广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金（QDII-LOF）

2017 年第 3 季度报告

2017 年 9 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年十月二十七日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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 2017 年 10 月 25 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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发道琼斯石油指数（QDII-LOF）
场内简称	广发石油
基金主代码	162719
交易代码	162719
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 2 月 28 日
报告期末基金份额总额	135,420,437.72 份
投资目标	本基金采用被动式指数化投资策略，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力求实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差的最小化。本基金力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超

	过 0.5%，年化跟踪误差不超过 5%。	
投资策略	本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数，以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为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上将根据标的指数成份券及其权重的变动进行相应调整，以拟合标的指数的业绩表现。	
业绩比较基准	95%×人民币计价的道琼斯美国石油开发与生产指数收益率+5%×人民币活期存款收益率（税后）。	
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，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。	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
境外资产托管人英文名称	BANK OF CHINA NEW YORK BRANCH	
境外资产托管人中文名称	中国银行纽约分行	
下属分级基金的基金简称	广发道琼斯石油指数（QDII-LOF）A	广发道琼斯石油指数（QDII-LOF）C
下属分级基金的场内简称	广发石油	-
下属分级基金的交易代码	162719	004243
报告期末下属分级基金的份额总额	124,161,036.35 份	11,259,401.37 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2017 年 7 月 1 日-2017 年 9 月 30 日)	
	广发道琼斯石油指数（QDII-LOF）A	广发道琼斯石油指数（QDII-LOF）C
1.本期已实现收益	-1,957,327.78	-195,000.21
2.本期利润	5,522,415.55	472,112.75
3.加权平均基金份额本期利润	0.0403	0.0376
4.期末基金资产净值	118,372,298.47	10,721,842.73
5.期末基金份额净值	0.9534	0.9523

1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、广发道琼斯石油指数（QDII-LOF）A：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	5.13%	1.12%	5.02%	1.18%	0.11%	-0.06%

2、广发道琼斯石油指数（QDII-LOF）C：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个	5.01%	1.12%	5.02%	1.18%	-0.01%	-0.06%

