广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金

（QDII-LOF）

2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 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：二〇二六年十月二十七日

§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约定，于 2026 年 10 月 23 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 2026 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 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	石油 LOF
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	259,790,361.11 份
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%。

投资策略	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离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 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%。		
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%×人民币活期存款收益率（税后）		
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		
境外资产托管人英文名称	Bank of China New York 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-LOF）C	广发道琼斯石油指数（QDII-LOF）E
下属分级基金的场内简称	石油 LOF	-	-

下属分级基金的交易代码	162719	004243	019710
报告期末下属分级基金的份额总额	174,746,367.48 份	70,501,067.09 份	14,542,926.54 份

注：广发道琼斯石油指数（QDII-LOF）A含A类人民币份额（份额代码：162719）及A类美元现汇份额（份额代码：006679），交易代码仅列示A类人民币份额代码；广发道琼斯石油指数（QDII-LOF）C含C类人民币份额（份额代码：004243）及C类美元现汇份额（份额代码：006680），交易代码仅列示C类人民币份额代码；广发道琼斯石油指数（QDII-LOF）E含E类人民币份额（份额代码：019710）及E类美元现汇份额（份额代码：019711），交易代码仅列示E类人民币份额代码。

§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 (2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日)		
	广发道琼斯石油指数（QDII-LOF）A	广发道琼斯石油指数（QDII-LOF）C	广发道琼斯石油指数（QDII-LOF）E
1.本期已实现收益	46,728,722.44	15,734,273.10	3,049,507.82
2.本期利润	108,598,925.77	31,687,554.44	5,752,010.01
3.加权平均基金份额本期利润	0.4977	0.4382	0.4155
4.期末基金资产净值	517,237,398.28	205,000,722.05	42,387,868.69
5.期末基金份额净值	2.9599	2.9078	2.9147

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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④	①－③	②－④
过去三个月	17.28%	1.57%	17.71%	1.58%	-0.43%	-0.01%
过去六个月	1.25%	1.73%	2.65%	1.73%	-1.40%	0.00%
过去一年	29.50%	1.58%	33.02%	1.62%	-3.52%	-0.04%
过去三年	23.80%	1.53%	26.28%	1.56%	-2.48%	-0.03%
过去五年	139.90%	1.82%	129.70%	1.85%	10.20%	-0.03%
过去七年	231.34%	2.22%	146.60%	2.36%	84.74%	-0.14%
自基金合同生效起至今	195.99%	2.04%	113.52%	2.17%	82.47%	-0.13%

2、广发道琼斯石油指数（QDII-LOF）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	17.21%	1.57%	17.71%	1.58%	-0.50%	-0.01%
过去六个月	1.11%	1.73%	2.65%	1.73%	-1.54%	0.00%
过去一年	29.11%	1.58%	33.02%	1.62%	-3.91%	-0.04%
过去三年	22.65%	1.53%	26.28%	1.56%	-3.63%	-0.03%
过去五年	135.64%	1.82%	129.70%	1.85%	5.94%	-0.03%
过去七年	222.19%	2.22%	146.60%	2.36%	75.59%	-0.14%
自基金合	190.78%	2.04%	113.52%	2.17%	77.26%	-0.13%

同生效起至今						

3、广发道琼斯石油指数（QDII-LOF）E：

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	17.18%	1.57%	17.71%	1.58%	-0.53%	-0.01%
过去六个月	1.06%	1.73%	2.65%	1.73%	-1.59%	0.00%
过去一年	28.93%	1.58%	33.02%	1.62%	-4.09%	-0.04%
自基金合同生效起至今	23.68%	1.54%	27.78%	1.57%	-4.10%	-0.03%

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 2026 年 9 月 30 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-LOF）C：



3、广发道琼斯石油指数（QDII-LOF）E：



§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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
姚曦	本基金的基金经理；广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)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的基金经理；广发中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指汽车交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发上海金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理；广发上海金交易型开放式证券投资基金的基金经理；广发中证工程机械主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证稀有金属主题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；广发中证工程机械主题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；广发中证全指食品交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指食品交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；广发中证细分化工产业主题指数型发起式证券投资基金的基金经理	2022-11-15	-	11.2 年	姚曦先生，中国籍，商科硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发期货有限公司发展研究中心研究员、广发基金管理有限公司指数投资部研究员、广发中证京津冀协同发展主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2021 年 11 月 23 日至 2022 年 12 月 21 日)、广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2021 年 11 月 23 日至 2023 年 6 月 11 日)、广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2021 年 11 月 23 日至 2023 年 6 月 11 日)、广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2023 年 6 月 12 日至 2023 年 7 月 24 日)、广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2023 年 6 月 12 日至 2023 年 7 月 24 日)、广发中证光伏龙头 30 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2022 年 11 月 16 日至 2023 年 12 月 13 日)、广发中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2022 年

