

广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金  
(QDII-LOF) A 类份额  
上市交易公告书

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

注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：深圳证券交易所

上市时间：2017 年 3 月 17 日

公告日期：2017 年 3 月 14 日

---

## 目录

一、	重要声明与提示 .....	1
二、	基金概览 .....	1
三、	基金的募集与上市交易 .....	2
四、	持有人户数、持有人结构及前十名持有人 .....	7
五、	基金主要当事人简介 .....	8
六、	基金合同摘要 .....	12
七、	基金财务状况 .....	12
八、	基金投资组合 .....	12
九、	重大事件揭示 .....	17
十、	基金管理人承诺 .....	17
十一、	基金托管人承诺 .....	17
十二、	备查文件目录 .....	18
附件：	广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金（QDII-LOF） 基金合同摘要 .....	19

## 一、 重要声明与提示

广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金（QDII-LOF）（以下简称“本基金”）A 类份额上市交易公告书（以下简称“本公告”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 1 号〈上市交易公告书的内容与格式〉》、《深圳证券交易所交易规则》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制， 本基金管理人广发基金管理有限公司的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。本基金托管人中国银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本公告未涉及的有关内容，请投资者详细查阅 2017 年 1 月 12 日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及广发基金管理有限公司网站（[www.gffunds.com.cn](http://www.gffunds.com.cn)）上公告的《广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金（QDII-LOF）招募说明书》。

## 二、 基金概览

### （一）基金名称

广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金（QDII-LOF）

#### 1. A 类份额

①基金代码： 162719

②基金简称：广发石油指数QDII-A

③场内简称：广发石油

#### 2. C 类份额

①基金代码： 004243

②基金简称：广发石油指数QDII-C

### （二）基金类型

股票型证券投资基金

### （三）基金的运作方式

上市契约型开放式

### （四）基金存续期限

不定期

### （五）基金份额总额

本基金总份额 249,702,673.44 份，其中 A 类份额 226,911,405.10 份， C 类份额

---

22,791,268.34份。(截至 2017 年 3月 10 日)

(六) 基金份额净值

A 类份额 0.9999元,C 类份额0.9999元。(截至 2017 年 3 月 9 日)

(七) 本次上市交易份额

A 类人民币份额 166,904,565.00 份(截至 2017 年 3 月 10 日)

(八) 上市交易的证券交易所

深圳证券交易所

(九) 上市交易日期

2017 年 3 月 17 日

(十) 基金管理人

广发基金管理有限公司

(十一) 基金托管人

基金托管人为中国银行股份有限公司

境外资产托管人为中国银行纽约分行

(十二) 上市推荐人

无

### 三、 基金的募集与上市交易

(一) 本基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会证监许可[2016]2484号。

2、基金合同生效日：2017年2月28日。

3、基金运作方式：上市契约型开放式

4、基金合同期限：不定期。

5、发售日期：

A类份额：自2017年1月16日至2017年2月17日止

C类份额：自2017年1月16日至2017年2月15日止

6、发售价格：人民币1.00元。

7、发售方式：本基金以场外和场内两种方式进行发售

8、发售机构

**直销机构：**

(1) 广州分公司

地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 17 楼

直销中心电话：020-89899073

---

传真：020-89899069 020-89899070

(2) 北京分公司

地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 D 座 11 层

电话：010-68083368

传真：010-68083078

(3) 上海分公司

地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴东路 166 号 905-10 室

电话：021-68885310

传真：021-68885200

(4) 网上交易系统

投资者可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购等业务，具体交易细则请参阅本公司网站公告。

本公司网上交易系统网址：[www.gffunds.com.cn](http://www.gffunds.com.cn)

本公司网址：[www.gffunds.com.cn](http://www.gffunds.com.cn)

客服电话：95105828（免长途费）或 020-83936999

客服传真：020-34281105

**场内发售机构：**

爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财富里昂、财通证券、长城证券、长江证券、网信证券、川财证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、申万宏源西部证券、宏信证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、开源证券、联储证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、中泰证券、国融证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申万宏源证券、世纪证券、首创证券、太平洋证券、天风证券、九州证券、万和证券、万联证券、西部证券、西藏东方财富证券、西南证券、长城国瑞、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信浙江、中信山东、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券（排名不分先后）