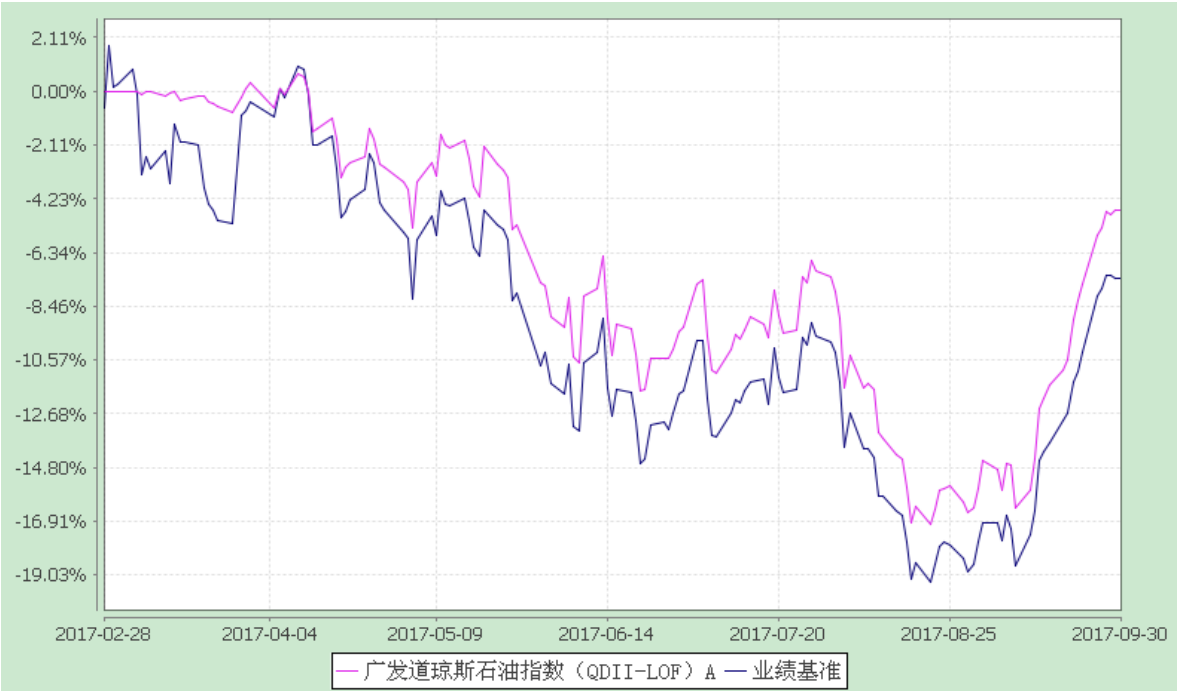
月						

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

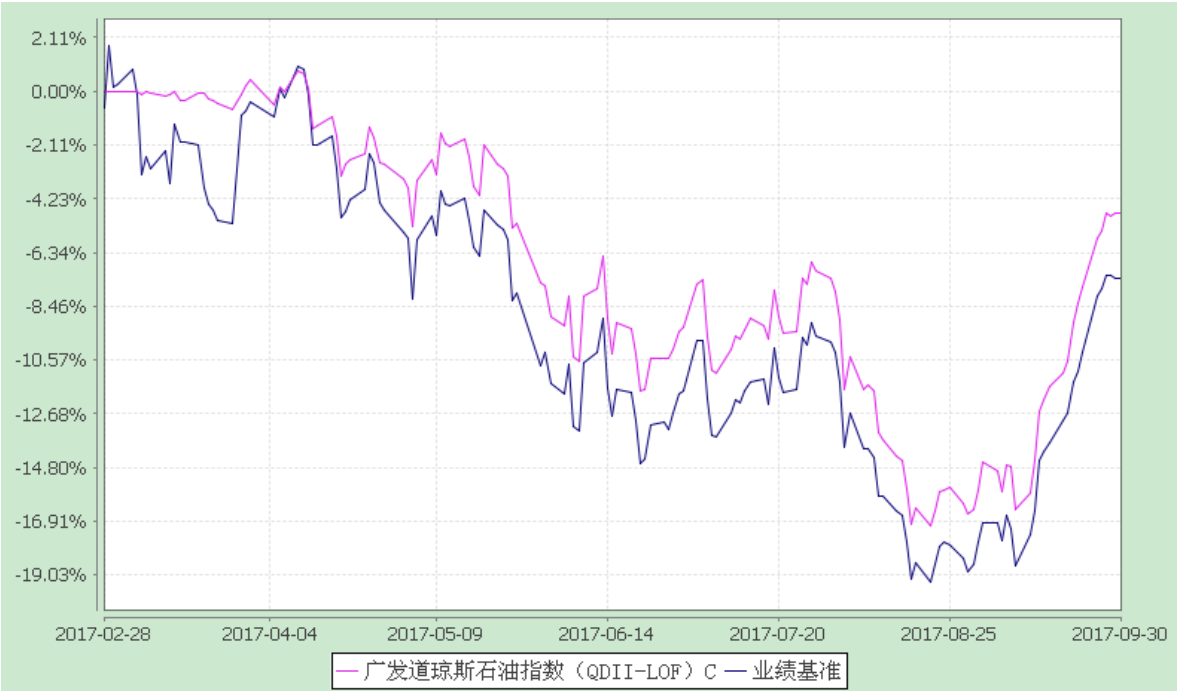
广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金（QDII-LOF）
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2017 年 2 月 28 日至 2017 年 9 月 30 日）