					10 月 19 日至 2026 年 6 月 10 日)、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2023 年 2 月 22 日至 2026 年 6 月 10 日)、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基金经理(自 2023 年 2 月 22 日至 2026 年 6 月 17 日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2022 年 11 月 15 日至 2026 年 8 月 22 日)。

注：1.对基金的首任基金经理，“任职日期”为基金合同生效日/转型生效日，“离任日期”为公司公告解聘日期。对此后的非首任基金经理/基金经理助理，“任职日期”和“离任日期”分别指公司公告聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从中国证监会及行业协会相关规定。

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，通过持续完善工作制度、流程和提高技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司还通过事后分析、监察稽核和信息披露等手段加强对公平交易过程和结果的监督。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，按照“时间优先、价格优先、比例分配、平等对待”的原则，公平分配投资指令。公司对投资交易实施全程动态监控，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；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，本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%的交易共有 29 次，其中 27 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，其余 2 次为不同投资经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关投资经理按规定履行了审批程序。

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

本基金跟踪的标的指数为道琼斯美国石油开发与生产指数。该指数由美国市场石油勘探、生产、运输、精炼等企业组成，对国际原油价格的表征性较好。

2026 年三季度，国际油价呈现"持续攀升、高位运行"的强势格局，与二季度的"冲高回落"形成根本性逆转。报告期内，美伊冲突全面升级，全球约五分之一原油和成品油运输面临物理性中断。供给端冲击推动国际油价持续攀升，美国石油勘探生产企业直接受益于油价上涨和能源安全溢价。

本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股构成及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运作正常，未发生风险事件。

本报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 17.28%，C 类基金份额净值增长率为 17.21%，E 类基金份额净值增长率为 17.18%，同期业绩比较基准收益率为 17.71%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	691,260,759.20	88.28
	其中：普通股	691,260,759.20	88.28
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	16,160,978.06	2.06
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	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	73,509,574.25	9.39

8	其他资产	2,122,978.94	0.27
9	合计	783,054,290.45	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	691,260,759.20	90.41
合计	691,260,759.20	90.41

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）存托凭证按照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（%）
能源	691,260,759.20	90.41
原材料	-	-
工业	-	-
非日常生活消费品	-	-
日常消费品	-	-
医疗保健	-	-
金融	-	-
信息技术	-	-
通讯业务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	691,260,759.20	90.41

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

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)	占基金资产净值比例（%）

1	ConocoPhillips	康菲石油	COP US	纽约证券交易所	美国	139,561.00	117,635,654.98	15.38
2	Valero Energy Corp	Valero 能源	VLO US	纽约证券交易所	美国	34,261.00	89,441,496.31	11.70
3	Marathon Petroleum Corp	马拉松石油公司	MPC US	纽约证券交易所	美国	33,090.00	88,125,064.38	11.53
4	Phillips 66	菲利浦 66	PSX US	纽约证券交易所	美国	18,946.00	32,578,374.17	4.26
5	Devon Energy Corp	戴文能源公司	DVN US	纽约证券交易所	美国	100,352.00	31,117,549.97	4.07
6	EOG Resources Inc	EOG 资源	EOG US	纽约证券交易所	美国	33,410.00	30,998,712.63	4.05
7	Diamondback Energy Inc	戴蒙德巴	FANG US	纳斯	美国	24,539.00	30,378,760.08	3.97

		克能源		达克证券交易所				
8	EQT Corp	EQT 公司	EQT US	纽约证券交易所	美国	87,538.00	28,629,868.05	3.74
9	Texas Pacific Land Corp	德克萨斯州太平洋土地公司	TPL US	纽约证券交易所	美国	9,677.00	21,236,153.59	2.78
10	Expand Energy Corp	Expand 能源公司	EXE US	纳斯达克证券交易所	美国	37,272.00	21,109,167.12	2.76

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

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	ProShares Ultra Energy	股票型	交易型开放式	ProShare Advisors LLC	16,160,978.06	2.11

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本报告期内，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，报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.10.2 本报告期内，本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库的情况。

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	77,429.34
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,029,622.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	15,927.10
8	其他	-
9	合计	2,122,978.94

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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发道琼斯石油指数（QDII-LOF）A	广发道琼斯石油指数（QDII-LOF）C	广发道琼斯石油指数（QDII-LOF）E
报告期期初基金份额总额	267,498,608.46	75,540,481.71	13,541,016.58
报告期期间基金总申购份额	-	12,813,711.22	4,623,000.31
减：报告期期间基金总赎回份额	92,752,240.98	17,853,125.84	3,621,090.35
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	174,746,367.48	70,501,067.09	14,542,926.54

注：本基金份额变动含人民币份额及美元现汇份额。

§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。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期无需要披露的单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

§9 备查文件目录

9.1 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

9.2 存放地点

广东省广州市海珠区琶洲大道 168 号星河湾中心 28-38 层；广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

9.3 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 www.gffunds.com.cn。

广发基金管理有限公司

二〇二六年十月二十七日