

# 广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金 (QDII-LOF) (广发道琼斯石油指数 (QDII-LOF) 美 元A) 基金产品资料概要更新

编制日期: 2024年6月19日

送出日期: 2024年6月24日

本概要提供本基金的重要信息, 是招募说明书的一部分。  
作出投资决定前, 请阅读完整的招募说明书等销售文件。

## 一、产品概况

基金简称	广发道琼斯石油指数 (QDII-LOF)	基金代码	162719
下属基金简称	广发道琼斯石油指数 (QDII-LOF) 美元 A	下属基金代码	006679
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 中国银行纽约分行
境外投资顾问	-	境外托管人	Bank of China New York Branch
基金合同生效日	2017-02-28		
基金类型	股票型	交易币种	美元
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	姚曦	开始担任本基金 基金经理的日期	2022-11-15
		证券从业日期	2015-07-29

其他  
《基金合同》生效后, 连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不  
满 200 人或者基金资产净值 (含各类基金份额的基金资产净值) 低于  
5,000 万元人民币情形的, 基金管理人应当在定期报告中予以披露; 连  
续六十个工作日出现前述情形的, 基金管理人应当向中国证监会报告  
并提出解决方案, 如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合  
同等, 并召开基金份额持有人大会进行表决。  
法律法规另有规定时, 从其规定。

注: 本基金自 2019 年 1 月 28 日起增设 A 类美元现汇份额、C 类美元现汇份额, 自 2023 年  
11 月 7 日起增设 E 类人民币份额、E 类美元现汇份额。

