服务热线：400-8888-108

网址：[www.csc108.com](http://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：0755-82940764

联系人：林生迎

客户服务电话：95565 或 400-8888-111

网址：[www.newone.com.cn](http://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 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

法定代表人：顾伟国

联系人：田薇

客户服务电话：400-8888-888

网址：[www.chinastock.com.cn](http://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

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

联系人：齐晓燕

咨询电话：0755-82133066

传真：0755-82133302

客户服务电话：95536

网址：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

13) 广发证券股份有限公司

住所：广东省广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼

办公地址：广州室天河北路大都会广场 36、38、41 和 42 楼

法定代表人：王志伟

联系人：黄岚

咨询电话：020-87555888

传真：020-87555305

客户服务电话：95575

网址：[www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn)

14) 兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路 99 号标力大厦

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号

法定代表人：兰荣

联系人：谢高得

业务联系电话：021-68419974

客服：400-8888-123

网址：[www.xyzq.com.cn](http://www.xyzq.com.cn)

15) 华泰联合证券有限责任公司

住所：深圳市罗湖区深南东路 5047号深圳发展银行大厦10、24、25层

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047号深圳发展银行大厦10、24、  
25层

法定代表人：马昭明

电话：0755-82493561

联系人：庞晓芸

咨询电话：400-8888-555 或 0755-25125666

传真：0755-82492962

客户服务电话：95513

网址：[www.lhzq.com](http://www.lhzq.com)

16) 新时代证券有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街1号A座8层

办公地址：北京市西城区月坛北街2号月坛大厦1501室

法定代表人：马金声

电话：010-83561149

联系人：孙恺

客户服务电话：400-6989-898

网址：[www.xsdzq.cn](http://www.xsdzq.cn)

17) 中信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层

办公地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层

法定代表人：王东明

电话：010-84588266

传真：010-84865560

联系人：张于爱

网址：cs.ecitic.com

18) 华泰证券股份有限公司

住所：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

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：吴万善

电话：025-84457777

传真：025-84579879

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：0755-82558305

联系人：陈剑虹

客户服务电话：400-8001-001

网站：[www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)

20) 海通证券股份有限公司

住所：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人：王开国

电话：021-53594566

联系人：李笑鸣

客户服务电话：95553 或 400-8888-001

网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

21) 宏源证券股份有限公司

住所：新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号宏源大厦

办公地址：北京市西城区太平桥大街 19 号

法定代表人：冯戎

电话：010 - 88085338

联系人：李巍

客户服务电话：400-8000-562

网址：[www.hysec.com](http://www.hysec.com)

22) 宁波银行股份有限公司

住所：宁波市江东区中山东路 294 号

办公地址：宁波市江东区中山东路 294 号

法定代表人：陆华裕

电话：021-63586189

联系人：胡技勋

客户服务电话：96528 或 962528（上海）

网址：[www.nbcb.com.cn](http://www.nbcb.com.cn)

23) 山西证券股份有限公司

住所：太原市西街 69 号山西国贸中心东塔楼

办公地址：太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

法定代表人：侯巍

电话：0351-8686708

联系人：孟婉婷

客户服务电话：400-6661-618

网址：[www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)

24) 申银万国证券股份有限公司

住所：上海市常熟路 171 号  
办公地址：上海市常熟路 171 号  
法定代表人：丁国荣  
电话：021-54033888  
联系人：邓寒冰  
客户服务电话：021-962505  
网址：[www.sywg.com](http://www.sywg.com)

25) 中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座  
办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座  
法定代表人：孔丹  
电话：010-65557013  
联系人：李博  
客户服务电话：95558  
网址：[bank.ecitic.com](http://bank.ecitic.com)

26) 齐鲁证券有限公司

住所：山东省济南市经十路 20518 号  
办公地址：济南市经七路 86 号 23 层  
法定代表人：李玮  
联系电话：0531-81283906  
客户服务电话：95538  
联系人：王霖  
网址：[www.qlzq.com.cn](http://www.qlzq.com.cn)