**场外发售机构：**

(1) 名称：中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号

---

法定代表人：田国立

客户服务电话：95566

公司网址：www.boc.cn

（2）名称：广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

电话：020-87555888

传真：020-87557985

客服电话：95575或致电各地营业网点

公司网站：www.gf.com.cn

（3）名称：平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南中路 1099 号

办公地址：深圳市深南中路 1099 号

法定代表人：孙建一

联系人：蔡宇洲

电话：0755-22197874 25879591

传真：0755-22197701

客服电话：95511-3

公司网站：http://bank.pingan.com

（4）名称：中国邮政储蓄银行

注册地址：北京市西城区宣武门西大街 131 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：李国华

联系人：栗先生

电话：010-68857763

传真：010-68858859

客服电话：95580

---

公司网址: [www.psbcb.com](http://www.psbcb.com)

(5) 名称: 上海天天基金销售有限公司

注册地址: 上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址: 上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 7 楼

法定代表人: 其实

联系人: 潘世友

联系电话: 021-54509998

业务传真: 021-64385308

客服热线: 4001818188

(6) 名称: 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

注册地址: 杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

办公地址: 浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人: 陈柏青

联系人: 张裕

联系电话: 021-60897840

业务传真: 0571-26697013

客服热线: 4000-766-123

公司网址: [www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

(7) 名称: 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址: 北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15

办公地址: 北京经济开发区科创十一街 18 号院京东集团总部大楼 A 区 17 层

法定代表人: 陈超

联系人: 江卉

电话: 13141319110

传真: 010-89188000

客服电话: 400-088-8816

公司网址: <http://jr.jd.com/>

(8) 名称: 上海好买基金销售有限公司

注册地址: 上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址: 上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

---

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

联系电话：021-58870011

业务传真：021-68596916

客服热线：4007009665

公司网址：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

（9）名称：浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

办公地址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 楼

法定代表人：凌顺平

联系人：杨翼

联系电话：0571-88911818-8565

业务传真：0571-86800423

客服热线：0571-88920897、4008-773-772

公司网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

9、验资机构名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）

10、募集资金总额及入账情况

本基金于 2017 年 1 月 16 日起公开募集，基金募集工作已于 2017 年 2 月 17 日顺利结束。

经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次募集的有效净认购金额为 249,668,262.17 元人民币，折合基金份额 249,668,262.17 份；经基金注册登记人计算并确认的认购资金在募集期间的利息为人民币 35,966.84 元，折算成基金份额 34,411.27 份。其中，广发道琼斯石油指数 A 类的有效净认购金额为 226,881,543.24 元人民币，折合基金份额 226,881,543.24 份；认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计 31,417.43 元人民币，折合基金份额 29,861.86 份；广发道琼斯石油指数 C 类的有效净认购金额为 22,786,718.93 元人民币，折合基金份额 22,786,718.93 份；认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计 4,549.41 元人民币，折合基金份额 4,549.41 份。

本次募集有效认购户数为 6,437 户，按照每份基金份额面值 1.00 元人民币计算，本次募集资金及其产生的利息结转的基金份额共计 249,702,673.44 份。本基金管理人从业人员认购持有的基金份额总额为 1,195,124.32 份（含募集期利息结转的份额），占本基金总份额的比例为 0.4786%，其中本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 100 万份以上；该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 0 份。



---

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金资产中支付。

11、本基金募集备案情况

本基金于 2017 年 2 月 23 日验资完毕,2016 年 2 月 27 日向中国证监会提交了验资报告,办理基金备案手续,并于 2017 年 2 月 28 日获得书面确认。

12、基金合同生效日: 2017 年 2 月 28 日

13、基金合同生效日的基金份额总额: 249,702,673.44 份

(二) 本基金 A 类份额上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号: 深圳证券交易所 深证上[2017 ]165号

2、上市交易日期: 2017年3月17日

3、上市交易的证券交易所: 深圳证券交易所

4、本次上市交易的基金份额场内简称和基金代码: 广发石油、162719

投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金二级市场交易。

5、本次上市交易份额: 166904565份。

6、基金资产净值的披露:

基金管理人每个工作日对上一个工作日的基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算,基金托管人复核。本基金A类份额上市交易后,基金管理人于每个估值日的下一工作日将经过基金托管人复核的该估值日的基金份额净值传送给深圳证券交易所,深圳证券交易所于每个估值日的下两个工作日通过行情系统揭示。

7、未上市交易份额的流通规定:

未上市交易的份额登记在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下,基金份额持有人将其转托管至深圳证券交易所场内(即中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统)后即可上市流通。

8、本基金A类份额开通跨系统转托管业务日期: 2017年3月17日,具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

#### 四、 持有人户数、持有人结构及前十名持有人

(一) 持有人户数

截至2017年3月10日,本基金份额持有人户数为6,424户,平均每户持有的基金份额为38,870.28份。其中 A 类份额持有人户数为 4,990 户,平均每户持有的基金份额为45,473.23份; 上市交易的场内 A 类份额持有人户数为 3419 户,平均每户持有的基金份

额为 48,816.78份。

(二) 持有人结构

截至 2017 年 3 月 10 日, 本基金份额持有人结构如下:

基金总份额为 249,702,673.44 份, 其中 A 类份额 226,911,405.10 份, 上市交易的场内 A 类份额 166,904,565.00 份。其中机构投资者持有的本次上市交易的场内 A 类份额为 836,063.00 份, 占本次上市交易基金份额比例为 0.50%; 个人投资者持有的本次上市交易的场内 A 类份额为 166,068,502.00 份, 占本次上市交易基金份额比例为 99.50%

(三) 截至 2017 年 3 月 10 日, 场内前十名基金份额持有人情况

序号	持有人名称(全称)	持有基金份额	占场内基金份额的比例
1	贺祖青	7,952,617.00	4.76%
2	杨克晶	3,503,238.00	2.10%
3	云笑	2,852,138.00	1.71%
4	许单荣	1,642,127.00	0.98%
5	徐康宁	1,518,158.00	0.91%
6	蔡健	1,318,899.00	0.79%
7	郭树忠	1,017,068.00	0.61%
8	欧奕君	1,000,145.00	0.60%
9	陈沂生	1,000,087.00	0.60%
10	林嘉锭	1,000,077.00	0.60%
合计		22,804,554.00	13.66%

## 五、 基金主要当事人简介

### (一) 基金管理人

#### 1、公司概况

名称：广发基金管理有限公司

法定代表人：孙树明

总经理：林传辉

注册资本：1.2688亿元人民币

注册地址：广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-56室

设立批准文号：中国证监会证监基字[2003]91号

工商登记注册的法人营业执照文号：914400007528923126

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务

2、股东及其出资比例：广发证券股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、烽火通信科技股份有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技金融创新投资控股有限公司，分别持有本基金管理人51.135%、15.763%、15.763%、9.458%和7.881%的股权。

### 3、内部组织结构及职能

委员会名称	职责
投资决策委员会	决定公募基金的投资理念、投资准则；研判市场时机，审议公募基金经理提交的资产配置报告,确定公募基金资产配置比例；评估并审定公募基金投资策略及拟重点投资的证券；对委员会决议的执行情况进行监督等
风险控制委员会	负责审核公司的风险控制制度和风险管理流程，确保公司整体风险的识别、监控和管理；负责检查风险控制制度的落实情况，审阅公司各项风险与内控状况评价报告；针对公司经营管理活动中发生的紧急突发性事件和重大危机情况，组成危机处理小组，评估事件风险，制定危机处理方案并监督实施等
部门名称	职能定位
权益投资一部	负责主动权益公募、社保组合、养老基金组合的投资管理
权益投资二部	负责主动权益非公募组合的投资管理
固定收益部	负责固定收益类公募、非公募、社保组合、养老基金组合的投资管理
数量投资部	负责被动型指数组合的研究和投资管理
国际业务部	负责境外业务的开展及 QDII 基金的投资管理
量化投资部	负责主动型量化组合的研究和投资管理