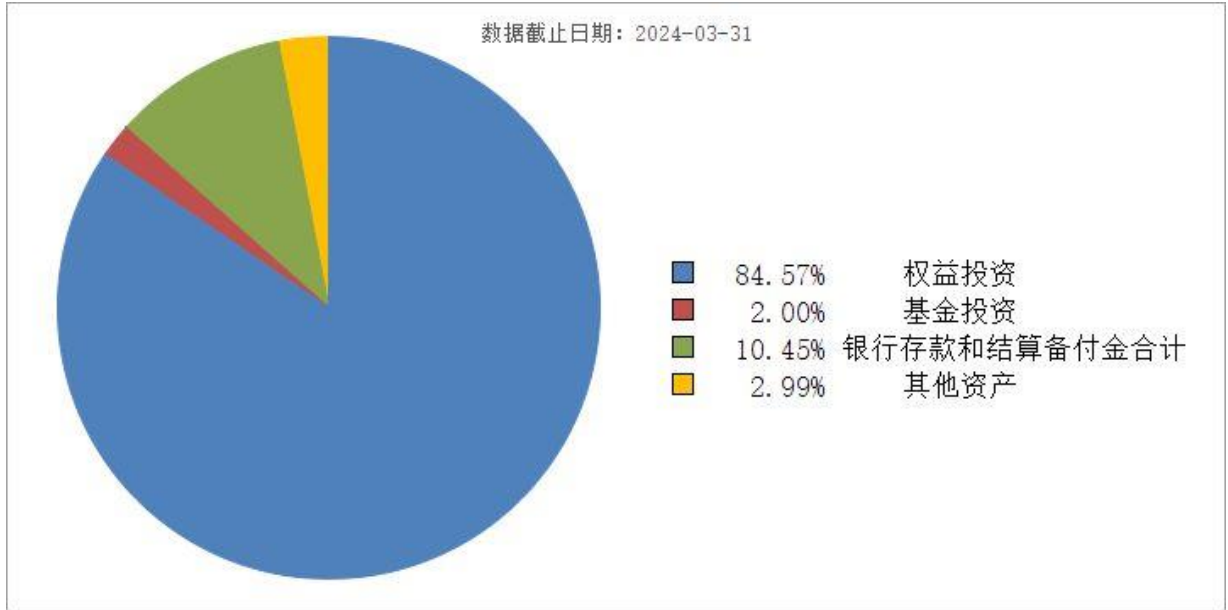
## 二、基金投资与净值表现 (一) 投资目标与投资策略

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%。

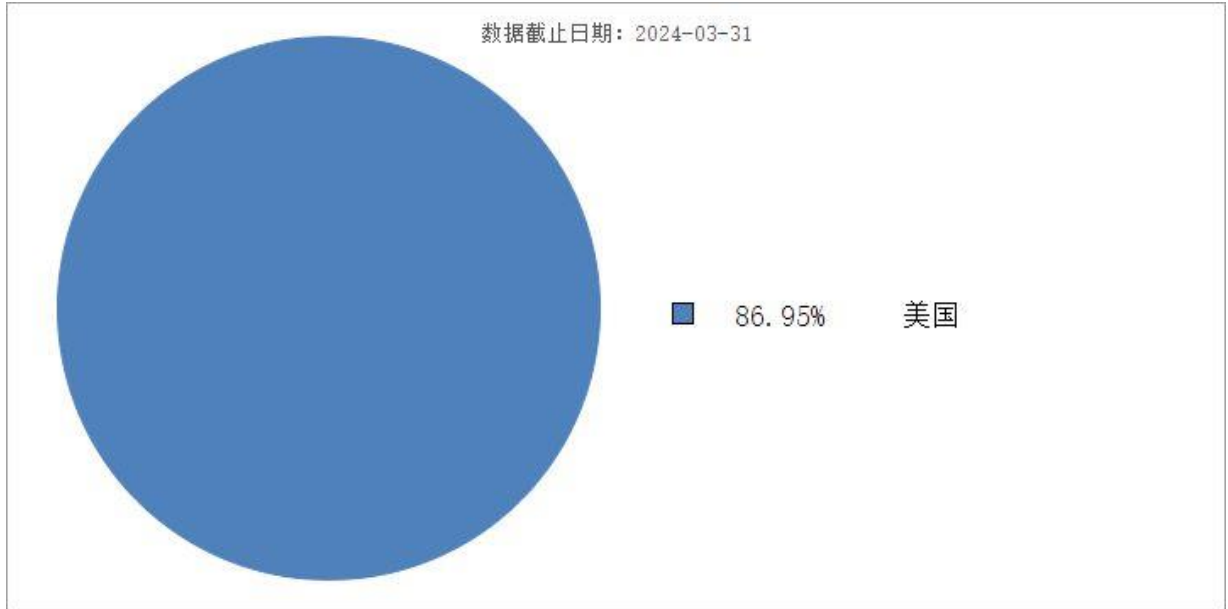
<p><b>投资范围</b></p>	<p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括道琼斯美国石油开发与生产指数的成份股、备选成份股、跟踪道琼斯美国石油开发与生产指数的公募基金、上市交易型基金等。本基金还可投资全球证券市场中具有良好流动性的其他金融工具，包括已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证，已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金，与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品，远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品，政府债券、公司债券、可转换债券等固定收益类证券，银行存款、短期政府债券等货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。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。本基金的标的指数为道琼斯美国石油开发与生产指数。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金投资于道琼斯美国石油开发与生产指数的成份股、备选成份股的比例不低于基金资产的80%，且不低于非现金基金资产的80%，投资于跟踪道琼斯美国石油开发与生产指数的公募基金、上市交易型基金的比例不超过基金资产净值的10%，在扣除需缴纳的交易保证金后，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%。</p> <p>如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。</p>
<p><b>主要投资策略</b></p>	<p>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。具体策略包括：</p> <p>(1) 资产配置策略；(2) 权益类投资策略；(3) 固定收益类投资策略；(4) 衍生品投资策略。</p>
<p><b>业绩比较基准</b></p>	<p>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）</p>
<p><b>风险收益特征</b></p>	<p>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。</p>

注：详见《广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金(QDII-LOF)招募说明书》及其更新文件中“基金的投资”。

**(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表**  
**投资组合资产配置图表**



区域配置图表



注：1、区域配置图数据取自定期报告的“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”。

2、各国家（地区）投资分布比重为占基金资产净值比例。

(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



注：1、本基金份额成立当年（2017年）按实际存续期计算，未按自然年度折算。  
2、基金的过往业绩不代表未来表现。

### 三、投资本基金涉及的费用

#### （一）基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) /持有期限 (N)	收费方式/费率	备注
申购费（前收费）	$M < 20$ 万元	1.20%	
	$20 \text{ 万元} \leq M < 50$ 万元	0.80%	
	$50 \text{ 万元} \leq M < 100$ 万元	0.40%	
	$M \geq 100$ 万元	200 美元/笔	
赎回费	$N < 7$ 日	1.500%	
	$7 \text{ 日} \leq N < 730$ 日	0.125%	
	$N \geq 730$ 日	0.000%	

注：1、本基金的申购费用由申购人承担，可用于市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金资产；基金销售机构可以对销售费用实行一定的优惠，具体以实际收取为准。  
2、申购金额单位为美元。

