广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金 (QDII-LOF)

2020 年第 4 季度报告

2020年12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:二〇二一年一月二十一日



§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 2021 年 1 月 19 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 2020 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

№ 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	593,662,948.42 份
	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
+n次口仁	投资组合对标的指数的有效跟踪,追求跟踪误差的
投资目标 	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%。



	I				
	本基金为被动管理的指数	型基金,在正常情况下,			
	力争将本基金净值增长率	区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, 年跟			
	踪误差控制在 5%以内。如因标的指数编制规则调				
	整或其他因素导致跟踪偏	高度和跟踪误差超过上			
	述范围,基金管理人应采品	取合理措施避免跟踪偏离			
投资策略	度、跟踪误差进一步扩大	0			
1又页 來峭	本基金投资于道琼斯美国	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	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%。				
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				
业坝比权奉任	数收益率+5%×人民币活其	明存款收益率(税后)。			
	本基金为股票型基金, 网	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			
风险收益特征	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、以及标识	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 Y	ORK 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)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	392,668,245.22 份	200 004 703 20 1	
份额总额	392,008,243.22 []]	200,994,703.20 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

	报告期			
主要财务指标	(2020年10月1日-	2020年12月31日)		
土女则分泪你	广发道琼斯石油指数	广发道琼斯石油指数		
	(QDII-LOF) A	(QDII) C		
1.本期已实现收益	2,519,800.43	896,497.18		
2.本期利润	66,020,373.83	16,231,615.67		
3.加权平均基金份额本期利润	0.1606	0.1198		
4.期末基金资产净值	299,990,144.59	154,493,336.64		
5.期末基金份额净值	0.7640	0.7686		

- 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 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	1)-3	2-4
----	---------	-------------------	------------	--------------	------	-----

过去三个 月	28.14%	3.39%	28.39%	3.46%	-0.25%	-0.07%
过去六个 月	0.71%	2.87%	-0.86%	2.94%	1.57%	-0.07%
过去一年	-19.64%	3.70%	-36.60%	4.18%	16.96%	-0.48%
过去三年	-26.00%	2.49%	-41.36%	2.76%	15.36%	-0.27%
自基金合 同生效起 至今	-23.60%	2.25%	-41.19%	2.50%	17.59%	-0.25%

2、广发道琼斯石油指数(QDII) 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	27.97%	3.39%	28.39%	3.46%	-0.42%	-0.07%
过去六个 月	0.42%	2.87%	-0.86%	2.94%	1.28%	-0.07%
过去一年	-19.98%	3.69%	-36.60%	4.18%	16.62%	-0.49%
过去三年	-25.40%	2.49%	-41.36%	2.76%	15.96%	-0.27%
自基金合 同生效起 至今	-23.14%	2.25%	-41.19%	2.50%	18.05%	-0.25%

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金(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2020年12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)C:



84 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

		任本基金	的基金经		
Lil 😝	TI 5	理其	阴限	证券从业	УД нП
姓名	职务	任职日	离任日	年限	说明
		期	期		
刘杰	本经证开券基发易数金(经深开券基发易数金基发型证的广易数金基理通型 (L经国证基理 5放投金中型证联的了3放投金沪型证联金创开券基发型证发金;恒股投O理房券金;0式资经证开券接的广交指基理 3放投基理板式资经业放投式基发综数基的广产资基发易数金;0式资基基发易数金;0式资金;交指基理板式资联金港合证金基发指基基发易数金;0式资基基发易数金;交指基理板式资联金港合证金基发指基金中型证的广交指基金金沪型证的广交指基的广易数金;交指基接经股中券 金美数金	2018-08-06		17 年	刘持处是,是一个人工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工

