

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

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，实现投资指令的事后风险控制；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（完全复制制指数组合及量化组合除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果出现对大额赎回等特殊情

需要进行反向交易的，则需经公司领导严格审批并留档备查。

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易易量占该证券当日成交量的5%的交易共4次，均为指数化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析
报告期内，本基金主要采取完全复制法投资策略跟踪指数，即按照标的指数的成份股构成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。报告期内，本基金交易和申购赎回正常，运作过程中未发生风险事件。

2019年二季度，受中美贸易问题反复、上市公司年报和一季报的财报数据偏

弱以及预期流动性不再宽松等因素的影响，二季度市场出现了一定程度下跌，上

证综指下跌3.62%，深证成指下跌7.35%，创业板指下跌10.75%，中小板指下跌

10.95%，而中证全指能源指数下跌5.43%。二季度原油价格呈现出先涨后跌的行情，这是由于一些机构下调了全球经济增速的预期，导致原油的需求面临压制，而

价格下跌使得美国页岩气供给有放缓迹象，但地缘政治因素使得油价不可能大幅度的下跌，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，本基金的份额净值增长率为-4.25%，同期业绩比较基准收益率为-5.43%。

4.6报告期内基金持有人人数或基金净值预警说明
本报告期内，本基金于2019年4月1日至2019年6月30日期间出现了基金资产净值

低于五千万元的情形。基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	30,366,802.88	88.11
2	固定收益投资	-	-
3	其中：股票	30,366,802.88	88.11
4	其中：债券	-	-
5	其中：资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其中：买入返售金融资产	-	-
10	其中：买入返售的买入返售金融资产	-	-
11	银行存款和结算备付金合计	586,038.43	1.69
12	其他资产	31,461,929.06	90.20
13	合计	31,461,929.06	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而5.2的合计项不含可退替代款估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	25,353,897.73	76.26
C	制造业	4,847,426.49	15.46
D	电力、热力、燃气及生产供应业	221,563.09	0.71
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,002,025.04	3.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,196.64	0.04
J	金融业	241,139.09	0.77
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	5,016,973.22	1.65
合计		30,366,802.88	88.16

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

5.3 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投资

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601088	中国神华	153,400	3,126,250.00	9.06
2	600028	中国石化	526,191	2,508,367.77	7.13
3	601057	中国石油	406,347	2,795,756.39	8.05
4	601226	陕西能源	282,400	2,701,776.00	6.81
5	600066	广汇能源	297,568	1,600,627.26	4.58
6	000723	美锦能源	89,760	557,852.00	2.09
7	600567	永泰能源	545,030	915,654.40	2.62
8	600048	华鲁恒升	161,580	961,688.80	2.74
9	600058	五矿有色	159,742	829,427.72	2.36
10	002583	杰瑞股份	36,000	808,500.00	2.34

5.4 报告期末按债券品种和分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资

明细
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序的前十名资产支持

证券投资组合明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投

资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

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五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.18 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.19 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.20 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.21 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.22 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.23 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.24 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.25 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.26 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.27 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.28 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.29 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.30 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.31 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.32 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.33 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.34 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.35 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.36 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.37 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.38 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.39 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.40 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.41 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.42 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.43 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.44 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.45 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.46 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.47 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.48 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.49 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.50 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.51 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.52 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.53 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.54 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.55 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.56 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.57 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.58 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.59 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.60 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.61 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.62 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.63 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.64 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.65 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.66 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.67 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.68 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.69 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.70 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.71 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.72 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.73 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.74 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.75 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.76 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.77 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.78 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.79 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.80 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.81 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.82 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.83 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.84 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资