数据策略投资部	负责公司大数据业务品种的投资、研究等相关工作
资产配置部	负责资产配置业务和衍生品、资产证券化等业务的投资、研究及相关工作
研究发展部	负责宏观策略、行业与上市公司、新业务研究
产品营销管理部	负责产品开发、设计、报批，营销策划、品牌推广、渠道服务和客户服务等业务
渠道管理总部	负责银行、券商等渠道总部的开拓和维护
机构理财部	负责社保、养老基金、保险、信托和银行（委外业务）等机构的市场营销与客户维护工作
互联网金融部	负责网络直销及与互联网相关的营销业务
北京分公司 上海分公司 广州分公司	负责属地内全产品的销售业务
中央交易部	负责执行组合交易指令，实施一线风险监控等
信息技术部	负责组织并协调公司信息化建设工作
注册登记部	负责公募基金和资产管理计划份额的登记存管和资金的清算管理
基金会计部	负责组合的核算及相关信息披露工作
监察稽核部	负责合规及运作风险的全面管理，投资风险监控与业绩归因分析
综合管理部	负责行政管理与后勤保障
财务部	负责公司财务管理工作
人力资源部	负责公司人力资源管理
规划发展部	负责公司发展规划研究
北京办事处	负责协调办理公司在京有关事项

4、截止2017年2月28日，广发基金管理有限公司总人数388人，其中博士学位15人、硕士学位239人和学士学位118人。

#### 5、本基金经理

余昊，男，中国籍，理学硕士，7年基金业从业经历，2010年6月至2013年9月先后在广发基金管理有限公司研究发展部和国际业务部任研究员，2013年9月10日至2014年3月25日任广发亚太精选股票(QDII)基金的基金经理助理，2014年6月4日至2015年4月19日任国际业务

---

部专户投资经理，2015年4月20日至2016年6月6日任国际业务部研究员，2016年6月7日起任广发沪港深股票基金的基金经理，2016年10月27日起任广发全球精选股票(QDII)基金的基金经理，2017年2月28日起任广发道琼斯石油指数(QDII-LOF)基金的基金经理。

李耀柱，男，中国籍，理学硕士，6.5年基金业从业经历，持有中国证券投资基金业从业证书，2010年8月至2014年7月在广发基金管理有限公司中央交易部任股票交易员，2014年8月至2015年12月在国际业务部先后任QDII基金的研究员、基金经理助理，2015年12月17日起任广发纳指100ETF基金的基金经理，2016年8月23日起任广发全球农业指数(QDII)、广发纳斯达克100指数(QDII)、广发美国房地产指数(QDII)、广发亚太中高收益债券(QDII)、广发全球医疗保健(QDII)和广发生物科技指数(QDII)基金的基金经理，2016年11月9日起任广发沪港深新起点股票基金的基金经理，2017年3月10日起任广发道琼斯石油指数(QDII-LOF)基金的基金经理。

## (二) 基金托管人

### 1、基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：易会满

注册资本：人民币35,640,625.71万元

联系电话：010-66105799

联系人：洪渊

### 2、主要人员情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。

截至2016年9月，中国工商银行共托管证券投资基金624只。自2003年以来，本行

连续十三年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 51 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

### （三）验资机构

德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）

办公地址：上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼

法人代表：曾顺福

电话：021-61418888

传真：021-63350003

经办注册会计师：洪锐明、江丽雅

## 六、 基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

## 七、 基金财务状况

### （一）基金募集期间费用

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金资产中支付。

### （二）基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

### （三）基金资产负债表

本基金 2017 年 3 月 9 日资产负债表如下：

资 产		负 债	
银行存款	249,660,284.44	短期借款	
结算备付金		交易性金融负债	
存出保证金		衍生金融负债	
交易性金融资产	4,855,537.15	卖出回购金融资产款	
其中：股票投资	4,855,537.15	应付证券清算款	4,812,925.52
债券投资		应付赎回款	
资产支持证券投资		应付管理人报酬	61,556.87
基金投资		应付托管费	18,467.06
衍生金融资产		应付销售服务费	3,370.91
买入返售金融资产		应付交易费用	