1．广发道琼斯石油指数（QDII-LOF）A：



2．广发道琼斯石油指数（QDII-LOF）C：



注：1、本基金合同生效日期为 2017 年 2 月 28 日，至披露时点本基金成立未满一年。

2、本基金建仓期为基金合同生效后六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
余昊	本基金的基金经理；广发沪港深股票基金的基金经理；广发全球精选股票(QDII)基金的基金经理	2017-02-28	-	7 年	男，中国籍，理学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书，2010 年 6 月至 2013 年 9 月先后在广发基金管理有限公司研究发展部和国际业务部任研究员，2013 年 9 月 10 日至

					2014 年 3 月 25 日任广发亚太精选股票(QDII)基金的基金经理助理，2014 年 6 月 4 日至 2015 年 4 月 19 日任国际业务部专户投资经理，2015 年 4 月 20 日至 2016 年 6 月 6 日任国际业务部研究员，2016 年 6 月 7 日起任广发沪港深股票基金的基金经理，2016 年 10 月 27 日起任广发全球精选股票(QDII)基金的基金经理，2017 年 2 月 28 日起任广发道琼斯石油指数（QDII-LOF）基金的基金经理。
李耀柱	本基金的基金经理；广发纳指 100ETF 基金的基金经理；广发美国房地产指数(QDII)基金的基金经理；广发纳斯达克 100 指数（QDII）基金的基金经理；广发全球农业指数（QDII）基金的基金经理；广发全球医疗保健（QDII）基金的基金经理；广发生物科技指数（QDII）基金的基金经理；广发亚太中高收益债券（QDII）基金的基金经理；	2017-03-10	-	7 年	男，中国籍，理学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书，2010 年 8 月至 2014 年 7 月在广发基金管理有限公司中央交易部任股票交易员，2014 年 8 月至 2015 年 12 月在国际业务部先后任 QDII 基金的研究员、基金经理助理，2015 年 12 月 17 日起任广发纳指 100ETF 基金的基金经理，2016 年 8 月 23 日起任广发全球农业指数(QDII)、广发纳斯达克 100 指数(QDII)、广发美国房地产指数(QDII)、广发亚太中高收益债券(QDII)、广发全球医疗保健(QDII)和广发生物科技指数(QDII)基金的基金经理，2016 年 11 月 9 日起任广发沪港深新起点股票基金的基金经理，2017 年 3 月

	广发沪港深新起点股票基金的基金经理；广发港股通恒生综合中型股指数基金的基金经理				10 日起任广发道琼斯石油指数（QDII-LOF）基金的基金经理，2017 年 9 月 21 日任广发恒生中型股指数（LOF）基金的基金经理。

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金（QDII-LOF）基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控与及时的分析评估，保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面，公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库，重点投资的股票必须来源于核心股票库。公司建立了严格的投资授权制度，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公平分配投资指令。监察稽核部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到

了公平对待，未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的，则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本投资组合为完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合。本报告期内，本投资组合与本公司管理的其他投资组合发生过同日反向交易的情况，但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的 5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

七月份，经济数据显示，上半年原油产量较去年同期增加，OPEC 减产计划未达到预期，市场对此表示质疑。OPEC 集体减产豁免国尼日利亚和利比亚原油增产幅度高于市场预期。美国油田钻井数增加，原油产量大幅上涨，库存持续增加，但需求减弱。但是七月中下旬，美国原油库存降幅超过预期，美国原油生产略有放缓，以及中国需求增加的迹象和美元走弱的提振，对油价形成一定程度的支撑。石油开发企业的盈利预期没有发生较大改变，　道琼斯石油开发指数在七月份走势波动。

八月份，原油期货累计下跌了 8%，原油库存下滑对油价的刺激作用正在减弱。哈维飓风威胁到美国炼油业核心地带，炼油厂关闭，使国内原油可用量增加。同时，市场对 OPEC 减产的执行力度丧失信心，市场预期石油价格的下行拖累上游企业的盈利，道琼斯石油开发指数持续下行。

