

# 广发美国房地产指数证券投资基金

## 2016 年半年度报告

### 2016 年 6 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：二〇一六年八月二十六日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2016 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|  |           |
|--|-----------|
| <b>1 重要提示及目录</b> .....                       | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>2 基金简介</b> .....                          | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 6         |
| 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....                      | 6         |
| 2.5 信息披露方式.....                              | 6         |
| 2.6 其他相关资料.....                              | 7         |
| <b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                 | <b>7</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 7         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 7         |
| <b>4 管理人报告</b> .....                         | <b>8</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 8         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 13        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 13        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....             | 14        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 14        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 15        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 15        |
| <b>5 托管人报告</b> .....                         | <b>15</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 15        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 16        |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....     | 16        |
| <b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....               | <b>16</b> |
| 6.1 资产负债表.....                               | 16        |
| 6.2 利润表.....                                 | 17        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 18        |
| 6.4 报表附注.....                                | 19        |
| <b>7 投资组合报告</b> .....                        | <b>33</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 33        |
| 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....              | 34        |
| 7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....                      | 34        |
| 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....       | 35        |
| 7.5 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 47        |
| 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....                  | 48        |
| 7.7 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.....      | 48        |
| 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....   | 48        |
| 7.9 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.....   | 48        |
| 7.10 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.....     | 49        |
| 7.11 投资组合报告附注.....                           | 49        |
| <b>8 基金份额持有人信息</b> .....                     | <b>50</b> |

|  |           |
|--|-----------|
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....             | 50        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....          | 50        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况..... | 50        |
| <b>9 开放式基金份额变动.....</b>                | <b>50</b> |
| <b>10 重大事件揭示.....</b>                  | <b>51</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                  | 51        |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....  | 51        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....       | 51        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                    | 51        |
| 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....               | 51        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....     | 52        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....            | 52        |
| 10.8 其他重大事件.....                       | 53        |
| <b>11 备查文件目录.....</b>                  | <b>54</b> |
| 11.1 备查文件目录.....                       | 54        |
| 11.2 存放地点.....                         | 55        |
| 11.3 查阅方式.....                         | 55        |

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                  |
|------------|------------------|
| 基金名称       | 广发美国房地产指数证券投资基金  |
| 基金简称       | 广发美国房地产指数(QDII)  |
| 基金主代码      | 000179           |
| 交易代码       | 000179           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日    | 2013 年 8 月 9 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       |
| 报告期末基金份额总额 | 207,337,764.92 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期              |

### 2.2 基金产品说明

|      |   |
|------|---|
| 投资目标 | <p>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。本基金力争控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于 0.5%,基金净值增长率与业绩比较基准之间的年跟踪误差不超过 5%。</p>   |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略:本基金以追求标的指数长期增长的稳定收益为宗旨,在降低跟踪误差和控制流动性风险的双重约束下构建指数化的投资组合。本基金力争控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于 0.5%,基金净值增长率与业绩比较基准之间的年跟踪误差不超过 5%。本基金对 MSCI 美国 REIT 指数成份股、备选成份股及以 MSCI 美国 REIT 指数为投资标的的指数基金(包括 ETF)的投资比例不低于基金资产的 90%,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%。</p> <p>2、REIT 投资策略<br/>                     本基金主要采用完全复制法来跟踪 MSCI 美国 REIT 指数,按照个股在标的指数中的基准权重构建组合。<br/>                     当预期成份股发生调整和成份股发生分红、增发、送配等行为时,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,基金管理人会对 REIT 组合进行适当调整,降低跟踪误差。<br/>                     本基金对投资组合进行监控与评估时,以跟踪偏离度为核心监控指标,跟踪误差为辅助监控指标,对投资组合的日常调整就以最小化跟踪偏离度为原则,以求控制投资组合相对于业绩比较基准的偏离风险。</p> <p>3、固定收益类投资策略<br/>                     本基金将主要以降低跟踪误差和投资组合流动性管理为目的,综合考虑流动性和收益性,构建本基金债券和货币市场工具的投资组合。</p> <p>4、衍生品投资策略<br/>                     本基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生品。本基金在金融衍生品的投资中主要遵循有效管理投资策略,对冲某些成份股的特殊突发风险</p> |

|        |   |
|--------|---|
|        | 和某些特殊情况下的流动性风险，以及利用金融衍生产品规避外汇风险及其他相关风险。   |
| 业绩比较基准 | 人民币计价的 MSCI 美国 REIT 净总收益指数 (MSCI US REIT Net Daily Total Return Index)。   |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数，具有与标的指数、以及标的指数所代表的投资市场相似的风险收益特征。 |

## 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人                           | 基金托管人                |
|-------------|------|---------------------------------|----------------------|
| 名称          |      | 广发基金管理有限公司                      | 中国银行股份有限公司           |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 段西军                             | 王永民                  |
|             | 联系电话 | 020-83936666                    | 010-66594896         |
|             | 电子邮箱 | dxj@gffunds.com.cn              | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话      |      | 95105828, 020-83936999          | 95566                |
| 传真          |      | 020-89899158                    | 010-66594942         |
| 注册地址        |      | 广东省珠海市横琴新区宝中路<br>3号4004-56室     | 北京市西城区复兴门内大街1<br>号   |
| 办公地址        |      | 广州市海珠区琶洲大道东1号<br>保利国际广场南塔31-33楼 | 北京市西城区复兴门内大街1<br>号   |
| 邮政编码        |      | 510308                          | 100818               |
| 法定代表人       |      | 孙树明                             | 田国立                  |

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

| 项目   |    | 境外投资顾问 | 境外资产托管人                       |
|------|----|--------|-------------------------------|
| 名称   | 英文 | -      | BANK OF CHINA NEW YORK BRANCH |
|      | 中文 | -      | 中国银行纽约分行                      |
| 注册地址 |    | -      | -                             |
| 办公地址 |    | -      | -                             |
| 邮政编码 |    | -      | -                             |

## 2.5 信息披露方式

|                      |   |
|----------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称       | 中国证券报、证券时报、上海证券报  |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.gffunds.com.cn">http://www.gffunds.com.cn</a> |

|             |                                 |
|-------------|---------------------------------|
| 基金半年度报告备置地点 | 广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼 |
|-------------|---------------------------------|

## 2.6 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址                            |
|--------|------------|---------------------------------|
| 注册登记机构 | 广发基金管理有限公司 | 广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼 |

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日） |
|---------------|--------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 3,716,670.78                         |
| 本期利润          | 27,874,450.95                        |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.1813                               |
| 本期加权平均净值利润率   | 14.66%                               |
| 本期基金份额净值增长率   | 14.11%                               |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2016 年 6 月 30 日)                |
| 期末可供分配利润      | 6,222,306.03                         |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0300                               |
| 期末基金资产净值      | 275,253,894.10                       |
| 期末基金份额净值      | 1.328                                |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2016 年 6 月 30 日)                |
| 基金份额累计净值增长率   | 51.99%                               |

注：1、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。

2、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3、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。