27) 平安银行股份有限公司

住所：深圳市福田区红荔西路 301 栋  
公司地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦  
法定代表人：孙健一

联系电话：0755-22626198

联系人：蔡宇洲

客户服务电话：400-6699-999

网址：[bank.pingan.com](http://bank.pingan.com)

28) 光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：徐浩明

联系电话：021-22169089

联系人：李芳芳

客户服务电话：400-8888-788

网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

29) 信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区三里河东路 5 号中商大厦 10 层

办公地址：北京市西城区三里河东路 5 号中商大厦 10 层

法定代表人：张志刚

联系电话：010-88656100

联系人：唐静

客户服务电话：400-8008-899

公司网址：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

30) 名称：渤海银行股份有限公司

住所：天津市河西区马场道 201-205 号

法定代表人：刘宝凤

联系人：王宏

联系电话：022-58314846

客户服务电话：400-8888-811

公司网址：[www.cbhb.com.cn](http://www.cbhb.com.cn)

31) 名称：东海证券有限责任公司

住所：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18、19 号楼

法定代表人：朱科敏

联系人：霍晓飞

联系电话：021-50586660-8644

客户服务电话：400-8888-588

公司网址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

32) 名称：广发华福证券有限责任公司

住所：福州市鼓楼区温泉街道五四路 157 号 7-8 层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

联系电话：0591-87383623

客户服务电话：0591-96326

公司网址：[www.gfhfzq.com.cn](http://www.gfhfzq.com.cn)

33) 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

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人：林义相

联系人：林爽

联系电话：010-66045500

客户服务电话：010-66045555

网址：[www.txsec.com](http://www.txsec.com)

34) 名称：平安证券有限责任公司

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 层

法定代表人：杨宇翔

客户服务电话：400-8816-168 或 0755-22627052

联系人：周璐

联系电话：0755-22626172

公司网址：[www.stock.pingan.com](http://www.stock.pingan.com)

35) 名称：中航证券股份有限公司

住所：江西省南昌市抚河北路 291 号

法定代表人：杜航

电话：0791-6768681

联系人：戴蕾

客户服务电话：400-8866-567

网址：[www.scstock.com](http://www.scstock.com) 或 [www.avicsec.com](http://www.avicsec.com)

36) 名称：东北证券股份有限公司

住所：长春市人民大街 1138 号

法定代表人：矫正中

电话：0431-85096530

联系人：王京京

客户服务电话：400-6000-686

网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

37) 名称：长江证券股份有限公司

住所：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

客户服务热线：95579 或 400-8888-999

联系人：李良

电话：027-65799999

传真：027-85481900

客户服务网站：[www.95579.com](http://www.95579.com)

38) 名称：华融证券股份有限公司

住所：北京市西城区月坛北街 26 号

办公地址：北京市西城区月坛北街 26 号恒华国际商务中心 9 层

法定代表人：丁之锁

电话：010-58568118

联系人：林长华

网址：www.hrsec.com.cn

39) 名称：国元证券股份有限公司

住所：合肥市寿春路 179 号国元大厦

法定代表人：凤良志

电话：0551-2207323

联系人：李伟卫

客户服务电话：95578

公司网址：www.gyzq.com.cn

40) 名称：西南证券股份有限公司

住所：渝中区临江支路 2 号合景国际大厦 A 幢

办公地址：重庆市渝中区临江支路 2 号合景国际大厦 A 幢 22 层

法定代表人：王珠林

电话：023-63786433

联系人：陈诚

网址：www.swsc.com.cn

41) 名称：红塔证券股份有限公司

住所：云南昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼

办公地址：云南昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼

法定代表人：况雨林

电话：0871-3577942

联系人：刘晓明

客户服务电话：0871-3577930

网站：[www.hongtastock.com](http://www.hongtastock.com)