九月份，月初受到飓风影响的炼油厂逐渐恢复，原油库存下滑，全球石油需求增幅预计创两年来最高。供需方面的利好支撑了油价的上涨。伊拉克库尔地区的独立公投，加剧了这一重要产油区发生冲突的风险，市场担心石油产量会受到影响,油价的上涨预期利好上游企业盈利。道琼斯石油开发指数在此期间

快速上涨。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类份额的净值增长率为 5.13%，C 类份额的净值增长率为 5.01%，同期业绩比较基准收益率为 5.02%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	124,567,613.61	94.48
	其中：普通股	124,567,613.61	94.48
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
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	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,048,352.73	5.35
8	其他各项资产	230,247.86	0.17
9	合计	131,846,214.20	100.00

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例（%）
美国	124,567,613.61	96.49
合计	124,567,613.61	96.49

注：国家（地区）类别根据股票及存托凭证所在的证券交易所确定。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
能源	124,567,613.61	96.49
信息技术	-	-
日常消费品	-	-
非日常生活消费品	-	-
公用事业	-	-
原材料	-	-
工业	-	-
金融	-	-
房地产	-	-
电信业务	-	-
医疗保健	-	-
合计	124,567,613.61	96.49

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.4 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称（英	公司名称（中	证券代码	所在	所属国	数量	公允价	占基金

	文）	文）		证券市场	家（地区)	（股）	值（人民币元）	资产净值比例（%）
1	CONOCOPHILLIPS	康菲石油	COP US	纽约证券交易所	美国	41,908.00	13,920,867.22	10.78
2	EOG RESOURCES INC	EOG 资源	EOG US	纽约证券交易所	美国	19,882.00	12,765,311.78	9.89
3	PHILLIPS 66	-	PSX US	纽约证券交易所	美国	14,870.00	9,041,055.30	7.00
4	VALERO ENERGY CORP	Valero 能源	VLO US	纽约证券交易所	美国	15,315.00	7,819,482.42	6.06
5	MARATHON PETROLEUM CORP	马拉松石油公司	MPC US	纽约证券交易所	美国	17,485.00	6,507,870.70	5.04
6	ANADARKO PETROLEUM CORP	阿纳达科石油	APC US	纽约证券交易所	美国	19,217.00	6,230,392.86	4.83
7	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	Pioneer 自然资源公司	PXD US	纽约证券交易所	美国	5,858.00	5,736,201.79	4.44
8	CONCHO RESO	康丘资源公司	CXO US	纽约证券交易	美国	5,104.00	4,461,980.44	3.46

	URCES INC			所				
9	DEVON ENERGY CORP	戴文能源	DVN US	纽约证券交易所	美国	17,963.00	4,376,516.08	3.39
10	APACHE CORP	阿帕契	APA US	纽约证券交易所	美国	12,908.00	3,923,645.02	3.04

注：以上代码为当地交易所市场代码。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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名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。

5.8 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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

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十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内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。

5.10.2 报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,555.16
4	应收利息	8,436.56
5	应收申购款	97,709.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	122,546.93
8	其他	-
9	合计	230,247.86

5.10.4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。

5.10.5 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发道琼斯石油指数（QDII-LOF）A	广发道琼斯石油指数（QDII-LOF）C
本报告期期初基金份额总额	151,511,085.94	13,657,822.10
报告期基金总申购份额	1,097,852.44	478,811.73
减：报告期基金总赎回份额	28,447,902.03	2,877,232.46
报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期期末基金份额总额	124,161,036.35	11,259,401.37

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在运用固有资金（认）申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

（一）中国证监会注册广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金（QDII-LOF）募集的文件

（二）《广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金（QDII-LOF）基金合同》

（三）《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》

（四）《广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金（QDII-LOF）托管协议》

（五）法律意见书

8.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

8.3 查阅方式

1.书面查阅：查阅时间为每工作日 8:30-11:30，13:30-17:00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；

2.网站查阅：基金管理人网址：http://www.gffunds.com.cn。

广发基金管理有限公司

二〇一七年十月二十七日