### 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

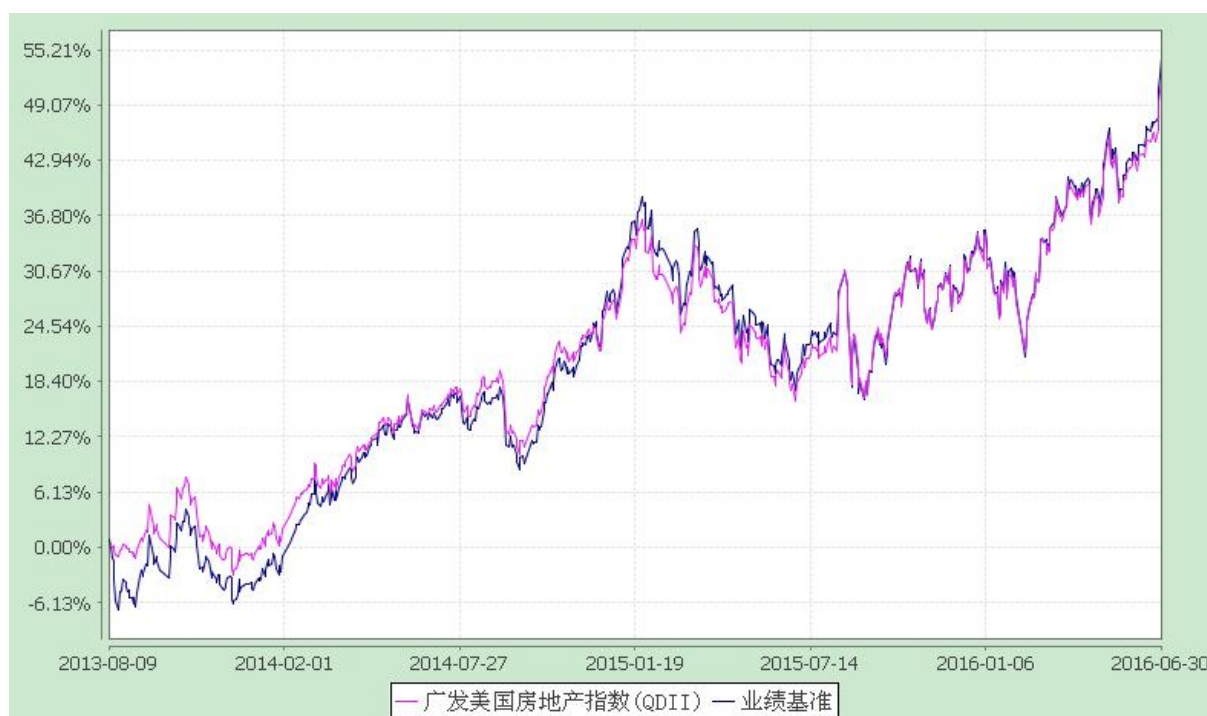
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|
|    |          |             |            |               |     |     |

|            |        |       |        |       |        |        |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去一个月      | 6.92%  | 0.68% | 7.91%  | 0.63% | -0.99% | 0.05%  |
| 过去三个月      | 8.50%  | 0.88% | 9.84%  | 0.91% | -1.34% | -0.03% |
| 过去六个月      | 14.11% | 1.09% | 15.67% | 1.16% | -1.56% | -0.07% |
| 过去一年       | 30.58% | 1.13% | 31.40% | 1.18% | -0.82% | -0.05% |
| 自基金合同生效起至今 | 51.99% | 0.93% | 54.35% | 1.00% | -2.36% | -0.07% |

注：本基金业绩比较基准：人民币计价的 MSCI 美国 REIT 净总收益指数。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

广发美国房地产指数证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2013 年 8 月 9 日至 2016 年 6 月 30 日)



## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，于 2003 年 8 月 5 日成立，注册资本 1.2688 亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、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。



公司拥有公募基金、社保基金境内投资管理人、受托管理保险资金投资管理人、合格境内机构投资者境外证券投资管理（QDII）和特定客户资产管理等业务资格。

本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和 25 个部门：综合管理部、财务部、人力资源部、监察稽核部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、中央交易部、规划发展部、研究发展部、权益投资一部、权益投资二部、固定收益部、数量投资部、量化投资部、另类投资部、数据策略投资部、国际业务部、产品营销管理部、机构理财部、北京分公司、广州分公司、上海分公司、互联网金融部、北京办事处。此外，还出资设立了广发国际资产管理有限公司（香港子公司）、瑞元资本管理有限公司，参股了证通股份有限公司。

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金管理人管理九十八只开放式基金——广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发小盘成长股票型证券投资基金（LOF）、广发货币市场基金、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金、广发大盘成长混合型证券投资基金、广发增强债券型证券投资基金、广发核心精选股票型证券投资基金、广发沪深 300 指数证券投资基金、广发聚瑞股票型证券投资基金、广发中证 500 指数证券投资基金（LOF）、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金、广发全球精选股票型证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发标普全球农业指数证券投资基金、广发聚利债券型证券投资基金、广发制造业精选股票型证券投资基金、广发聚财信用债证券投资基金、广发深证 100 指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、广发理财年年红债券型证券投资基金、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金，广发双债添利债券型证券投资基金、广发纯债债券型证券投资基金、广发理财 30 天债券型证券投资基金、广发新经济股票型发起式证券投资基金、广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、广发轮动配置股票型证券投资基金、广发聚鑫债券型证券投资基金、广发理财 7 天债券型证券投资基金、广发美国房地产指数证券投资基金、广发集利一年定期开放债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、广发聚优灵活配置混合型证券投资基金、广发天天红发起式货币市场基金、广发亚太中高收益债券型证券投资基金、广发现金宝场内实时申赎货币市场基金、广发全球医疗保健指数证券投资基金、广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金、广发钱袋子货币市场基金、广发天天利货币市场基金、广发集鑫债券型证券投资基金、广发竞争优势灵活配置混合型证券投资基金、广发新动力股票型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金、广发主题领先灵活配置混合型证券投资基金、广发活期宝货币基金、广发逆向

策略灵活配置混合型证券投资基金、广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金、广发中证环保产业指数型证券投资基金、广发聚安混合型证券投资基金、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金、广发聚宝混合型证券投资基金、广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式证券投资基金发起式联接基金、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、广发安心回报混合型证券投资基金、广发安泰回报混合型证券投资基金、广发聚康混合型证券投资基金、广发聚泰混合型证券投资基金、广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金、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基金、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、广发中证医疗指数分级证券投资基金、广发改革先锋灵活配置混合型证券投资基金、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、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金、广发百发大数据策略成长灵活配置混合型证券投资基金、广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金、广发多策略灵活配置混合型证券投资基金、广发安富回报灵活配置混合型证券投资基金和广发安宏回报灵活配置混合型证券投资基金、广发新兴产业精选灵活配置混合型证券投资基金、广发稳安保本混合型证券投资基金、广发鑫享灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金、广发安享灵活配置混合型证券投资基金、广发稳鑫保本混合型证券投资基金、广发沪港深新机遇股票型证券投资基金、广发集裕债券型证券投资基金、广发稳裕保本混合型证券投资基金、广发安泽回报混合型证券投资基金，管理资产规模为 2341 亿元。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合和社保基金投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

| 姓名 | 职务                            | 任本基金的基金经理<br>(助理) 期限 |      | 证券从业年限 | 说明                           |
|----|-------------------------------|----------------------|------|--------|------------------------------|
|    |                               | 任职日期                 | 离任日期 |        |                              |
| 邱炜 | 本基金的<br>基金经理；<br>广发标普<br>全球农业 | 2013-08-09           | -    | 9 年    | 男，中国<br>籍，统计<br>学博士，<br>持有中国 |

|  |   |  |  |  |  |
|--|---|--|--|--|--|
|  | <p>指数<br/>(QDII)基金的基金经理;广发纳斯达克 100 指数<br/>(QDII)基金的基金经理;广发亚太中高收益债券<br/>(QDII)基金的基金经理;广发全球医疗保健<br/>(QDII)基金的基金经理;广发生物科技指数<br/>(QDII)基金的基金经理;广发纳指 100ETF 基金的基金经理;广发鑫享混合基金的基金经理;国际业务部总经理</p> |  |  |  | <p>证券投资基金业从业证书, 2007 年 5 月至 2008 年 7 月在摩根大通集团(纽约)任高级分析师兼助理副总裁, 2008 年 7 月至 2011 年 6 月任广发基金管理有限公司国际业务部研究员, 2011 年 6 月 28 日起任广发全球农业指数(QDII)基金的基金经理, 2012 年 8 月 15 日起任广发纳斯达克 100 指数(QDII)基金的基金经理, 2013 年 8 月 9 日起任广发美国房地产指数(QDII)基金的基金经理, 2013 年 11 月 28 日起</p> |
|--|---|--|--|--|--|

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | <p>任广发亚太中高收益债券(QDII)基金的基金经理，2013年12月10日起任广发全球医疗保健(QDII)基金的基金经理，2014年1月21日至2016年1月27日任国际业务部副总经理，2015年1月14日至2016年1月27日任另类投资部副总经理，2015年3月30日起任广发生物科技指数(QDII)基金的基金经理，2015年6月10日起任广发纳指100ETF基金的基金经理，2016年1月15日起任广发鑫享混合基金的基金经理，</p> |
|--|--|--|--|--|---|

|  |  |  |  |  |                            |
|--|--|--|--|--|----------------------------|
|  |  |  |  |  | 2016 年 1 月 28 日起任国际业务部总经理。 |
|--|--|--|--|--|----------------------------|

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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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》及其配套法规、《广发美国房地产指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 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，公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库，重点投资的股票必须来源于核心股票库。公司建立了严格的投资授权制度，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。监察稽核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