42) 名称：中信万通证券有限责任公司

住所：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

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：张智河

电话：0532-96577

联系人：吴忠超

客户服务电话：96577

网站：[www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

43) 名称：东莞银行股份有限公司

住所：广东省东莞市运区运河东一路 193 号

办公地址：广东省东莞市城区运河东一路 193 号

法定代表人：廖玉林

电话：0769-22118118

联系人：巫渝峰

客户服务电话：96228

网址：[www.dongguanbank.cn](http://www.dongguanbank.cn)

## （二）注册登记机构

名称：国联安基金管理有限公司

住所：上海市陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼

办公地址：上海市陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼

法定代表人：符学东

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  
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、基金份额的申购与赎回

### （一）申购费率与赎回费率

#### 1、申购费率

（1）本基金的申购费率具体如下：

申购金额（M）	申购费率
100 万以下	1.50%
100 万（含）至 500 万	0.70%
500 万元（含）以上	每笔交易 1000 元

投资者通过“国联安?易购”基金网上直销平台申购本基金可享受前端申购费率优惠。具体优惠申购费率以相关公告为准。

基金管理人设置申购金额上限，但各银行卡具体的申购上限要遵守各银行网上银行上限标准。本基金管理人可根据业务情况调整上述交易费用和限额要求，并依据相关法规的要求提前进行公告。

本基金并适时参加相关代销机构申购费率优惠活动，具体活动细则及费率情况详情参见基金管理人有关公告。该等申购费率优惠活动最终解释权归相关代销机构所有，活动具体规定如有变化，敬请基金投资人留意相关代销机构的有关公告。

（2）本基金的申购费用由申购人承担，不列入基金资产，主要用于本基金的市场推广、注册登记和销售等。

#### 2、赎回费率

（1）本基金的赎回费率具体如下：

持有期限（Y）	赎回费率
持有 1 年以下	0.50%
持有 1 年（含）至 2 年	0.30%
持有 2 年（含）及以上	0.00%

注：1年指365天。

(2) 赎回费用由赎回人承担，赎回费中25%归入基金资产，其余部分作为本基金用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

3、基金管理人可以按照《基金合同》的相关规定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前按照《信息披露管理办法》在至少一家中国证监会指定的媒体及基金管理人网站公告。

## (二) 申购份数与赎回金额的计算方式

### 1、申购份额的计算

申购本基金的申购费用采用前端收费模式（即申购基金时缴纳申购费），投资者的申购金额包括申购费用和净申购金额。申购份额的计算方式如下：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份数} = \text{净申购金额} / \text{申购当日基金份额净值}$$

申购份额计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。

例：某投资者投资5万元申购本基金的基金份额，假设申购当日基金份额净值为1.05元，则可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 50000 / (1 + 1.5\%) = 49261.08 \text{元}$$

$$\text{申购费用} = 50000 - 49261.08 = 738.92 \text{元}$$

$$\text{申购份数} = 49261.08 / 1.05 = 46915.31 \text{份}$$

即：投资者投资5万元申购本基金的基金份额，假设申购当日基金份额净值为1.05元，则其可得到46915.31份基金份额。

### 2、赎回净额的计算

基金份额持有人在赎回本基金时缴纳赎回费，基金份额持有人的赎回净额为赎回金额扣减赎回费用。其中：

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份额} \times \text{赎回当日基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回总金额} - \text{赎回费用}$$

赎回费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留到小

数点后两位；赎回净额结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。

例：某投资者赎回本基金 10000 份基金份额，赎回适用费率为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值为 1.148 元，则其可得净赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 10000 \times 1.148 = 11480 \text{元}$$

$$\text{赎回费用} = 11480 \times 0.5\% = 57.40 \text{元}$$

$$\text{净赎回金额} = 11480 - 57.40 = 11422.60 \text{元}$$

即：投资者赎回本基金 10000 份基金份额，假设赎回当日基金份额净值为 1.148 元，则可得到的净赎回金额为 11422.60 元。

### 3、基金份额净值计算

T 日基金份额净值=T 日基金资产净值/T 日发行在外的基金份额总数。基金份额净值单位为人民币元，计算结果保留到小数点后三位，小数点后第四位四舍五入。

T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

## （三）基金转换

基金转换是指开放式基金份额持有人将其持有某只基金的部分或全部份额转换为同一基金管理人管理的另一只开放式基金份额。基金转换只能在同一销售机构进行。转换的两只基金必须都是该销售机构代理的同一基金管理人管理的、在同一注册登记机构处注册登记的、同一收费模式的开放式基金。