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;广发的斯达克 100 指数型发起式 证产发纳斯 达克生物科技 技数型发起式 证产发码工作 证券投资基金定值。2018 证券投资基金度值。2018 年4月26日至 2019年 11月14日)、广发中证环保产 业交易型开放式指数证券 投资基金度值。2018 年4月26日至 2019年 11月14日)、广发标营 全球农业指数理(自 2018 年8月6日至 2020年2 投资基金的基金经理;广发相明报券投资 基金经理;广发恒明报券投资 基金(QDII)的基金问题, 管辖中国企业 精明报券投资 基金(QDII)的基金问题, 证券投资理;广发物新放式基金 的方式基金。 的方式是中证决定 创新取式人基本。 创新取式人基本。 的方式是中证决定 创新取式人基本。 的方式是中证决定 创新取式人基本。 的方式是中证决定 创新取式人基本。 可定为投资。 是中证券投资。 是中证券投资。 是中证券投资。 是中证为发产。 是中证为发产。 是中证为发产。 是中证为发产。 是中证为发产。 是中证为发产。 是中证为发产。 是中证为发产。 是中证为发产。 是中证为发产。 是中证为发产。 是中证为发产。 是中证为发产。 是中证为发产。 是中证为发产。 是中证为发产。 是中证为产。 是中证为产。 是中证为产。 是中证为产。 是中证为产。 是中证为产。 是中证为产。 是中证为产。 是中证为产。 是中证为产。 是中证为产。 是中证为产。 是产。 是产。 是产。 是产。 是产。 是产。 是产。 是产。 是产。 是		1	ı	
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 100 指数证券投资 基金的数量经	的基金经理;			
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 指数型发起式 指数型发起或的基金经理自 2018 年 4 月 26 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发标普 全球企建的基金经理(自 2018 年 4 月 26 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发标普 全球企业指数证券投资基金是组(自 2018 年 8 月 6 日至 2020 年 2 月 28 日)。	广发纳斯达克			(自 2016年9月26日至
投资基金的基金经理: 广发纳斯达克 100 指数证券投资基金经理的 2017 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金发理: 广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金发理: 广发较惠金发起式联接基金基金经理(自 2018 年 4 月 26 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发标普全球农业指数证券投资基金 6 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发标普全球农业指数证券投资基金。 1 月 15 日至 2020 年 2 月 28 日)。	100 交易型开			2019年11月14日)、广
金经理;广发 纳斯达克 100 指数证券投资基金经理(自 2017 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证环保产业交易型开放式指数证产发物科技 基金基金经理(自 2018 年 4 月 26 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发标普 2 生物科技 指数型发起式	放式指数证券			发中证环保产业交易型
朝斯达克 100 指数证券投资基金的基金经理: 广发帕斯 达克生物科技	投资基金的基			开放式指数证券投资基
朝斯达克 100 指数证券投资基金的基金经理: 广发帕斯 达克生物科技	金经理;广发			金基金经理(自2017年1
基金的基金经理;广发纳料技	纳斯达克 100			,
基金的基金经理;广发纳料技	指数证券投资			14 日)、广发中证环保产
基金基金经理(自 2018 年 4 月 26 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发标普全球农业指数证券投资基金的基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2020 年 2 月 28 日)。 基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2020 年 2 月 28 日)。 基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2020 年 2 月 28 日)。 基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2020 年 2 月 28 日)。 基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2020 年 2 月 28 日)。 基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2020 年 2 月 28 日)。 基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2020 年 2 月 28 日)。				,
基金基金经理(自 2018 年 4 月 26 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发标普全球农业指数证券投资基金的基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2020 年 2 月 28 日)。 基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2020 年 2 月 28 日)。 基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2020 年 2 月 28 日)。 基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2020 年 2 月 28 日)。 基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2020 年 2 月 28 日)。 基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2020 年 2 月 28 日)。 基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2020 年 2 月 28 日)。				券投资基金发起式联接
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的基金经理; 广发管理; 广发性指数的基金经理; 广发性相数型发起。的基金经理; 广发中国企业特别证券投资基金。经经理; 广发中国分别型投资基金。(QDII)的基金。在一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个发展,不是一个企业,是一个发展,是一个一个发展,是一个一个发展,是一个发展,是一个发展,是一个一个发展,是一个一个发展,是一个发展,是一个发展,是一个发展,是一个发展,是一个发展,是一个一个发展,是一个一个一个发展,是一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个				
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(自 2018 保健指数证券投资基金的基金经理; 恒生中国企业精损数型发展起式(QDII)的基金经理; 广发中央企创新驱动指数。证券投资基金的发资理; 广发中驱动交易型开放式指数。证券投资基金的发验理; 广发等。对于方式。 一种,一种,一种,一种,一种,一种,一种,一种,一种,一种,一种,一种,一种,一				,