本公司原则上禁止不同投资组合之间（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况进行反向交易的，则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本报告期内，本投资组合与本公司管理的其他投资组合未发生过同日反向交易的情况。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年初，美国股市受到中国股市连续熔断的影响大幅下行，同时油价在一月份持续下跌，引起市场对通缩的担心。随着中国叫停熔断政策，欧洲央行在一月末释放宽松信号推动风险资产见底回升。进入二月份，市场对欧洲银行关于能源业敞口的担忧推升市场的避险情绪，风险资产持续暴跌。随着德银公布债券回购计划以及沙特和俄罗斯的冻产计划慢慢让石油价格企稳，风险资产在二月中下旬止跌反弹。同时二月末的美国经济数据持续向好推升美国的房地产信托行业触底回升并且先于其他的板块反弹。三月份，中国央行降准以及一系列刺激政策的预期推升全球风险资产。美国新屋开工和销售数据持续向好推升美国的房地产价格。

二季度美国房地产信托指数走势强劲，创出历史新高。四月初，美联储的加息预期增加，市场总体回落。但是五月公布的非农就业数据显示美国的经济增长前景仍然有机会停滞，所以市场快速反弹。六月，英国的公投脱欧，市场剧烈波动，十年期国债收益率大幅下行，避险资产更加受到青睐，美国房地产信托指数更在脱欧之后创出历史新高。虽然英国脱钩后，英国多个房地产信托基金都遇到流动性的问题，但是主要的原因还是投资者看空英国房地产市场导致的，英镑的弱势加重了英国房地产的抛售压力。这些资金流出后会增加经济增长稳定的美国房地产的配置，美国房地产指数的价格进一步上涨。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的净值增长率为 14.11%，同期业绩比较基准收益率为 15.67%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们继续看好美国房地产信托指数的前景。英国脱欧之后，全球都在寻求避险资产，美国作为全球经济复苏得最好的大国，其房地产是最稳健、最安全的配置资产之一。同时，由于英国脱欧后，美国的加息要延后，加息预期对房地产指数的压制慢慢消除，所以美国房地产会在未来进一步上涨。由于美国的经济复苏良好，个人收入增加也是推动美国房地产价格上升的重要因素。因为 2008 年的金融危机导致很多美国家庭延迟了买房计划，在二月份公布的美国家庭住房拥有率更是创了新低，但是现在经济已经复苏，很多家庭重新买入房子，所以房地产价格未来会进一步走高。我们中长期看好美国房地产信托指数的趋势。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会，按照相关法律法规和证监会的相关规定，负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序，并选取适当的估值方法，经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括：公司分管投研、估值的副总经理、督察长、投资管理部负责人、研究发展部负责人、金融工程部负责人、监察稽核部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行，并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出估值建议，确保估值的公允性。金融工程部负责提供有关涉及模型的技术支持。监察稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按合同约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“基金收益分配原则”的相关规定，2016年2月22日广发美国房地产指数证券投资基金每10份基金份额分配人民币1.60元，美元现汇基金份额的每份额分配金额为人民币份额的每份额分配数额按照权益登记日前一工作日美元估值汇率折算后的美元金额，计算结果以美元为单位，符合基金合同规定。

### 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对广发美国房地产指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

# 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：广发美国房地产指数证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产         | 附注号     | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|-------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <b>资 产：</b> |         | -                      | -                        |
| 银行存款        | 6.4.7.1 | 28,356,883.60          | 9,036,759.55             |
| 结算备付金       |         | -                      | -                        |
| 存出保证金       |         | -                      | -                        |
| 交易性金融资产     | 6.4.7.2 | 248,237,739.80         | 162,718,166.33           |
| 其中：股票投资     |         | 227,479,393.65         | 155,766,024.40           |
| 基金投资        |         | 20,758,346.15          | 6,952,141.93             |
| 债券投资        |         | -                      | -                        |
| 资产支持证券投资    |         | -                      | -                        |
| 衍生金融资产      | 6.4.7.3 | -                      | -                        |
| 买入返售金融资产    | 6.4.7.4 | -                      | -                        |
| 应收证券清算款     |         | 86,780.86              | 84,980.12                |
| 应收利息        | 6.4.7.5 | 3,294.11               | 914.21                   |
| 应收股利        |         | 744,062.14             | 725,842.91               |
| 应收申购款       |         | 2,296,005.26           | 2,945,096.73             |
| 递延所得税资产     |         | -                      | -                        |
| 其他资产        | 6.4.7.6 | 96,431.71              | 31,891.50                |



|                   |              |                           |                             |
|-------------------|--------------|---------------------------|-----------------------------|
| <b>资产总计</b>       |              | 279,821,197.48            | 175,543,651.35              |
| <b>负债和所有者权益</b>   | <b>附注号</b>   | <b>本期末<br/>2016年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2015年12月31日</b> |
| 负 债:              |              | -                         | -                           |
| 短期借款              |              | -                         | -                           |
| 交易性金融负债           |              | -                         | -                           |
| 衍生金融负债            | 6.4.7.3      | -                         | -                           |
| 卖出回购金融资产款         |              | -                         | -                           |
| 应付证券清算款           |              | -                         | -                           |
| 应付赎回款             |              | 3,861,638.86              | 2,680,661.40                |
| 应付管理人报酬           |              | 155,110.16                | 113,919.14                  |
| 应付托管费             |              | 58,166.29                 | 42,719.67                   |
| 应付销售服务费           |              | -                         | -                           |
| 应付交易费用            | 6.4.7.7      | -                         | -                           |
| 应交税费              |              | -                         | -                           |
| 应付利息              |              | -                         | -                           |
| 应付利润              |              | 0.00                      | -                           |
| 递延所得税负债           |              | -                         | -                           |
| 其他负债              | 6.4.7.8      | 492,388.07                | 459,605.10                  |
| <b>负债合计</b>       |              | <b>4,567,303.38</b>       | <b>3,296,905.31</b>         |
| <b>所有者权益:</b>     |              | -                         | -                           |
| 实收基金              | 6.4.7.9      | 207,337,764.92            | 129,276,291.73              |
| 未分配利润             | 6.4.7.1<br>0 | 67,916,129.18             | 42,970,454.31               |
| <b>所有者权益合计</b>    |              | <b>275,253,894.10</b>     | <b>172,246,746.04</b>       |
| <b>负债和所有者权益总计</b> |              | <b>279,821,197.48</b>     | <b>175,543,651.35</b>       |

注: 报告截止日 2016 年 06 月 30 日, 基金份额净值人民币 1.328 元, 基金份额总额 207,337,764.92 份。

## 6.2 利润表

会计主体: 广发美国房地产指数证券投资基金

本报告期: 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

| 项 目         | 附注号          | 本期<br>2016年1月1日至<br>2016年6月30日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至<br>2015年6月30日 |
|-------------|--------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| <b>一、收入</b> |              | <b>29,241,149.60</b>           | <b>-16,778,670.84</b>               |
| 1. 利息收入     |              | 18,487.93                      | 23,106.80                           |
| 其中: 存款利息收入  | 6.4.7.1<br>1 | 18,487.93                      | 23,106.80                           |
| 债券利息收入      |              | -                              | -                                   |

|                            |              |                      |                       |
|----------------------------|--------------|----------------------|-----------------------|
| 资产支持证券利息收入                 |              | -                    | -                     |
| 买入返售金融资产收入                 |              | -                    | -                     |
| 其他利息收入                     |              | -                    | -                     |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          |              | 5,113,772.72         | 8,186,497.49          |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.1<br>2 | 996,203.33           | 4,449,604.63          |
| 基金投资收益                     | 6.4.7.1<br>3 | 253,277.46           | 266,656.01            |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.1<br>4 | -                    | -                     |
| 资产支持证券投资收益                 |              | -                    | -                     |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.1<br>5 | -                    | -                     |
| 股利收益                       | 6.4.7.1<br>6 | 3,864,291.93         | 3,470,236.85          |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.1<br>7 | 24,157,780.17        | -24,771,571.93        |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |              | -137,738.77          | -392,961.40           |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 6.4.7.1<br>8 | 88,847.55            | 176,258.20            |
| <b>减：二、费用</b>              |              | <b>1,366,698.65</b>  | <b>1,686,878.26</b>   |
| 1. 管理人报酬                   |              | 754,108.58           | 916,995.26            |
| 2. 托管费                     |              | 282,790.69           | 343,873.21            |
| 3. 销售服务费                   |              | -                    | -                     |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.1<br>9 | 42,923.24            | 82,429.44             |
| 5. 利息支出                    |              | -                    | -                     |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |              | -                    | -                     |
| 6. 其他费用                    | 6.4.7.2<br>0 | 286,876.14           | 343,580.35            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |              | <b>27,874,450.95</b> | <b>-18,465,549.10</b> |
| 减：所得税费用                    |              | -                    | -                     |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |              | <b>27,874,450.95</b> | <b>-18,465,549.10</b> |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发美国房地产指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期                              |
|----|---------------------------------|
|    | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |
|    |                                 |