### 1、适用基金范围：

本基金转换业务适用于本公司已发行和管理的国联安德盛稳健证券投资基金（简称：国联安稳健混合 基金代码：255010）、国联安德盛小盘精选证券投资基金（简称：国联安小盘精选混合 基金代码：257010）、国联安德盛安心成长混合型证券投资基金（简称：国联安安心成长混合 基金代码：253010）、国联安德盛精选股票证券投资基金（简称：国联安精选股票 基金代码：前端 257020 后端 257021）、国联安德盛优势股票证券投资基金（简称：国联安优势股票 基金代码：前端 257030 后端 257031）、国联安

德盛红利股票证券投资基金（简称：国联安红利股票 基金代码：前端 257040 后端 257041）、国联安德盛增利债券证券投资基金（简称：国联安增利债券 基金代码：A 类 253020 B 类 253021）、国联安主题驱动股票型证券投资基金（简称：国联安主题驱动股票 基金代码：257050）、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（简称：国联安上证商品 ETF 联接；基金代码：257060）和国联安货币市场证券投资基金（基金简称：国联安货币；基金代码：A 级 253050、B 级 253051）。

本公司今后发行的其他开放式基金的基金转换业务另行公告。

## 2、 适用销售机构：

（1）华夏银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司和招商证券股份有限公司（上述机构适用如下基金的转换：国联安稳健混合、国联安小盘混合、国联安安心混合、国联安精选股票、国联安优势股票）。

（2）宁波银行股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司和海通证券股份有限公司（上述机构适用如下基金的转换：国联安稳健混合、国联安小盘混合、国联安安心混合、国联安精选股票、国联安优势股票、国联安红利股票、国联安增利债券 A、国联安增利债券 B）。

（3）华泰联合证券有限责任公司（上述机构适用如下基金的转换：国联安稳健混合、国联安小盘混合、国联安安心混合、国联安精选股票、国联安优势股票、国联安红利股票、国联安增利债券 A、国联安增利债券 B、国联安主题驱动股票）。

（4）上海浦东发展银行股份有限公司（上述机构适用如下基金的转换：国联安稳健混合、国联安小盘混合、国联安安心混合、国联安精选股票、国联安优势股票、国联安货币）。

（5）中国建设银行股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、中国银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、中信证券股份有限公司和国联安基金管理有限公司直销业务平台（上述机构适用如下基金的转换：国联安稳健混合、国联安小盘混合、国联安安心混合、国联安精选股票、国联安优势股票、国联安红利股票、国联安增利债券 A、国联安增利债券 B、

国联安主题驱动股票、国联安上证商品 ETF 联接、国联安货币）。

### 3、基金转换费及转换份额的计算：

（1）进行基金转换的总费用包括转换手续费、转出基金的赎回费和转入基金与转出基金的申购补差费三部分。

转换手续费率为零。如基金转换手续费率调整将另行公告。

转出基金赎回费 = 转出金额 × 转出基金赎回费率

其中：转出金额 = 转出基金份额 × 转出基金当日基金份额净值

目前，本公司旗下已开通基金转换出业务的基金赎回费率如下：

基金名称	持有时间	费率
国联安稳健混合	全部	0.50%
国联安小盘精选混合 国联安安心成长混合 国联安精选股票 国联安优势股票 国联安红利股票 国联安主题驱动股票 国联安双禧中证 100 指数 分级	持有 1 年以下	0.50%
	持有 1 年（含）至 2 年	0.25%
	持有 2 年（含）及以上	0.00%
国联安优选行业股票	持有 1 年以下	0.50%
	持有 1 年（含）至 2 年	0.20%
	持有 2 年（含）及以上	0.00%
国联安上证商品 ETF 联接	持有 1 年以下	0.50%
	持有 1 年（含）至 2 年	0.30%
	持有 2 年（含）及以上	0.00%
国联安增利债券 A	90 天以下	0.30%
	90 天以上	0.00%
国联安增利债券 B	全部	0.00%
国联安货币	全部	0.00%
国联安信心增益债券	N < 30 天	0.90%
	30 天 N < 1 年	0.10%
	1 年 N < 2 年	0.05%
	N ≥ 2 年	0.00%