#### （二）基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率或金额	收费方
管理费	1.00%	基金管理人、销售机构
托管费	0.30%	基金托管人
审计费用	72,000.00	会计师事务所

信息披露费	120,000.00	规定披露报刊
指数许可使用费	年费率 0.05%，每年费用下限 3 万美元，具体收费方式详见《招募说明书》或其更新。	指数编制公司
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的律师费、基金份额持有人大会费用、基金的证券交易费用、基金的银行汇划费用、基金相关账户的开户及维护费用等费用，以及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。费用类别详见本基金《基金合同》及《招募说明书》或其更新。	相关服务机构

注：1、本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。  
2、审计费用、信息披露费为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准（金额单位为人民币元）。

### （三）基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

基金运作综合费率（年化）
1.33%

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

## 四、风险揭示与重要提示

### （一）风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

#### 1、本基金特有的风险

（1）指数化投资的风险：本基金作为股票指数基金，在日常投资管理中持有标的指数的成份股、备选成份股的比例不低于基金资产的 80%，且不低于非现金基金资产的 80%，具有股票市场的系统性风险，不能规避市场下跌的风险和个股风险。

（2）标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险：标的指数并不能完全代表整个目标股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个目标股票市场的平均回报率可能存在偏离。

（3）标的指数波动的风险：标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

（4）基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险：标的指数调整成份股或变更编制方法、标的指数成份股发生配股和增发等行为、成份股派发现金红利和新股市值配售收益、基金管理人的管理能力、各种费用及税收、法律法规的限制或其他限制等因素均可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离。

（5）标的指数变更的风险：尽管可能性很小，如出现变更标的指数的情形，本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致，投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

（6）跟踪误差控制未达约定目标的风险：本基金力争将本基金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控制在 0.5% 以内，年化跟踪误差不超过 5%，但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

（7）指数编制机构停止服务的风险：本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护，本基金将根据基金合

同的约定自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案,如更换基金标的指数、转换运作方式,与其他基金合并、或者终止基金合同等,并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决,基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的,本基金合同终止。投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式,与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定并实施前,基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作,该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异,从而影响投资收益。

(8) 成份券停牌的风险:成份券可能因各种原因临时或长期停牌。发生停牌时,基金可能面临因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大的风险。

(9) 基金运作的特有风险

1) 基金合同生效后,本基金A类基金份额将在深圳证券交易所上市交易,由于上市期间可能因特定原因导致基金停牌,投资者在停牌期间不能买卖A类基金份额,产生风险;同时,可能因上市后流动性不足导致A类基金份额产生流动性风险;另外,当本基金A类基金份额存续期内不满足深圳证券交易所规定的上市条件时,本基金A类基金份额存在暂停上市或终止上市的可能。

2) 基金份额净值波动风险:本基金为股票指数型基金,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。

3) 基金份额的折/溢价交易风险:本基金A类基金份额上市交易后,由于受到市场供求关系的影响,其交易价格与A类基金份额净值可能出现偏离并出现折/溢价风险。

2、境外投资的风险

本基金投资于美国证券市场,证券市场价格会因为国际政治环境、宏观和微观经济因素、国家政策、投资人风险收益偏好和市场流动程度等各种因素的变化而波动,将对本基金资产产生潜在风险,这种风险主要包括:海外市场风险、汇率风险、政治风险、法律和政府管制风险、会计核算风险、税务风险等。

3、开放式基金的共有风险

(1) 流动性风险;(2) 管理风险;(3) 大额赎回风险;(4) 金融模型风险;(5) 衍生品投资风险;(6) 证券借贷、正回购/逆回购风险;(7) 操作风险;(8) 本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险等。

4、其他风险

## (二) 重要提示

中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益作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,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金产品资料概要信息发生重大变更的,基金管理人将在三个工作日内更新,其他信息发生变更的,基金管理人每年更新一次。因此,本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后,如需及时、准确获取基金的相关信息,敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告及定期报告等。

如投资者对基金合同有争议的,争议解决处理方式详见基金合同“争议的处理和适用的法律”部分或相关章节。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见广发基金官方网站 [www.gffunds.com.cn] [客服电话:95105828 或 020-83936999]

- (1)《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》
- (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)托管协议》
- (3)《广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金(QDII-LOF)招募说明书》

- (4) 定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- (5) 基金份额净值
- (6) 基金销售机构及联系方式
- (7) 其他重要资料