|  | 实收基金                            | 未分配利润          | 所有者权益合计         |
|--|---------------------------------|----------------|-----------------|
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 129,276,291.73                  | 42,970,454.31  | 172,246,746.04  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                               | 27,874,450.95  | 27,874,450.95   |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | 78,061,473.19                   | 19,501,746.27  | 97,563,219.46   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 156,170,745.16                  | 37,450,554.95  | 193,621,300.11  |
| 2. 基金赎回款                               | -78,109,271.97                  | -17,948,808.68 | -96,058,080.65  |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -                               | -22,430,522.35 | -22,430,522.35  |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 207,337,764.92                  | 67,916,129.18  | 275,253,894.10  |
| 项目                                     | 上年度可比期间                         |                |                 |
|  | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |                |                 |
|  | 实收基金                            | 未分配利润          | 所有者权益合计         |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 138,744,825.00                  | 35,078,694.14  | 173,823,519.14  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                               | -18,465,549.10 | -18,465,549.10  |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | 2,570,946.97                    | 6,562,284.30   | 9,133,231.27    |
| 其中：1. 基金申购款                            | 153,195,991.47                  | 46,436,861.54  | 199,632,853.01  |
| 2. 基金赎回款                               | -150,625,044.50                 | -39,874,577.24 | -190,499,621.74 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -                               | -              | -               |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 141,315,771.97                  | 23,175,429.34  | 164,491,201.31  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

广发美国房地产指数证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2013]619号《关于同意广发美国房地产指数证券投资基金设立的批复》批准，由广发基金

管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》等有关规定和《广发美国房地产指数证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2013 年 8 月 9 日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，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。

本基金募集期为 2013 年 7 月 8 日至 2013 年 8 月 2 日，本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币 500,086,542.96 元，有效认购户数为 5,615 户。其中，认购款项在基金验资确认日之前产生的利息共计人民币 23,118.08 元，折合基金份额 23,118.08 份，按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定，本基金投资范围为美国 REITs 市场中的 MSCI 美国 REIT 指数（即 MSCI 美国房地产投资信托指数，英文名称为 MSCI US REIT Index）成份股、备选成份股、以 MSCI 美国 REIT 指数为投资标的的指数基金（包括 ETF）、新股（一级市场初次发行或增发）等，其中，对 MSCI 美国 REIT 指数成份股、备选成份股及以 MSCI 美国 REIT 指数为投资标的的指数基金（包括 ETF）的投资比例不低于基金资产的 90%，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%。本基金业绩比较基准：人民币计价的 MSCI 美国 REIT 指数（MSCI US REIT Index）。

本基金的财务报表于 2016 年 8 月 22 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定（以下简称“企业会计准则”）及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 06 月 30 日的财务状况以及 2016 年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

#### **6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。
2. 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征营业税和增值税。
3. 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。
4. 基金取得的源自境外的收入，其涉及的境外所得税按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目   | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 28,356,883.60          |
| 定期存款 | -                      |
| 其他存款 | -                      |
| 合计   | 28,356,883.60          |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目     | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日 |                |               |
|--------|------------------------|----------------|---------------|
|        | 成本                     | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票     | 190,389,295.12         | 227,479,393.65 | 37,090,098.53 |
| 债券     | 交易所市场                  | -              | -             |
|        | 银行间市场                  | -              | -             |
|        | 合计                     | -              | -             |
| 资产支持证券 | -                      | -              | -             |
| 基金     | 18,549,630.29          | 20,758,346.15  | 2,208,715.86  |

|    |                |                |               |
|----|----------------|----------------|---------------|
| 其他 | -              | -              | -             |
| 合计 | 208,938,925.41 | 248,237,739.80 | 39,298,814.39 |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2016年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 3,294.11          |
| 应收定期存款利息   | -                 |
| 应收其他存款利息   | -                 |
| 应收结算备付金利息  | -                 |
| 应收债券利息     | -                 |
| 应收买入返售证券利息 | -                 |
| 应收申购款利息    | -                 |
| 其他         | -                 |
| 合计         | 3,294.11          |

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2016年6月30日 |
|-------|-------------------|
| 其他应收款 | -                 |
| 待摊费用  | 96,431.71         |
| 合计    | 96,431.71         |

#### 6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2016年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | 13,822.06         |
| 预提费用        | 391,630.98        |
| 其他          | 86,935.03         |
| 合计          | 492,388.07        |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |                |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额           |
| 上年度末          | 129,276,291.73                        | 129,276,291.73 |
| 本期申购          | 156,170,745.16                        | 156,170,745.16 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -78,109,271.97                        | -78,109,271.97 |
| 本期末           | 207,337,764.92                        | 207,337,764.92 |

注：本期申购转换转入份（金）额，本期赎回含转换转出份（金）额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 上年度末           | 21,521,565.44  | 21,448,888.87  | 42,970,454.31  |
| 本期利润           | 3,716,670.78   | 24,157,780.17  | 27,874,450.95  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 3,414,592.16   | 16,087,154.11  | 19,501,746.27  |
| 其中：基金申购款       | 6,508,385.72   | 30,942,169.23  | 37,450,554.95  |
| 基金赎回款          | -3,093,793.56  | -14,855,015.12 | -17,948,808.68 |
| 本期已分配利润        | -22,430,522.35 | -              | -22,430,522.35 |
| 本期末            | 6,222,306.03   | 61,693,823.15  | 67,916,129.18  |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
|           | 活期存款利息收入                              |
| 定期存款利息收入  | -                                     |
| 其他存款利息收入  | -                                     |
| 结算备付金利息收入 | -                                     |
| 其他        | -                                     |
| 合计        | 18,487.93                             |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
|            | 卖出股票成交总额                              |
| 减：卖出股票成本总额 | 18,387,505.78                         |
| 买卖股票差价收入   | 996,203.33                            |

#### 6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

|               | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |
|---------------|---------------------------------|
| 卖出/赎回基金成交总额   | 6,532,438.12                    |
| 减：卖出/赎回基金成本总额 | 6,279,160.66                    |
| 基金投资收益        | 253,277.46                      |

#### 6.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期末无债券投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 3,526,010.37               |
| 基金投资产生的股利收益 | 338,281.56                 |
| 合计          | 3,864,291.93               |

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 24,157,780.17              |
| ——股票投资     | 22,070,757.43              |
| ——债券投资     | -                          |
| ——资产支持证券投资 | -                          |
| ——基金投资     | 2,087,022.74               |
| ——其他       | -                          |
| 2. 衍生工具    | -                          |
| ——权证投资     | -                          |
| 3. 其他      | -                          |
| 合计         | 24,157,780.17              |

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 88,692.84                  |
| 基金转换费收入 | 154.71                     |
| 合计      | 88,847.55                  |

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|----|----------------------------|
|----|----------------------------|



|           |           |
|-----------|-----------|
| 交易所市场交易费用 | 42,923.24 |
| 银行间市场交易费用 | -         |
| 合计        | 42,923.24 |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期                   |
|-------|----------------------|
|       | 2016年1月1日至2016年6月30日 |
| 审计费用  | 19,890.78            |
| 信息披露费 | 119,344.68           |
| 银行汇划费 | 21,699.39            |
| 指数使用费 | 64,753.67            |
| 数据费   | 61,187.62            |
| 合计    | 286,876.14           |

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称      | 与本基金的关系                    |
|------------|----------------------------|
| 广发基金管理有限公司 | 基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构 |
| 中国银行股份有限公司 | 基金托管人、代销机构                 |
| 中国银行纽约分行   | 基金境外资产托管人                  |

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的回购交易。

#### 6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金，本报告期末无应付关联方佣金余额。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期                   | 上年度可比期间              |
|-----------------|----------------------|----------------------|
|                 | 2016年1月1日至2016年6月30日 | 2015年1月1日至2015年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 754,108.58           | 916,995.26           |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 228,055.41           | 283,389.65           |