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; 广发 恒生中国企业 精明指数型发 基本金(QDII) 的基金全理; 广发中驱动方指数 证券投资基金 的基金经理; 广发中驱动方指数 证券投资基金 的基金经理; 广发中驱动交易 型开放式指数 证券投资基金 的基金经理; 广发下逐 创新驱动者指数 证券投资基金 的基金经理; 广发 零 港澳大 湾区 创新 100 交易型开放式 指数证券投资				
广发全球医疗保健指数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超式证券投资基金(QDII)的基金(QDII)的基金(QDII)的基金(WPT),在1000000000000000000000000000000000000				, , , , , , , , , , , , , , , , , , ,
保健指数证券 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)的基金企证央企 创新驱动充制数 证券投经理; 广发中驱动充制数 证券投经理; 广发中驱动式指数 证券投资基金 的基金的广发 粤港澳大湾区 创新 100 交易型开放式 指数证券投资 等选经理; 广发粤港澳大 湾区创新 100 交易型开放式 指数证券投资				
投资基金的基金经理; 广发恒生中国企业精明企业发展, (20II) 的基金企业, (20II) 的基金经理; (20II) 产发中心的新业企业, (20II) 产发中心的新生。 (20II) 产发中心的新生。 (20II) 产发中心的新生。 (20II) 产发中心的一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个				`
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;广发和驱动产发数基金的型开放交易型开放资基金的基本中证交易型开放资基金的基本。 (QDII)的基本企业中企创新政党基金的基本企业中企创新政党基金的基本企业,广发与创新 100 交易型开放资基金的基金经理,广发与创新 100 交易型开放资格数证券投资	7			, , , , , , , , , , , , , , , , , , , ,
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;广发中证交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发驱动指数证券金经理;广发驱动指数证券基金的发生。 电调新 100 交易型开放式基金的基金经理;广发电创新 100 交易型开放式指数证券投资理;广发图创新 100 交易型开放式指数证券投资) 1 20 Д) о
精明指数型发 基本金(QDII)的产生。 一种				
起式证券投资基金(QDII)的基金全理; 广方的基金经理; 广方新驱动交易型开放改基金。 的发生。 创新开放资基。 的发生。 创新开放资基。 一定是一个一个。 一定是一个一个。 一定是一个一个。 一定是一一个。 一定是一个。 一定是一一。 一定是一一。 一定是一。 一定是一。 一定是一。 一定是一。 一定是一。 一定是一。 一定是一。 一定是一。 一定是一。 一定是一。 一定是一。 一定是一。 一定是一。 一定是一。 一。 一。 一。 一。 一。 一。 一。 一。 一。 一。 一。 一。 一	, , , , , , , ,			
基金(QDII)的常生。 的基金经理; 广定中心的新驱动。 力量,一位的一个人。 一位的一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一				
的基金经理; 广创新驱动式指数 证券收资基盘; 广发中证动式指数。 证券金经理; 广发则新放资基金, 证券基金, 证券基金, 证券基金, 是粤港澳大 湾区创新 100 交易型开放式 指数证券投资 是粤港澳大 湾区创新 100 交易型开放式 指数证券投资				
广发中证央企创新驱动交易型开放资基金的基金全理; 广发型中企创新驱动式指数证券交易型开放资基金联接基金的基金经理; 广发粤港澳大湾区创新100交易型开放式指数证券投资基金的基金经理; 广发粤港澳大湾区创新100交易型开放式指数证券投资	. ~			
创新驱动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理; 广发中企创新驱动交易型开放资基金联接基金的基金经理; 广发粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理; 广发粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资				
型开放式指数 证券投资基金 的基金经理; 广发中亚动式指数 证券投资基金 联接基金 联接基金 联接基金 联接基金 以	, , , , , , , ,			
证券投资基金的基金经理; 广发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券基金的基金经理; 广发粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理; 广发粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资				
的基金经理; 广发中企 创新驱动交易 型开放资基金 联接基金的基金的基金经理; 冷寒港澳大湾区创新 100 交易 型开放资基金的基金经理; 广发粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式 指数证券投资				
广发中证央企 创新驱动交易 型开放式指数 证券投资基金 联接基金的基 金经理; () 粤港澳大湾区 创新 100 交易 型开放式指数 证券投资基金 的基金经理; 广发粤港澳大 湾区创新 100 交易型开放式 指数证券投资				
创新驱动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理;广发粤港澳大湾区创新100交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发粤港澳大湾区创新100交易型开放式指数证券投资				
型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理;广发粤港澳大湾区创新100交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发粤港澳大湾区创新100交易型开放式指数证券投资				
证券投资基金 联接基金的基 金经理; 广发 粤港澳大湾区 创新 100 交易 型开放式指数 证券投资基金 的基金经理; 广发粤港澳大 湾区创新 100 交易型开放式 指数证券投资				
联接基金的基金经理; 广发粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理; 广发粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资				
金经理; 广发 粤港澳大湾区 创新 100 交易 型开放式指数 证券投资基金 的基金经理; 广发粤港澳大 湾区创新 100 交易型开放式 指数证券投资				
粤港澳大湾区 创新 100 交易 型开放式指数 证券投资基金 的基金经理; 广发粤港澳大 湾区创新 100 交易型开放式 指数证券投资				
创新 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理; 广发粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式 指数证券投资	金经理;广发			
型开放式指数证券投资基金的基金经理; 广发粤港澳大湾区创新 100交易型开放式指数证券投资	粤港澳大湾区			
证券投资基金的基金经理; 广发粤港澳大 湾区创新 100 交易型开放式 指数证券投资	创新 100 交易			
的基金经理; 广发粤港澳大 湾区创新 100 交易型开放式 指数证券投资	型开放式指数			
广发粤港澳大 湾区创新 100 交易型开放式 指数证券投资	证券投资基金			
湾区创新 100 交易型开放式 指数证券投资	的基金经理;			
交易型开放式 指数证券投资	广发粤港澳大			
指数证券投资	湾区创新 100			
	交易型开放式			
基金联接基金	指数证券投资			
	基金联接基金			