应收证券清算款		应付税费	
应收利息	49,881.54	应付利息	
应收股利		应付利润	
应收申购款		其他负债	16,074.69
其他资产		负债合计	4,912,395.05
		所有者权益：	
		实收基金	249,702,673.44
		未分配利润	-49,365.36
		所有者权益合计	249,653,308.08
资产合计：	254,565,703.13	负债与持有人权益总计：	254,565,703.13

## 八、 基金投资组合

截止到 2017 年 03 月 09 日，本基金的投资组合如下：

### （一） 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	4,855,537.15	1.91
	其中：普通股	4,855,537.15	1.91
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
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	249,660,284.44	98.07
8	其他各项资产	49,881.54	0.02
9	合计	254,565,703.13	100.00

（二）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	4,855,537.15	1.94
合计	4,855,537.15	1.94

（三）按行业分类的股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
能源	4,855,537.15	1.94
材料		
工业		
非必须消费品		
必须消费品		



保健		
金融		
信息技术		
电信服务		
公共事业		
合计	4,855,537.15	1.94

(四) 按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

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	3933	1263645.37	0.51
2	EOG RESOURCES INC	EOG 资源	EOG US	纽约证券交易所	美国	1904	1259545.98	0.50
3	ANADARKO PETROLEUM CORP	阿纳达科石油	APC US	纽约证券交易所	美国	1876	803228.63	0.32

				所				
4	PHILLIPS 66	Phillips 66 公司	PSX US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1491	791954.34	0.32
5	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	Pioneer 自然资源 公司	PXD US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	568	737162.83	0.30

(五) 按券种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

(六) 按市值占净值比例大小排序的前五名债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

(七) 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。

(八) 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。

(九) 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

本基金本报告期末未持有基金。

(十) 投资组合报告附注

1、根据公开市场信息，本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2、报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

3、其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	

2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收利息	49,881.54
5	应收申购款	
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	49,881.54

#### 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、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。

### 九、 重大事件揭示

本基金自基金合同生效日至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

### 十、 基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

### 十一、 基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。

（二）根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资

---

产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

(三)基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,并在限期内,随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。

(四)基金托管人发现基金管理人重大违规行为,将立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。

## 十二、 备查文件目录

以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所,投资者可在办公时间免费查阅。

(一) 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

(二) 《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》

(三) 《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》

(四) 《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》

(五) 法律意见书

广发基金管理有限公司

二〇一七年三月十四日

---

附件：广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金（QDII-LOF）基金合同摘要

一、基金合同当事人的权利与义务

（一）基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- （1）依法募集资金；
- （2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- （3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- （4）销售基金份额；
- （5）按照规定召集基金份额持有人大会；
- （6）依据《基金合同》及有关法律、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律、法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- （7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- （8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- （9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- （10）依据《基金合同》及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案；
- （11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- （12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- （13）在条件允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
- （14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- （15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- （16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则，开通人民币之外的其他销售币种基金份额的申购、赎回

---

等业务；

（17）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

（1）依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

（2）办理基金备案手续；

（3）自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

（4）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

（5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

（6）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

（7）依法接受基金托管人的监督；

（8）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定各类基金份额申购、赎回的价格；

（9）委托境外证券服务机构代理买卖的，应当严格履行受信责任，并按照有关规定对投资交易的流程、信息披露、记录保存进行管理；

（10）与境外证券服务机构之间的证券交易和研究服务安排，应当严格按照《试行办法》第三十条规定的原则进行；

（11）进行境外证券投资，应当遵守地监管机构、交易所的有关法律法规规定；

（12）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（13）编制季度、半年度和年度基金报告；

（14）严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

（15）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基

---

金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

（16）按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

（17）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（18）依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

（19）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

（20）确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

（21）组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

（22）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

（23）因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（24）监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

（25）当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

（26）以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

（27）基金在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

（28）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（29）建立并保存基金份额持有人名册；

（30）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

---

## （二）基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

（1）自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

（2）依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

（3）监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

（4）选择、更换或撤销境外托管人；

（5）根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算；

（6）提议召开或召集基金份额持有人大会；

（7）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

（8）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

（2）设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

（3）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

（4）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

（6）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

（7）保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，



---

在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

（8）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额申购、赎回价格；

（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

（10）对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

（11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

（12）建立并保存基金份额持有人名册；

（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

（14）依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

（15）依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

（16）按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

（17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

（18）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

（19）因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（20）按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