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.8% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

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 2 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。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                   | 上年度可比期间              |
|----------------|----------------------|----------------------|
|                | 2016年1月1日至2016年6月30日 | 2015年1月1日至2015年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 282,790.69           | 343,873.21           |

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.3% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

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 2 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、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |           | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |           |
|------------|---------------------------------------|-----------|--|-----------|
|            | 期末余额                                  | 当期利息收入    | 期末余额                                       | 当期利息收入    |
| 中国银行股份有限公司 | 27,471,814.68                         | 18,487.93 | 1,463,514.84                               | 22,047.80 |
| 中国银行纽约分行   | 885,068.92                            | -         | 2,821,360.50                               | -         |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司和境外资产托管人中国银行纽约分行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日      | 场内除息日 | 场外除息日      | 每 10 份基金份额分红数 | 现金形式发放总额      | 再投资形式发放总额    | 利润分配合计        | 备注 |
|----|------------|-------|------------|---------------|---------------|--------------|---------------|----|
| 1  | 2016-02-23 | -     | 2016-02-22 | 1.600         | 14,849,930.70 | 7,580,591.65 | 22,430,522.35 | -  |
| 合计 | -          | -     | -          | 1.600         | 14,849,930.70 | 7,580,591.65 | 22,430,522.35 | -  |

6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2016 年 06 月 30 日止，本基金无持有的暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 06 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 06 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回

购证券款，无抵押债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，在董事会下设立合规及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总裁负责。

本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总裁和风险控制委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险，本基金主要投资于信用等级较高的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。但是，随着短期资金市场的发展，本基金的投资范围扩大以后，可能会在一定程度上增加信用风险。

本报告期末及上年度末本基金未持有债券投资。

##### 6.4.13.3 流动性风险

开放式基金的流动性是指基金管理人为满足投资者赎回要求，在一定时间内将一定数量的基金资产按正常市场价格变现的能力。流动性风险指因市场交易量不足，导致不能以适当价格及时进行证券交易的风险，或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的违约风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，在一定程度上减轻了投资变现压力。本基金所持大部分交易性金融资产在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除前文披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。本基金所持有的其他金融负债以及可赎回基金份额净值(所有者权益)的合同约定到期日均为无固定期限且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人在对市场特征和发展形势等方面进行分析和判断的基础上，由投资决策委员会根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，由基金绩效评估与风险管理组具体计算与监控各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控。

##### 6.4.13.4 市场风险

本基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的重大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见的，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要是债券投资。本基金管理人通过久期、凸性、风险价值模型 (VAR) 等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2016年6月30日   | 1年以内          | 1-5年 | 5年以上 | 不计息            | 合计             |
|---------------------|---------------|------|------|----------------|----------------|
| 资产                  |               |      |      |                |                |
| 银行存款                | 28,356,883.60 | -    | -    | -              | 28,356,883.60  |
| 交易性金融资产             | -             | -    | -    | 248,237,739.80 | 248,237,739.80 |
| 应收股利                | -             | -    | -    | 744,062.14     | 744,062.14     |
| 应收利息                | -             | -    | -    | 3,294.11       | 3,294.11       |
| 应收申购款               | 297,065.19    | -    | -    | 1,998,940.07   | 2,296,005.26   |
| 应收证券清算款             | -             | -    | -    | 86,780.86      | 86,780.86      |
| 其他资产                | -             | -    | -    | 96,431.71      | 96,431.71      |
| 资产总计                | 28,653,948.79 | -    | -    | 251,167,248.69 | 279,821,197.48 |
| 负债                  |               |      |      |                |                |
| 应付赎回款               | -             | -    | -    | 3,861,638.86   | 3,861,638.86   |
| 应付管理人报酬             | -             | -    | -    | 155,110.16     | 155,110.16     |
| 应付托管费               | -             | -    | -    | 58,166.29      | 58,166.29      |
| 其他负债                | -             | -    | -    | 492,388.07     | 492,388.07     |
| 负债总计                | -             | -    | -    | 4,567,303.38   | 4,567,303.38   |
| 利率敏感度缺口             | 28,653,948.79 | -    | -    | 246,599,945.31 | 275,253,894.10 |
| 上年度末<br>2015年12月31日 | 1年以内          | 1-5年 | 5年以上 | 不计息            | 合计             |
| 资产                  |               |      |      |                |                |
| 银行存款                | 9,036,759.55  | -    | -    | -              | 9,036,759.55   |
| 交易性金融资产             | -             | -    | -    | 162,718,166.33 | 162,718,166.33 |
| 应收股利                | -             | -    | -    | 725,842.91     | 725,842.91     |
| 应收利息                | -             | -    | -    | 914.21         | 914.21         |
| 应收申购款               | 601,858.50    | -    | -    | 2,343,238.23   | 2,945,096.73   |

|         |              |   |   |                |                |
|---------|--------------|---|---|----------------|----------------|
| 应收证券清算款 | -            | - | - | 84,980.12      | 84,980.12      |
| 其他资产    | -            | - | - | 31,891.50      | 31,891.50      |
| 资产总计    | 9,638,618.05 | - | - | 165,905,033.30 | 175,543,651.35 |
| 负债      |              |   |   |                |                |
| 应付赎回款   | -            | - | - | 2,680,661.40   | 2,680,661.40   |
| 应付管理人报酬 | -            | - | - | 113,919.14     | 113,919.14     |
| 应付托管费   | -            | - | - | 42,719.67      | 42,719.67      |
| 其他负债    | -            | - | - | 459,605.10     | 459,605.10     |
| 负债总计    | -            | - | - | 3,296,905.31   | 3,296,905.31   |
| 利率敏感度缺口 | 9,638,618.05 | - | - | 162,608,127.99 | 172,246,746.04 |

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年期末未持有债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目              | 本期末<br>2016年6月30日 |             |               |                |
|-----------------|-------------------|-------------|---------------|----------------|
|                 | 美元<br>折合人民币       | 港币<br>折合人民币 | 其他币种<br>折合人民币 | 合计             |
| <b>以外币计价的资产</b> |                   |             |               |                |
| 银行存款            | 3,187,453.26      | -           | -             | 3,187,453.26   |
| 交易性金融资产         | 248,237,739.80    | -           | -             | 248,237,739.80 |
| 应收股利            | 744,062.14        | -           | -             | 744,062.14     |
| 应收利息            | 37.20             | -           | -             | 37.20          |
| 应收证券清算          | 86,780.86         | -           | -             | 86,780.86      |

|                           |                       |             |               |                       |
|---------------------------|-----------------------|-------------|---------------|-----------------------|
| 款                         |                       |             |               |                       |
| 应收申购款                     | 88,599.86             | -           | -             | 88,599.86             |
| 待摊费用                      | 96,431.71             | -           | -             | 96,431.71             |
| <b>资产合计</b>               | <b>252,441,104.83</b> | <b>-</b>    | <b>-</b>      | <b>252,441,104.83</b> |
| <b>以外币计价的负债</b>           |                       |             |               |                       |
| 应付赎回款                     | 6,825.89              | -           | -             | 6,825.89              |
| 其他负债                      | 199,356.28            | -           | -             | 199,356.28            |
| <b>负债合计</b>               | <b>206,182.17</b>     | <b>-</b>    | <b>-</b>      | <b>206,182.17</b>     |
| <b>资产负债表<br/>外汇风险敞口净额</b> | <b>252,234,922.66</b> | <b>-</b>    | <b>-</b>      | <b>252,234,922.66</b> |
| 项目                        | 上年度末<br>2015年12月31日   |             |               |                       |
|                           | 美元<br>折合人民币           | 港币<br>折合人民币 | 其他币种<br>折合人民币 | 合计                    |
| <b>以外币计价的资产</b>           |                       |             |               |                       |
| 银行存款                      | 8,081,363.58          | -           | -             | 8,081,363.58          |
| 交易性金融资产                   | 162,718,166.33        | -           | -             | 162,718,166.33        |
| 应收股利                      | 725,842.91            | -           | -             | 725,842.91            |
| 应收利息                      | 30.26                 | -           | -             | 30.26                 |
| 应收证券清算款                   | 84,980.12             | -           | -             | 84,980.12             |
| 应收申购款                     | 38,560.62             | -           | -             | 38,560.62             |
| 待摊费用                      | 31,891.50             | -           | -             | 31,891.50             |
| <b>资产合计</b>               | <b>171,680,835.32</b> | <b>-</b>    | <b>-</b>      | <b>171,680,835.32</b> |
| <b>以外币计价的负债</b>           |                       |             |               |                       |
| 应付赎回款                     | 1,570,741.32          | -           | -             | 1,570,741.32          |
| 其他负债                      | 136,694.63            | -           | -             | 136,694.63            |
| <b>负债合计</b>               | <b>1,707,435.95</b>   | <b>-</b>    | <b>-</b>      | <b>1,707,435.95</b>   |
| <b>资产负债表<br/>外汇风险敞口净额</b> | <b>169,973,399.37</b> | <b>-</b>    | <b>-</b>      | <b>169,973,399.37</b> |