上述赎回费率可能根据本公司公告而进行调整，届时以最新公布的费率为准。

转入基金与转出基金的申购补差费按转入基金与转出基金之间申购费率的差额计算收取，具体计算公式如下：

转入基金与转出基金的申购补差费率 = max [(转入基金的申购费率—

转出基金的申购费率), 0], 即转入基金申购费率减去转出基金申购费率, 如为负数则取零。

目前, 本公司旗下已开通基金转换入业务的基金申购费率如下:

基金名称	申购金额(含申购费)	费率
国联安双禧中证100指数分级	100万以下	1.20%
	100万(含)至500万	0.70%
	500万(含)至1000万	0.20%
	1000万元(含)以上	每笔交易1000元
国联安上证商品ETF联接	100万以下	1.50%
	100万(含)至500万	0.70%
	500万元(含)以上	每笔交易1000元
国联安稳健混合 国联安小盘精选混合 国联安安心成长混合	100万以下	1.50%
	100万(含)至500万	1.00%
	500万元(含)以上	每笔交易1000元
国联安优选行业股票	50万元以下	1.50%
	50万元(含)至100万元	1.20%
	100万元(含)至500万元	0.80%
	500万元(含)至1000万元	0.30%
国联安精选股票(前端)	50万以下	1.50%
国联安优势股票(前端)	50万(含)至150万	1.00%
国联安红利股票(前端)	150万(含)至500万	0.60%
国联安主题驱动股票	500万(含)及以上	每笔交易1000元
国联安精选股票(后端)	持有1年以下	1.60%
国联安优势股票(后端)	持有1年(含)至3年	1.30%
国联安红利股票(后端)	持有3年(含)至5年	0.60%
	持有5年(含)及以上	0.00%
国联安增利债券A 国联安信心增益债券	100万以下	0.80%
	100万(含)至300万	0.50%
	300万(含)至500万	0.30%
	500万(含)及以上	每笔交易1000元
国联安增利债券B	全部	0.00%
国联安货币	全部	0.00%

上述申购费率可能根据本公司公告而进行调整, 届时以最新公布的费率为准。

前端份额之间转换的申购补差费率按转出金额对应转入基金的申购费率和转出基金的申购费率作为依据来计算。后端份额之间转换的申购补差费率为零, 因此申购补差费为零。

投资者通过网上直销平台办理前端收费模式下本基金与本公司旗下其他开通基金转换业务的开放式基金间的基金转换业务，享受转换费中相应前端申购补差费率优惠，其他费率标准不变。

基金管理人有权根据业务情况调整上述交易费用，并依据相关法规要求进行公告。

其他销售机构办理基金转换业务适用的转换费率将在开通时另行公告。

(2) 转换份额的计算公式：

转出金额 = 转出基金份额 × 转出基金当日基金份额净值

转换费用 = 转换手续费 + 转出基金的赎回费 + 申购补差费

其中：

转换手续费 = 0

赎回费 = 转出金额 × 转出基金赎回费率

申购补差费 = (转出金额 - 赎回费) × 申购补差费率 / (1 + 申购补差费率)