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。

4.2报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定,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,公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度,投资组合的投资标的必须来源于公司备选库,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量超过该证券当日成交量的 5%的交易共 1 次,为指数量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业绩表现说明

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,呈现出股票型指数基金的特征。

2020年四季度,A股呈现震荡上行趋势,整个季度沪深300指数上涨13.60%,中证500指数上涨2.82%,创业板指数上涨15.21%。美股同样呈现上涨行情,整个季度纳斯达克100指数上涨12.88%,标普500指数上涨11.69%,均在四季度中创出历史新高。

近期的美联储 FOMC 会议上调了经济预期指标,但是我们认为货币政策收紧为时尚早。根据 12 月 17 日公布的 FOMC 会议决议,基准利率水平将维持不变,购债规模也将大致保持不变,而经济、通胀和就业指标得到小幅上调。联储主席鲍威尔表示在美国通胀重回正轨之前,美联储不会提前加息。考虑到北半球冬季疫情再次严峻,以及联储"平均通胀目标制",美国货币政策正常化进程仍较为缓慢。在抗击疫情方面,美国 12 月启动新冠疫苗接种计划,经济活动有望加速恢复。美国食品和药物管理局于 12 月 11 日首次批准了辉瑞制药与德国生物新技术公司联合研发的新冠疫苗的紧急使用授权申请。这两家公司在 11 月份发布的III期临床试验中期分析数据显示,疫苗有效性超过 90%。如果该疫苗接种能够顺利进行,美国商业活动将有望回归正常。

展望一季度,欧美市场依然值得关注。伴随着疫苗接种人数的增加,欧美经济有望实现共振复苏,同时通胀将温和回升。因尚不具备加息条件,美联储货币政策将不会突然转向,资产购买计划将在第一季度持续进行。在这样的政策环境下,欧美股市估值继续提升的可能性变小,股市上涨的动力来自上市企业的业绩改善。道琼斯美国石油开发与生产指数由美国市场中从事石油勘探、生产的企业组成,旨在反映美国石油开发和生产行业的整体表现。