|     |  |  |  |  |
|-----|--|--|--|--|
| 口净额 |  |  |  |  |
|-----|--|--|--|--|

#### 6.4.13.4.2 外汇风险的敏感性分析

| 分析 | 相关风险变量的变动      | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                  |
|----|----------------|-----------------------------|------------------|
|    |                | 本期末                         | 上年度末             |
|    |                | 2016 年 6 月 30 日             | 2015 年 12 月 31 日 |
|    | 所有外币相对人民币升值 5% | 12,611,746.13               | 8,498,669.97     |
|    | 所有外币相对人民币贬值 5% | -12,611,746.13              | -8,498,669.97    |

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、风险价值模型 (VAR) 等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日 |               | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |               |
|--------------|------------------------|---------------|--------------------------|---------------|
|              | 公允价值                   | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值                     | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 227,479,393.65         | 82.64         | 155,766,024.40           | 90.43         |
| 交易性金融资产—基金投资 | 20,758,346.15          | 7.54          | 6,952,141.93             | 4.04          |
| 交易性金融资产—债券投资 | -                      | -             | -                        | -             |
| 衍生金融资产—权证投资  | -                      | -             | -                        | -             |
| 其他           | -                      | -             | -                        | -             |
| 合计           | 248,237,739.80         | 90.19         | 162,718,166.33           | 94.47         |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 分析 | 相关风险变量的变动   | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                  |
|----|-------------|-----------------------------|------------------|
|    |             | 本期末                         | 上年度末             |
|    |             | 2016 年 6 月 30 日             | 2015 年 12 月 31 日 |
|    | 业绩比较基准上升 5% | 11,610,769.96               | 7,738,875.99     |
|    | 业绩比较基准下降 5% | -11,610,769.96              | -7,738,875.99    |



#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 1. 公允价值

##### (1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

##### (2) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级参见本基金最近一期年报。

##### (ii) 各层级金融工具公允价值

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 248,237,739.80 元，无属于第二层级和第三层级的余额（2015 年 12 月 31 日：第一层级 162,718,166.33 元，无属于第二层级和第三层级的余额）。

##### (iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

2. 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目      | 金额             | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|---------|----------------|---------------|
| 1  | 权益投资    | 227,479,393.65 | 81.29         |
|    | 其中：普通股  | -              | -             |
|    | 存托凭证    | -              | -             |
|    | 优先股     | -              | -             |
|    | 房地产信托凭证 | 227,479,393.65 | 81.29         |
| 2  | 基金投资    | 20,758,346.15  | 7.42          |
| 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      | 28,356,883.60  | 10.13  |
| 8 | 其他各项资产            | 3,226,574.08   | 1.15   |
| 9 | 合计                | 279,821,197.48 | 100.00 |

## 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

| 国家（地区） | 公允价值           | 占基金资产净值比例（%） |
|--------|----------------|--------------|
| 美国     | 227,479,393.65 | 82.64        |
| 合计     | 227,479,393.65 | 82.64        |

注：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。

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

| 行业类别   | 公允价值           | 占基金资产净值比例（%） |
|--------|----------------|--------------|
| 能源     | -              | -            |
| 材料     | -              | -            |
| 工业     | -              | -            |
| 非必须消费品 | -              | -            |
| 必须消费品  | -              | -            |
| 保健     | -              | -            |
| 金融     | 227,479,393.65 | 82.64        |
| 信息技术   | -              | -            |
| 电信服务   | -              | -            |
| 公共事业   | -              | -            |
| 合计     | 227,479,393.65 | 82.64        |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称<br>(英文)                         | 公司名称<br>(中文)              | 证券代码    | 所在证<br>券市场        | 所属国家<br>(地区) | 数量 (股)    | 公允价值          | 占基金资<br>产净值比<br>例 (%) |
|----|--------------------------------------|---------------------------|---------|-------------------|--------------|-----------|---------------|-----------------------|
| 1  | SIMON<br>PROPERTY<br>GROUP INC       | 西蒙房地<br>产集团公<br>司         | SPG US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国           | 12,752.00 | 18,341,294.43 | 6.66                  |
| 2  | PUBLIC<br>STORAGE                    | 公共存储<br>公司                | PSA US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国           | 6,065.00  | 10,279,376.89 | 3.73                  |
| 3  | WELLTOWE<br>R INC                    | Welltower<br>股份有限<br>公司   | HCN US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国           | 14,630.00 | 7,389,591.11  | 2.68                  |
| 4  | EQUINIX<br>INC                       | Equinix 公<br>司            | EQIX US | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国           | 2,844.00  | 7,312,251.56  | 2.66                  |
| 5  | PROLOGIS<br>INC                      | 普洛斯公<br>司                 | PLD US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国           | 21,647.00 | 7,039,475.56  | 2.56                  |
| 6  | EQUITY<br>RESIDENT<br>IAL            | 公寓物业<br>权益信托              | EQR US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国           | 15,027.00 | 6,863,688.28  | 2.49                  |
| 7  | AVALONBA<br>Y<br>COMMUNIT<br>IES INC | AvalonBay<br>社区股份<br>有限公司 | AVB US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国           | 5,653.00  | 6,762,130.86  | 2.46                  |
| 8  | VENTAS<br>INC                        | Ventas 公<br>司             | VTR US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国           | 13,825.00 | 6,675,871.08  | 2.43                  |
| 9  | BOSTON<br>PROPERTI<br>ES INC         | 波士顿地<br>产公司               | BXP US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国           | 6,336.00  | 5,541,815.85  | 2.01                  |
| 10 | REALTY<br>INCOME<br>CORP             | Realty<br>Income 公<br>司   | O US    | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国           | 10,343.00 | 4,757,159.75  | 1.73                  |
| 11 | GENERAL<br>GROWTH<br>PROPERTI<br>ES  | 通用增长<br>物业公司              | GGP US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国           | 23,640.00 | 4,674,629.96  | 1.70                  |
| 12 | VORNADO<br>REALTY<br>TRUST           | 沃那多房<br>地产信托              | VNO US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国           | 6,998.00  | 4,646,082.38  | 1.69                  |