如果转入基金的申购费率 > 转出基金的申购费率

转换费用 = 转出基金的赎回费 + 申购补差费

如果转出基金的申购费率 > 转入基金的申购费率

转换费用 = 转出基金的赎回费

转入金额 = 转出金额 - 转换费用

转入份额 = 转入金额 / 转入基金当日基金份额净值

其中，转入基金的申购费率和转出基金的申购费率均以转出金额作为确定依据。

注：转入份额的计算结果四舍五入保留到小数点后两位。

(3) 基金转换业务举例：

例：某投资者于某日通过本公司网上交易平台将其持有的国联安精选股票基金 500,000 份转换为国联安安心成长混合基金。假设转换申请受理当日国联安精选股票基金的基金单位资产净值为 1.250 元，国联安安心成长混合基金的基金单位资产净值为 1.050 元，假设该投资者持有国联安精选股票基金不满 1 年，则

国联安精选股票基金赎回费 = 转出份额 × 国联安精选股票基金当日基金单位资产净值 × 国联安精选股票基金赎回费率

$$= 500,000.00 \times 1.250 \times 0.5\% = 312.50 \text{ 元}$$

申购补差费 = (转出金额 - 转出金额 × 转出基金赎回费率) × 申购补差费率 / (1 + 申购补差费率) =  $500,000 \times 1.250 - 500,000 \times 1.250 \times 0.5\%$  × 0.5% / (1 + 0.5%) = 3107.80 元

转入金额 = 转出份额 × 国联安精选股票基金当日基金单位资产净值 - 赎回费 - 申购补差费

$$= 500,000.00 \times 1.250 - 312.50 - 3107.80 = 621,579.70 \text{ 元}$$

转入份额 = 转入金额 / 国联安安心成长混合基金当日单位基金资产净值

$$= 621,579.70 / 1.050 = 591,980.67 \text{ 份}$$

#### (4) 业务规则：

基金转换以份额为单位进行申请。投资者办理基金转换业务时，转出方的基金必须处于可赎回状态，转入方的基金必须处于可申购状态。

基金转换采取未知价法，即以申请受理当日各转出、转入基金的单位资产净值为基础进行计算。

正常情况下，基金注册与过户登记人将在 T+1 日对投资者 T 日的基金转换业务申请进行有效性确认。在 T+2 日后（包括该日）投资者可通过本公司直销业务平台查询基金转换的成交情况。

目前基金转换的最低申请份额为 1000 份基金单位。基金份额持有最低为 100 份基金单位。如投资者办理基金转换出后该基金份额不足 100 份时，需一次性全额转出。单笔转入申请不受转入基金最低申购限额限制。

单个开放日基金净赎回份额及净转出申请份额之和超过上一开放日基金总份额的 10% 时，为巨额赎回。发生巨额赎回时，基金转出与基金赎回具有相同的优先级，基金管理人可根据基金资产组合情况，决定全额转出或部分转出，并且对于基金转出和基金赎回，将采取相同的比例确认。在转出申请得到部分确认的情况下，未确认的转出申请将不予以顺延。

目前，原有基金为前端收费的基金份额只能转换为其他前端收费的基金份额，后端收费的基金份额只能转换为其他后端收费的基金份额。

本公司有权根据市场情况调整上述转换的程序及有关限制，但最迟应在调整生效前按照《信息披露管理办法》在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

（5）暂停基金转换的情形及处理：

出现下列情况之一时，基金管理人可以暂停基金转换业务：

不可抗力的原因导致基金无法正常运作。

证券交易场所在交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

因市场剧烈波动或其他原因而出现连续巨额赎回，基金管理人认为有必要暂停接受该基金单位转出申请。

法律、法规、规章规定的其他情形或其他在《基金合同》、《招募说明书》已载明并获中国证监会批准的特殊情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应立即向中国证监会备案并于规定期限内至少在一种中国证监会指定媒体上刊登暂停公告。重新开放基金转换时，基金管理人应按照《信息披露办法》在至少一种中国证监会指定媒体上刊登重新开放基金转换的公告。

（6）重要提示：

基金发行期内不受理基金转入交易申请，该基金成立并开放申购赎回业务后受理基金转换业务。新基金的转换规定，以本公司公告为准。

本招募说明书仅对国联安稳健混合、国联安小盘混合、国联安安心混合、国联安精选股票、国联安优势股票、国联安红利股票、国联安增利债券 A、国联安增利债券 B、国联安主题驱动股票、国联安上证商品 ETF 联接和国联安货币的转换事项予以说明。