（21）执行生效的基金份额持有人大会的决定；

（22）对基金的境外财产，基金托管人可授权境外托管人代为履行其承担的受托人职责。境外托管人在履行职责过程中，因本身过错、疏忽等原因而导致基金财产受损的，基金托管人应当承担相应责任；

（23）保护基金份额持有人利益，按照规定对基金日常投资行为和资金汇出入情况实施监督，如发现投资指令或资金汇出入违法、违规，应当及时向中国证监会、外管局报告；

（24）准时将公司行为信息通知基金管理人，确保基金及时收取应得收入；

---

(25) 按照法律法规及监管规定, 按时向相关监管机构报送应由托管人履行的报告义务;

(26) 办理基金就管理本基金的有关结汇、售汇、收汇、付汇和人民币资金结算业务;

(27) 法律法规、中国证监会和外管局根据审慎监管原则规定的其他职责和《基金合同》约定的其他义务。

### (三) 基金份额持有人权利和义务

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受, 基金投资者自依据《基金合同》取得的基金份额, 即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人, 直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

同一类别的每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定, 基金份额持有人的权利包括但不限于:

- (1) 分享基金财产收益;
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产;
- (3) 依法申请赎回其持有的基金份额;
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或召集基金份额持有人大会;
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会, 对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料;
- (7) 监督基金管理人的投资运作;
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁;
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定, 基金份额持有人的义务包括但不限于:

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》;
- (2) 了解所投资基金产品, 了解自身风险承受能力, 自行承担投资风险;
- (3) 关注基金信息披露, 及时行使权利和履行义务;

- 
- (4) 缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
  - (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
  - (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
  - (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
  - (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
  - (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的同一类别的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金的基金份额持有人大会未设立日常机构，如今后设立基金份额持有人大会的日常机构，日常机构的设立按照相关法律法规的要求执行。

### (一) 召开事由

1、除法律法规，或《基金合同》，或中国证监会另有规定外，当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止《基金合同》；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式；
- (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求调整该等报酬标准的除外；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；
- (9) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (10) 变更基金份额持有人大会程序；
- (11) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

---

（12）单独或合计持有本基金总份额 10% 以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

（13）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

（14）法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、在不违反有关法律法规和《基金合同》约定，并对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

（1）法律法规要求增加的基金费用的收取；

（2）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率、销售服务费率、变更收费方式或者增加新的基金份额类别；

（3）因相应的法律法规、相关证券交易所或者登记机构的相关业务规则发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

（4）对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；

（5）按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议调整本基金的标的指数使用相关费用；

（6）基金管理人、登记机构、基金销售机构在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整有关认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等业务规则；

（7）基金推出新业务或服务；

（8）按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

## （二）会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起

---

60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集。

4、代表基金份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起

60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

5、代表基金份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

### （三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话；
- （6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- （7）召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系

---

人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

#### （四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规和监管机关允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；

---

（4）上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记注册机构记录相符；

参加基金份额持有人大会的持有人的基金份额低于第 1 款第（2）项、或者第 2 款第（3）项规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上基金份额的持有人参加，方可召开。

3、在不与法律法规冲突的前提下，基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开，基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

#### （五）议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

##### 2、议事程序

###### （1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。

---

基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

## （2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

## （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除基金合同另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

## （七）计票

### 1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人



---

代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

（2）监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

（3）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

（4）计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

## 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

## （八）生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

（九）对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人经与基金托管人协商一致报监管机关并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改

---

和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

### 三、基金收益分配原则、执行方式

#### （一）基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，场外投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。场内基金份额收益分配方式只能为现金分红，具体收益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

4、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在法律法规和《基金合同》约定的范围内并对持有人利益无实质性不利的影响下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

#### （二）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

#### （三）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

---

#### 四、与基金财产管理、运作有关费用的提取、支付方式与比例

##### （一）基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

##### （二）基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.30% 的年费率计提。境外托管人的托管费从基金托管人的托管费中扣除。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

