广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金

2019年第二季度报告

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:二〇一九年七月十八日

§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7月16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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发中证全指能源ETF
场内简称	全指能源
基金主代码	159945
交易代码	159945
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015年6月25日
报告期末基金份额总额	47,572,327.00份
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。
投资策略	本基金主要采取完全复制法、抽样复制法等指数化投资方法,并根据标的指数成份股及其权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的95%。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证全指能源指数。
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

§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4月1日-2019年6月30日)
1.本期已实现收益	22,672.71
2.本期利润	-1,308,101.51
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0275
4.期末基金资产净值	31,382,803.27
5.期末基金份额净值	0.6597

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

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	-4.25%	1.62%	-5.43%	1.62%	1.18%	0.00%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计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

广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年6月25日至2019年6月30日)

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
陆志明	本基金的基金经理;广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发中证全指证券公司指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理;广发中证全指金融地产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;广发中证全指可选消费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;广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发中证全指原材料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;广发中证全指工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;广发中证全指医药卫生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;广发中证全指金融地产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;广发中证全指证券公司指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理;广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接