本公司有权根据市场情况调整上述转换的程序及有关限制，但最迟应在调整生效前按照《信息披露办法》在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

本基金转换业务的解释权归本公司。

## 八、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。

## 九、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。

## 十、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,对投资组合进行监控和调整,以实现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。

## 十一、投资业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为： $95\% \times$  上证大宗商品股票指数收益率 $+5\% \times$  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，于2011年4月20日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2011年3月31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	8,319,914.26	0.77
	其中：股票	8,319,914.26	0.77
2	基金投资	1,006,888,663.00	93.66
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	59,635,574.64	5.55
7	其他各项资产	234,325.50	0.02
8	合计	1,075,078,477.40	100.00

### 2、期末投资目标基金明细

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

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	1,006,888,663.00	94.08

3、报告期末按行业分类的股票投资组合

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	84,985.75	0.01
B	采掘业	2,822,927.19	0.26
C	制造业	5,338,728.78	0.50
C0	食品、饮料	283,135.23	0.03
C1	纺织、服装、皮毛	48,663.99	0.00
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	50,769.21	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	4,133,335.58	0.39
C5	电子	-	-

C6	金属、非金属	776,453.71	0.07
C7	机械、设备、仪表	46,371.06	0.00
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	37,382.40	0.00
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	35,890.14	0.00
	合计	8,319,914.26	0.78

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	600143	金发科技	210,921	3,859,854.30	0.36
2	601857	中国石油	22,994	273,628.60	0.03
3	601699	潞安环能	3,953	258,130.90	0.02
4	600547	山东黄金	4,734	248,535.00	0.02
5	601899	紫金矿业	32,051	243,908.11	0.02

6	601168	西部矿业	10,914	200,599.32	0.02
7	601088	中国神华	6,786	197,404.74	0.02
8	600489	中金黄金	5,299	193,201.54	0.02
9	600111	包钢稀土	2,189	191,209.15	0.02
10	600887	伊利股份	5,290	182,769.50	0.02

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名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名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、投资组合报告附注

（1）本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体中除紫金矿业外，没有出现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。

紫金矿业（601899）于2010年10月8日发布临时公告称，紫金矿业集团股份有限公司于2010年9月30日收到福建省环境保护厅下发的《福建省环境保护厅行政处罚决定书》，有关公司所属的紫金山金铜矿环境违法一案（即紫金山金铜矿铜矿湿法厂于2010年7月3日和7月16日先后两

次发生含铜酸性溶液渗漏，造成汀江重大水污染事故事宜），经福建省环境监测总队现场调查，现已审查终结，根据有关规定，省环保厅决定对紫金山金铜矿做出相应行政处罚。

本基金管理人在严格遵守法律法规、本基金《基金合同》和公司管理制度的前提下履行了相关的投资决策程序，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

（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。

（3）其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,551.41
5	应收申购款	220,774.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	234,325.50

（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）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 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	同期业绩比较基准收益率	-	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率标准差	-
2010-12-1 至 2010-12-31	-0.40%	5.17%	-5.57%	0.79%	1.70%	-0.91%
2011-1-1 至 2011-3-31	1.10%	2.08%	-0.98%	1.66%	1.70%	-0.04%
2010-12-1 至 2011-3-31	0.70%	7.36%	-6.66%	1.46%	1.69%	-0.23%

## 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：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

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：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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“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“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项纳税主体，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》、《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 2010 年 10 月 27 日刊登的本基金原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“六、基金的募集”部分的内容。
- 5、更新了“七、基金合同的生效”部分的内容。
- 6、更新了“八、基金份额的申购与赎回”部分的内容。
- 7、更新了“九、基金的投资”部分的内容。
- 8、新增了“十、基金的业绩”部分的内容。
- 9、更新了“十四、基金的费用与税收”部分的内容。
- 10、更新了“二十一、对基金份额持有人的服务”部分的内容。
- 11、新增了“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

二〇一一年七月十五日