##### （三）销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.60% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金行销广告费、促销

---

活动费、基金份额持有人服务费等。

销售服务费使用范围不包括基金募集期间的上述费用。

#### （四）基金的指数许可使用费

本基金《基金合同》生效后的标的指数许可使用费按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数许可使用协议的约定从基金财产中支付。

如果指数使用许可协议约定的标的指数使用相关费用的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算标的指数使用相关费用。基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中披露本基金最新适用的方法。

### 五、基金资产的投资方向和投资限制

#### （一）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括道琼斯美国石油开发与生产指数的成份股、备选成份股、跟踪道琼斯美国石油开发与生产指数的公募基金、上市交易型基金等。本基金还可投资全球证券市场中具有良好流动性的其他金融工具，包括已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证，已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金，与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品，远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品，政府债券、公司债券、可转换债券等固定收益类证券，银行存款、短期政府债券等货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：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，投资于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%。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

---

## （二）投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）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%；

（2）在扣除需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

（3）本基金持有同一家银行的存款不得超过基金资产净值的 20%。在基金托管账户的存款可以不受上述限制；

（4）本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%；

（5）本基金持有非流动性资产市值不得超过基金资产净值的 10%。前项非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产；

（6）本基金持有境外基金的市值合计不得超过基金资产净值的 10%，但持有货币市场基金不受此限制；

（7）同一基金管理人管理的全部基金持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的 20%；

（8）为应付赎回、交易清算等临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的 10%。

若基金超过上述（1）-（8）项投资比例限制要求，应当在超过比例后 30 个工作日内采用合理的商业措施以符合投资比例限制要求。

### 2、金融衍生品投资

本基金投资衍生品应当仅限于投资组合避险或有效管理，不得用于投机或放大交易，同时应当严格遵守下列规定：

（1）本基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的 100%；

（2）本基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的 10%；

（3）本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：

---

1) 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级；

2) 交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且基金可在任何时候以公允价值终止交易；

3) 任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。

(4) 基金管理人应当在本基金会计年度结束后 60 个工作日内向中国证监会提交包括衍生品头寸及风险分析年度报告。

3、本基金可以参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：

(1) 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级；

(2) 应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的 102%；

(3) 借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要；

(4) 除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：

1) 现金；

2) 存款证明；

3) 商业票据；

4) 政府债券；

5) 中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构（作为交易对手方或其关联方的除外）出具的不可撤销信用证。

(5) 本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券；

(6) 基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任；

4、基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易，并且应当遵守下列规定：

(1) 所有参与正回购交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级；

(2) 参与正回购交易，应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不

---

低于已售出证券市值的 102%。一旦买方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要；

(3) 买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红；

(4) 参与逆回购交易，应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的 102%。一旦卖方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要；

(5) 基金管理人应当对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。

5、基金参与证券借贷交易、正回购交易，所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的 50%。前项比例限制计算，基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产；

6、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 30 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应符合本基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

## 7、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 购买不动产；
- (5) 购买房地产抵押按揭；
- (6) 购买贵金属或代表贵金属的凭证；

---

(7) 购买实物商品；

(8) 除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金。临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的 10%；

(9) 利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外；

(10) 参与未持有基础资产的卖空交易；

(11) 购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层；

(12) 直接投资与实物商品相关的衍生品；

(13) 向其基金管理人、基金托管人出资；

(14) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(15) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

## 六、基金资产净值的计算方法和公告方式

### (一) 基金资产净值的计算

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### (二) 基金资产净值、各类基金份额的基金份额净值的公告

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个估值日后 2 个工作日内，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和各类基金



---

份额的基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的T+2日内，将基金资产净值、各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。

## 七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （一）《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，生效后方可执行，自决议生效后两个工作日内在指定媒介公告。

### （二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### （三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

#### 4、基金财产清算程序：

- （1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；
- （4）制作清算报告；

---

（5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

#### （四）清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

#### （五）基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### （六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案并确认后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

#### （七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

## 八、争议的处理和适用的法律

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律管辖。

---

### 九、基金合同存放地和投资者取得合同的方式

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。