|    |                                    |                                 |        |                 |    |           |              |      |
|----|------------------------------------|---------------------------------|--------|-----------------|----|-----------|--------------|------|
| 13 | HCP INC                            | HCP 公司                          | HCP US | 纽约证<br>券交易<br>所 | 美国 | 19,165.00 | 4,496,336.22 | 1.63 |
| 14 | DIGITAL<br>REALTY<br>TRUST INC     | 数字房地<br>产信托有<br>限公司             | DLR US | 纽约证<br>券交易<br>所 | 美国 | 6,159.00  | 4,451,321.71 | 1.62 |
| 15 | ESSEX<br>PROPERTY<br>TRUST INC     | 埃塞克斯<br>房地产信<br>托公司             | ESS US | 纽约证<br>券交易<br>所 | 美国 | 2,697.00  | 4,079,240.57 | 1.48 |
| 16 | KIMCO<br>REALTY<br>CORP            | Kimco 房地<br>产公司                 | KIM US | 纽约证<br>券交易<br>所 | 美国 | 16,997.00 | 3,536,855.69 | 1.28 |
| 17 | HOST<br>HOTELS &<br>RESORTS<br>INC | Host 酒店<br>及度假酒<br>店公司          | HST US | 纽约证<br>券交易<br>所 | 美国 | 31,109.00 | 3,343,960.91 | 1.21 |
| 18 | EXTRA<br>SPACE<br>STORAGE<br>INC   | Extra<br>Space<br>Storage<br>公司 | EXR US | 纽约证<br>券交易<br>所 | 美国 | 5,130.00  | 3,148,030.90 | 1.14 |
| 19 | FEDERAL<br>REALTY<br>INVS<br>TRUST | 联邦房地<br>产投资信<br>托公司             | FRT US | 纽约证<br>券交易<br>所 | 美国 | 2,860.00  | 3,139,694.16 | 1.14 |
| 20 | MACERICH<br>CO/THE                 | Macerich<br>公司                  | MAC US | 纽约证<br>券交易<br>所 | 美国 | 5,246.00  | 2,970,485.43 | 1.08 |
| 21 | SL GREEN<br>REALTY<br>CORP         | SL Green<br>房地产公<br>司           | SLG US | 纽约证<br>券交易<br>所 | 美国 | 4,112.00  | 2,903,170.13 | 1.05 |
| 22 | IRON<br>MOUNTAIN<br>INC            | 美国铁山<br>公司                      | IRM US | 纽约证<br>券交易<br>所 | 美国 | 10,450.00 | 2,760,061.27 | 1.00 |
| 23 | UDR INC                            | UDR 公司                          | UDR US | 纽约证<br>券交易<br>所 | 美国 | 10,797.00 | 2,643,363.69 | 0.96 |
| 24 | DUKE<br>REALTY<br>CORP             | 杜克房地<br>产公司                     | DRE US | 纽约证<br>券交易<br>所 | 美国 | 14,321.00 | 2,531,777.97 | 0.92 |
| 25 | VEREIT<br>INC                      | VEREIT 股<br>份有限公<br>司           | VER US | 纽约证<br>券交易<br>所 | 美国 | 34,523.00 | 2,321,339.22 | 0.84 |
| 26 | REGENCY<br>CENTERS<br>CORP         | Regency<br>Centers<br>公司        | REG US | 纽约证<br>券交易<br>所 | 美国 | 4,024.00  | 2,234,247.03 | 0.81 |

|    |                               |                        |         |           |    |           |              |      |
|----|-------------------------------|------------------------|---------|-----------|----|-----------|--------------|------|
| 27 | MID-AMERICA APARTMENT COMM    | -                      | MAA US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 3,091.00  | 2,180,884.97 | 0.79 |
| 28 | CAMDEN PROPERTY TRUST         | Camden 房地产信托公司         | CPT US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 3,583.00  | 2,100,822.91 | 0.76 |
| 29 | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT  | 亚历山大房地产股份有限公司          | ARE US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 3,042.00  | 2,088,216.87 | 0.76 |
| 30 | NATIONAL RETAIL PROPERTIES    | -                      | NNN US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 5,901.00  | 2,023,840.38 | 0.74 |
| 31 | APARTMENT INVT & MGMT CO -A   | 公寓投资与管理                | AIV US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 6,472.00  | 1,895,220.30 | 0.69 |
| 32 | AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES   | 美国校园社区公司               | ACC US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 5,234.00  | 1,834,996.14 | 0.67 |
| 33 | WP CAREY INC                  | 楷蕊公司                   | WPC US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 3,982.00  | 1,833,065.53 | 0.67 |
| 34 | GAMING AND LEISURE PROPERTIES | 博彩及休闲房地产股份有限公司         | GLPI US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 7,889.00  | 1,803,770.75 | 0.66 |
| 35 | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES   | Equity Lifestyle 房地产公司 | ELS US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 3,313.00  | 1,758,631.71 | 0.64 |
| 36 | OMEGA HEALTHCARE INVESTORS    | -                      | OHI US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 7,794.00  | 1,754,657.30 | 0.64 |
| 37 | KILROY REALTY CORP            | Kilroy 房地产公司           | KRC US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 3,782.00  | 1,662,500.06 | 0.60 |
| 38 | SPIRIT                        | Spirit 房               | SRC US  | 纽约证       | 美国 | 19,563.00 | 1,656,603.13 | 0.60 |

|    |  |                                  |          |                   |    |           |              |      |
|----|--|----------------------------------|----------|-------------------|----|-----------|--------------|------|
|    | REALTY<br>CAPITAL<br>INC               | 地产资本<br>股份有限<br>公司               |          | 券交易<br>所          |    |           |              |      |
| 39 | LIBERTY<br>PROPERTY<br>TRUST           | Liberty<br>房地产信<br>托公司           | LPT US   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 6,065.00  | 1,597,468.02 | 0.58 |
| 40 | DDR CORP                               | DDR 公司                           | DDR US   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 12,402.00 | 1,491,836.18 | 0.54 |
| 41 | CUBESMAR<br>T                          | -                                | CUBE US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 7,275.00  | 1,489,712.34 | 0.54 |
| 42 | BRIXMOR<br>PROPERTY<br>GROUP INC       | Brixmor 房<br>地产集团<br>股份有限<br>公   | BRX US   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 8,398.00  | 1,473,526.11 | 0.54 |
| 43 | FOREST<br>CITY<br>REALTY<br>TRUST- A   | Forest<br>City 房地<br>产信托股<br>份有  | FCE/A US | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 9,651.00  | 1,427,788.94 | 0.52 |
| 44 | EPR<br>PROPERTI<br>ES                  | -                                | EPR US   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 2,630.00  | 1,407,063.72 | 0.51 |
| 45 | SENIOR<br>HOUSING<br>PROP<br>TRUST     | 老年公寓<br>房地产信<br>托公司              | SNH US   | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 9,832.00  | 1,358,073.47 | 0.49 |
| 46 | HIGHWOOD<br>S<br>PROPERTI<br>ES INC    | 海伍兹房<br>地产公司                     | HIW US   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 3,822.00  | 1,338,186.77 | 0.49 |
| 47 | DOUGLAS<br>EMMETT<br>INC               | Douglas<br>Emmett 股<br>份有限公<br>司 | DEI US   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 5,615.00  | 1,322,558.36 | 0.48 |
| 48 | WEINGART<br>EN REALTY<br>INVESTOR<br>S | -                                | WRI US   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 4,735.00  | 1,281,696.24 | 0.47 |
| 49 | SOVRAN<br>SELF<br>STORAGE<br>INC       | Sovran 自<br>存储公司                 | SSS US   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,833.00  | 1,275,301.51 | 0.46 |
| 50 | SUN<br>COMMUNIT                        | Sun<br>Communiti                 | SUI US   | 纽约证<br>券交易        | 美国 | 2,420.00  | 1,229,880.71 | 0.45 |

|    |                                  |                             |         |           |    |           |              |      |
|----|----------------------------------|-----------------------------|---------|-----------|----|-----------|--------------|------|
|    | IES INC                          | es 公司                       |         | 所         |    |           |              |      |
| 51 | HOSPITALITY PROPERTIES TRUST     | 酒店物业信托公司                    | HPT US  | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 6,309.00  | 1,204,883.74 | 0.44 |
| 52 | STORE CAPITAL CORP               | STORE 资本公司                  | STOR US | 纽约证券交易所   | 美国 | 6,092.00  | 1,189,699.61 | 0.43 |
| 53 | TAUBMAN CENTERS INC              | 塔伯曼中心公司                     | TCO US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 2,394.00  | 1,177,931.89 | 0.43 |
| 54 | HEALTHCARE TRUST OF AMERICA      | 美国医疗保健信托公司                  | HTA US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 5,261.00  | 1,128,237.28 | 0.41 |
| 55 | DCT INDUSTRIAL TRUST INC         | DCT 工业信托公司                  | DCT US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 3,535.00  | 1,126,119.67 | 0.41 |
| 56 | CORRECTIONS CORP OF AMERICA      | 美国惩教公司                      | CXW US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 4,724.00  | 1,097,029.12 | 0.40 |
| 57 | RETAIL PROPERTIES OF AMERICA - A | 美国零售物业公司                    | RPAI US | 纽约证券交易所   | 美国 | 9,487.00  | 1,063,182.29 | 0.39 |
| 58 | CYRUSONE INC                     | CyrusOne 股份有限公司             | CONE US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 2,796.00  | 1,031,982.89 | 0.37 |
| 59 | GRAMERCY PROPERTY TRUST          | Gramercy 物业信托               | GPT US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 16,702.00 | 1,021,154.67 | 0.37 |
| 60 | TANGER FACTORY OUTLET CENTER     | 坦格尔工厂直销中心                   | SKT US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 3,822.00  | 1,018,339.86 | 0.37 |
| 61 | MEDICAL PROPERTIES TRUST INC     | Medical Properties Trust 股份 | MPW US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 9,560.00  | 964,226.88   | 0.35 |
| 62 | HEALTHCARE REALTY TRUST INC      | 医疗保健房地产信托公司                 | HR US   | 纽约证券交易所   | 美国 | 4,079.00  | 946,432.78   | 0.34 |
| 63 | AMERICAN                         | -                           | AMH US  | 纽约证       | 美国 | 6,799.00  | 923,351.63   | 0.34 |

