

广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金(QDII-LOF)

2018年半年度报告摘要

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: 二〇一八年八月二十四日

1 重要提示

基金管理人的董事会、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，并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签署同意，并由董事长签发。

基金托管人: 中国银行股份有限公司根据基金合同约定，于2018年8月22日复核了本报告中的财务报表、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息，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信经营、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及其更新。

本半年度报告摘要披露于半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告全文。

本报告经审计。

本报告期自2018年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	广发道琼斯石油指数(QDII-LOF)
场内简称	广发石油
基金代码	162719
基金运作方式	上市开放式基金
基金合同生效日	2017年2月28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
报告期末基金资产总额	47,206,526.24份
基金合同的存续期间	不定期
基金上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2017年3月17日
下属分级基金的基金简称	广发道琼斯石油指数(QDII-LOF)A
下属分级基金的基金代码	162719
下属分级基金的基金名称	广发石油
下属分级基金的基金代码	-
下属分级基金的基金代码	162719
报告期末下属分级基金的份额总额	34,406,680.96份
报告期末下属分级基金的资产净值	12,799,947.36份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动式指数投资策略，通过严格的投资限制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，从而获得良好的小波段收益。
投资策略	本基金主要通过被动指数投资，在严格控制风险的前提下，力争在中长期取得与所跟踪的指数相当的回报。
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%×人民币活期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险收益特征高于混合型基金，证券投资风格具有货币风险收益特征。本基金将指数基金与货币基金结合，通过定期调整资产配置比例，实现货币基金与指数基金的双重收益。

2.3 基金管理人和基金托管人	
项目	境外投资顾问
名称	广发基金管理有限公司
姓名	段树勇
信息披露负责人	联系方式 020-66960966 电子邮箱 rongfu@fundsfchina.com 客户服务电话 9510626-026-53096999 传真 020-80899168 (010)66954942

2.4 境外投资顾问和境外客户服务托管人	
项目	境外投资顾问
名称	BANK OF CHINA NEW YORK BRANCH
英文	-
中文	-
注册地址	1046 Avenue of the Americas, New York City, New York, County, New York 10018
办公地址	1046 Avenue of the Americas, New York City, New York, County, New York 10018
邮政编码	-

2.5 信息披露方式	
本基金管理人信息披露报备表名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告的管理人互联网网址	http://www.gfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海市徐汇区漕溪路120号15层1505-305号、北京市西城区复兴门内大街1号

3 主要会计数据和财务指标

3.1 主要会计数据

单位: 人民币元

报告期(2018年1月1日至2018年6月30日)

广发道琼斯石油指数(QDII-LOF)C

本期已实现收益 2,369,767.66

本期利润 7,099,576.71

加权平均基金份额本期利润 0.1311

本期基金份额净增长率为 14.08%

14.67%

注: (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将低于所列数字。

(2) 本期已实现收益指基金利息收入、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) 期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润之和(为期末余额, 不是当期发生数)。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

广发道琼斯石油指数(QDII-LOF)C

份额增长率为 13.38% 业绩比较基准收益率为 14.08%

注: (1) 本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将低于所列数字。

(2) 业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

3.2.2 自基金成立以来基金总份额累计净值增长率变化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)

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图对比如图

(2018年2月28日至2018年6月30日)

广发道琼斯石油指数(QDII-LOF)A

份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图对比如图

(2018年2月28日至2018年6月30日)

广发道琼斯石油指数(QDII-LOF)C

份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图对比如图

(2018年2月28日至2018年6月30日)

广发道琼斯石油指数(QDII-LOF)A

</