

广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金（QDII-LOF）

2019年第1季度报告

2019年3月31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：二〇一九年四月二十二日

§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2019年4月18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2019年1月1日起至3月31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	74,770,367.36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	39,050,512.25 份	35,719,855.11 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 (2019年1月1日-2019年3月31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	-213,909.81	-190,804.50
2.本期利润	3,245,839.59	2,828,261.06
3.加权平均基金份额本期利润	0.0846	0.0808
4.期末基金资产净值	37,568,981.54	34,663,745.53
5.期末基金份额净值	0.9621	0.9704

(1) 所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。

(2) 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。

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	9.88%	1.46%	9.45%	1.44%	0.43%	0.02%

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
过去三个月	9.91%	1.46%	9.45%	1.44%	0.46%	0.02%

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（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2019年3月31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:



§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		
李耀柱	本基金的基金经理；广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基 金的基金经理；广发沪港深新起点股票型证券投资基金的基金经理；广 发海外多元配置证券投资基金(QDII)的基	2017-03-10	2019-04-12	9年	李耀柱先生，理学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司中央交易部股票交易员、国际业务部研究员、基金经理助理、国际业务部总经理助理、广发亚太中高收益债券型证券投资基金基金经理（自 2016 年 8 月 23 日至 2017 年 11 月 9 日）、广发标普全球农业指数

	基金经理；广发科技动力股票型证券投资基金的基金经理；广发恒生中国企业精明指数型发起式证券投资基金(QDII)的基金经理；国际业务部副总经理				证券投资基金基金经理（自2016年8月23日至2018年9月20日）、广发美国房地产指数证券投资基金基金经理（自2016年8月23日至2018年9月20日）、广发全球医疗保健指数证券投资基金基金经理（自2016年8月23日至2018年9月20日）、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金基金经理（自2016年8月23日至2018年9月20日）、广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)基金经理（自2017年9月21日至2018年10月16日）。
刘杰	本基金的基金经理；广发沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；广发中证500交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)的基金经理；广发沪深300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中小板300交易型开	2018-08-06	-	15年	刘杰先生，工学学士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司信息技术部系统开发专员、数量投资部研究员、广发沪深300指数证券投资基金基金经理（自2014年4月1日至2016年1月17日）、广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金基金经理（自2016年1月25日至2018年4月25日）、广发量化稳健混合型证券投资基金基金经理（自2017年8月4日至2018年11月30日）。

放式指数证券投资基金的基金经理；广发中小板300交易型开放式指数证券投资基 金联接基金的基金经理；广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基 金发起式联接基金的基金经理；广发中证养老产业指数量型发起式证券投资基金的基金经理； 广发中证军工交易型开放式指数证券投资基 金的基金经理；广发中证军工交易型开 放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发中证环保产 业交易型开放 式指数证券投资基 金的基金经理；广发创 业板交易型开 放式指数证券 投资基金的基 金经理；广发创 业板交易型开 放式指数证 券投资基金发 起式联接基金的基金经理； 广发标普全球 农业指数证券				
--	--	--	--	--

投资基金的基金经理；广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)的基金经理；广发美国房地产指数证券投资基金的基金经理；广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发纳斯达克100指数证券投资基金的基金经理；广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发全球医疗保健指数证券投资基金的基金经理；指数投资部总经理助理					
--	--	--	--	--	--

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。
- 3.根据本基金管理人发布的《广发基金管理有限公司广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金（QDII-LOF）基金经理变更公告》，自2019年4月12日起，李耀柱先生不再担任本基金基金经理。

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，投资的债券必须来自公司债券库。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。金融工程与风险管理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

本基金主要采用完全复制法来跟踪道琼斯美国石油开发与生产指数，按照个股在标的指数中的基准权重构建股票组合，呈现出股票型基金特征。

2019年1季度，全球股市普遍上涨。美国市场方面，道琼斯工业指数上涨11.15%，标普500上涨13.07%，纳斯达克100上涨16.57%，道琼斯美国石油开发与生产指数上涨12.67%；欧洲市场方面，富时100指数上涨8.19%，法国CAC40指数上涨13.10%，德国DAX指数上涨9.16%；全球其他市场方面，香港恒生指数，H股指数，日经225指数等都出现不同程度的上涨。