本报告期内,本基金 A 类基金份额净值增长率为 28.14%, C 类基金份额净值增长率为 27.97%,同期业绩比较基准收益率为 28.39%。

%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	393,618,078.82	82.90
	其中: 普通股	393,618,078.82	82.90
	存托凭证	-	1
	优先股	-	1
	房地产信托	-	1
2	基金投资	29,299,293.51	6.17
3	固定收益投资	-	1
	其中:债券	-	1
	资产支持证券	-	1
4	金融衍生品投资	-	1
	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	47,960,888.05	10.10
8	其他资产	3,938,568.72	0.83
9	合计	474,816,829.10	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	393,618,078.82	86.61
合计	393,618,078.82	86.61

注: 1、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。

2、ADR、GDR按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

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	-	1
非日常生活消费品	-	1
公用事业	-	1
医疗保健	-	1
通信服务	-	1
工业	-	1
金融	-	1
房地产	-	1
能源	393,618,078.82	86.61
合计	393,618,078.82	86.61

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 金 产 值 例 (%)
1	ConocoPhilli ps	康菲石油	COP US	纽约证券交易所	美国	214,170. 00	55,883,538. 94	12.30
2	Phillips 66	-	PSX US	纽约证	美国	87,810.0 0	40,072,225. 74	8.82

			l	<i>M</i> .				
				券交易所				
3	EOG Resources Inc	EOG 资源	EOG US	纽约证券交易所	美国	119,725. 00	38,958,127. 45	8.57
4	Marathon Petroleum Corp	马拉松石 油公司	MPC US	纽约证券交易所	美国	134,460. 00	36,286,701. 91	7.98
5	Concho Resources Inc	康丘资源 公司	CXO US	纽约证券交易所	美国	48,457.0 0	18,448,932. 58	4.06
6	Valero Energy Corp	Valero 能 源	VLO US	纽约证券交易所	美国	49,133.0 0	18,135,658. 16	3.99
7	Cheniere Energy Inc	Cheniere 能源公司	LNG US	纽约证券交易所	美国	46,100.0 0	18,056,897. 34	3.97
8	Pioneer Natural Resources Co	Pioneer 自 然资源公 司	PXD US	纽约证券交	美国	23,745.0	17,645,404. 84	3.88

第13页,共17页

				易所				
9	Hess Corp	赫斯公司	HES US	纽约证券交易所	美国	47,553.0 0	16,379,605. 69	3.60
1 0	Diamondbac k Energy Inc	Diamondba ck 能源股 份有限公 司	FAN G US	纳斯达克证券交易所	美国	39,632.0 0	12,515,990. 10	2.75

注: 此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

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



			>			占基	
			运			金资	
序	序 基金名称 号	其今夕称	基金	作	管理人	公允价值	产净
号		类型	方	日生八	(人民币元)	值比	
			式			例	
						(%)	
1	iShares U.S. Oil & Gas Exploration &	ETF 基金	开放	BlackRock Fund Advisors	29,299,293.51	6.45	
	Production ETF	(五) 717.	式	1 4114 7 14 15015			

5.10 投资组合报告附注

- **5.10.1** 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,报告编制目前一年内未受到公开谴责、处罚。
- **5.10.2** 本报告期内,基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

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	86,386.41
4	应收利息	2,620.98
5	应收申购款	3,797,683.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	51,878.17
8	其他	-
9	合计	3,938,568.72

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。

% 开放式基金份额变动

单位:份

福口	广发道琼斯石油指	广发道琼斯石油指
项目	数(QDII-LOF)A	数(QDII)C
报告期期初基金份额总额	413,177,522.22	89,600,070.02
报告期期间基金总申购份额	241,860,466.02	197,007,686.88
减:报告期期间基金总赎回份额	262,369,743.02	85,613,053.70
报告期期间基金拆分变动份额(份		
额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	392,668,245.22	200,994,703.20

終7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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。

88 备查文件目录

8.1 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

8.2 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

8.3 查阅方式

- 1.书面查阅: 投资者可在营业时间免费查阅, 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 二〇二一年一月二十一日