整体而言，美国经济基本面总体依然稳健，2019年原油市场出现触底反弹，逐步摆脱2018年4季度地缘政治带来的负面影响，原油库存逐步回到正常水平，原油价格将趋于稳定，相关上下游企业的盈利也将趋于稳定。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的A类份额净值增长率为9.88%，C类份额净值增长率为9.91%，同期业绩比较基准收益率为9.45%。

§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	66,318,103.52	89.16
	其中：普通股	66,318,103.52	89.16
	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	6,466,175.66	8.69
8	其他各项资产	1,593,163.79	2.14
9	合计	74,377,442.97	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	66,318,103.52	91.81
合计	66,318,103.52	91.81

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（%）
原材料	-	-
信息技术	-	-
日常消费品	-	-
非日常生活消费品	-	-
公用事业	-	-

医疗保健	-	-
通信服务	-	-
工业	-	-
金融	-	-
房地产	-	-
电信业务	-	-
能源	66,318,103.52	91.81
合计	66,318,103.52	91.81

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（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	CONOCOPHILLIPS	康菲石油	COP US	纽约证券交易所	美国	20,008.00	8,991,470.95	12.45
2	EOG RESOURCES INC	EOG 资源	EOG US	纽约证券交易所	美国	10,167.00	6,515,974.69	9.02
3	MARATHON PETROLEUM CORP	马拉松石油公司	MPC US	纽约证券交易所	美国	12,294.00	4,954,481.69	6.86
4	PHILLIPS 66	-	PSX US	纽约证券交易所	美国	7,578.00	4,856,188.48	6.72
5	VALERO ENERGY CORP	Valero 能源	VLO US	纽约证券交易所	美国	7,636.00	4,361,704.62	6.04

6	PIONEER NATURAL RESOURCES CO.	Pioneer自然资源公司	PXD US	纽约证券交易所	美国	3,101.00	3,179,695.26	4.40
7	ANADARKO PETROLEUM CORP	阿纳达科石油	APC US	纽约证券交易所	美国	9,137.00	2,798,111.04	3.87
8	CONCH RESOURCES INC	康丘资源公司	CXO US	纽约证券交易所	美国	3,640.00	2,719,622.94	3.77
9	DIAMONDBACK ENERGY INC	Diamondback能源股份有限公司	FANG US	纳斯达克证券交易所	美国	2,857.00	1,953,194.49	2.70
10	CHENIER ENERGY INC	Cheniere能源公司	LNG US	纽约证券交易所	美国	4,109.00	1,891,381.16	2.62

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 根据公开市场信息，本基金投资的前十名证券的发行主体在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	7,232.46
4	应收利息	8,989.67
5	应收申购款	1,368,285.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	208,656.08
8	其他	-
9	合计	1,593,163.79

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	37,389,119.67	31,507,549.83
报告期基金总申购份额	12,912,745.72	19,765,318.98
减：报告期基金总赎回份额	11,251,353.14	15,553,013.70
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	39,050,512.25	35,719,855.11

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 影响投资者决策的其他重要信息

为了能够更好满足更多投资者的理财需求、更好地服务投资者，按照《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》（以下简称《基金合同》）的相关规定，基金管理人决定于2019年1月28日对本基金增设美元现汇基金份额（基金代码为：A份额006679，C份额006680），并自该日起接受投资者对美元现汇基金份额的申购。经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，基金管理人对原《基金合同》中的相关内容进行相应修订。详情可见本基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《关于广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金（QDII-LOF）新增美元现汇份额并修改基金合同的公告》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1.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
- 2.《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》
- 3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- 4.《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》
- 5.法律意见书

9.2 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

9.3 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
二〇一九年四月二十二日