|    |  |                                    |         |                 |    |          |            |      |
|----|--|------------------------------------|---------|-----------------|----|----------|------------|------|
|    | HOMES 4<br>RENT- A                     |                                    |         | 券交易<br>所        |    |          |            |      |
| 64 | EQUITY<br>COMMONWE<br>ALTH             | CommonWea<br>lth 房地产<br>投资信托       | EQC US  | 纽约证<br>券交易<br>所 | 美国 | 4,744.00 | 916,383.56 | 0.33 |
| 65 | DUPONT<br>FABROS<br>TECHNOLO<br>GY     | 杜邦法布<br>罗斯科技<br>公司                 | DFT US  | 纽约证<br>券交易<br>所 | 美国 | 2,902.00 | 914,847.51 | 0.33 |
| 66 | POST<br>PROPERTI<br>ES INC             | Post 房地<br>产公司                     | PPS US  | 纽约证<br>券交易<br>所 | 美国 | 2,151.00 | 870,799.57 | 0.32 |
| 67 | FIRST<br>INDUSTRI<br>AL REALTY<br>TR   | 第一工业<br>地产信托<br>公司                 | FR US   | 纽约证<br>券交易<br>所 | 美国 | 4,660.00 | 859,676.73 | 0.31 |
| 68 | PIEDMONT<br>OFFICE<br>REALTY<br>TRU-A  | 皮德蒙特<br>办公地产<br>信托有限<br>公司         | PDM US  | 纽约证<br>券交易<br>所 | 美国 | 5,767.00 | 823,735.49 | 0.30 |
| 69 | APPLE<br>HOSPITAL<br>ITY REIT<br>INC   | Apple<br>Hospitali<br>ty 房地产<br>投资 | APLE US | 纽约证<br>券交易<br>所 | 美国 | 6,603.00 | 823,611.15 | 0.30 |
| 70 | BRANDYWI<br>NE REALTY<br>TRUST         | Brandywin<br>e 房地产<br>信托           | BDN US  | 纽约证<br>券交易<br>所 | 美国 | 7,026.00 | 782,725.63 | 0.28 |
| 71 | URBAN<br>EDGE<br>PROPERTI<br>ES        | Urban Edge<br>房地产                  | UE US   | 纽约证<br>券交易<br>所 | 美国 | 3,926.00 | 777,377.96 | 0.28 |
| 72 | EQUITY<br>ONE INC                      | Equity One<br>公司                   | EQY US  | 纽约证<br>券交易<br>所 | 美国 | 3,640.00 | 776,746.94 | 0.28 |
| 73 | EDUCATIO<br>N REALTY<br>TRUST INC      | 教育房地<br>产信托公<br>司                  | EDR US  | 纽约证<br>券交易<br>所 | 美国 | 2,504.00 | 766,132.77 | 0.28 |
| 74 | NATL<br>HEALTH<br>INVESTOR<br>S INC    | -                                  | NHI US  | 纽约证<br>券交易<br>所 | 美国 | 1,515.00 | 754,374.26 | 0.27 |
| 75 | CORPORAT<br>E OFFICE<br>PROPERTI<br>ES | 企业办公<br>物业信托<br>公司                 | OFC US  | 纽约证<br>券交易<br>所 | 美国 | 3,783.00 | 741,787.98 | 0.27 |



|    |                               |                     |         |         |    |          |            |      |
|----|-------------------------------|---------------------|---------|---------|----|----------|------------|------|
| 76 | NATIONAL STORAGE AFFILIATES   | 美国全国仓储联营信托          | NSA US  | 纽约证券交易所 | 美国 | 5,279.00 | 728,827.10 | 0.26 |
| 77 | CORESITE REALTY CORP          | Coresite 房地产公司      | COR US  | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,234.00 | 725,741.47 | 0.26 |
| 78 | PHYSICIANS REALTY TRUST       | Physician's 房地产投资信托 | DOC US  | 纽约证券交易所 | 美国 | 5,167.00 | 719,874.25 | 0.26 |
| 79 | PARAMOUNT GROUP INC           | 百乐门集团有限公司           | PGRE US | 纽约证券交易所 | 美国 | 6,753.00 | 713,801.07 | 0.26 |
| 80 | RLJ LODGING TRUST             | RLJ Lodging 信托      | RLJ US  | 纽约证券交易所 | 美国 | 4,993.00 | 710,200.53 | 0.26 |
| 81 | QTS REALTY TRUST INC-CL A     | QTS 房地产信托公司         | QTS US  | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,900.00 | 705,307.69 | 0.26 |
| 82 | LASALLE HOTEL PROPERTIES      | LaSalle 酒店置业        | LHO US  | 纽约证券交易所 | 美国 | 4,455.00 | 696,600.27 | 0.25 |
| 83 | HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC | 哈德森太平洋地产公司          | HPP US  | 纽约证券交易所 | 美国 | 3,548.00 | 686,532.38 | 0.25 |
| 84 | GEO GROUP INC/THE             | Geo 集团公司            | GEO US  | 纽约证券交易所 | 美国 | 3,025.00 | 685,629.61 | 0.25 |
| 85 | SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC  | Sunstone 酒店投资者公司    | SHO US  | 纽约证券交易所 | 美国 | 8,519.00 | 681,848.70 | 0.25 |
| 86 | ACADIA REALTY TRUST           | 阿卡迪亚不动产信托           | AKR US  | 纽约证券交易所 | 美国 | 2,856.00 | 672,702.88 | 0.24 |
| 87 | COLUMBIA PROPERTY TRUST INC   | 哥伦比亚房地产信托公司         | CXP US  | 纽约证券交易所 | 美国 | 4,730.00 | 671,223.33 | 0.24 |
| 88 | KITE REALTY GROUP TRUST       | 凯特地产信托              | KRG US  | 纽约证券交易所 | 美国 | 3,339.00 | 620,628.40 | 0.23 |

|     |  |                                    |         |                   |    |          |            |      |
|-----|--|------------------------------------|---------|-------------------|----|----------|------------|------|
| 89  | RYMAN<br>HOSPITAL<br>ITY<br>PROPERTI<br>ES | Ryman 酒店<br>房地产股<br>份有限公<br>司      | RHP US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,828.00 | 613,970.87 | 0.22 |
| 90  | EMPIRE<br>STATE<br>REALTY<br>TRUST-A       | Empire<br>State 房地<br>产信托公<br>司    | ESRT US | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 4,789.00 | 603,061.95 | 0.22 |
| 91  | MACK-CAL<br>I REALTY<br>CORP               | Mack-Cali<br>房地产公<br>司             | CLI US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 3,361.00 | 601,761.51 | 0.22 |
| 92  | EASTGROU<br>P<br>PROPERTI<br>ES INC        | EastGroup<br>房地产公<br>司             | EGP US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,280.00 | 584,988.55 | 0.21 |
| 93  | RETAIL<br>OPPORTUN<br>ITY<br>INVESTME<br>N | Retail<br>Opportuni<br>ty 投资公<br>司 | ROIC US | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 4,054.00 | 582,552.11 | 0.21 |
| 94  | CARE<br>CAPITAL<br>PROPERTI<br>ES INC      | Care<br>Capital 房<br>地产股份<br>有限公   | CCP US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 3,344.00 | 581,199.75 | 0.21 |
| 95  | WASHINGT<br>ON REIT                        | 华盛顿房<br>地产投资<br>信托                 | WRE US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 2,776.00 | 579,122.32 | 0.21 |
| 96  | LEXINGTO<br>N REALTY<br>TRUST              | 莱星顿置<br>业信托                        | LXP US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 8,464.00 | 567,438.68 | 0.21 |
| 97  | PS<br>BUSINESS<br>PARKS<br>INC/CA          | PS 商业园<br>区有限公<br>司                | PSB US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 804.00   | 565,563.91 | 0.21 |
| 98  | NORTHSTA<br>R REALTY<br>FINANCE            | 北星房地<br>产金融公<br>司                  | NRF US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 7,439.00 | 563,836.15 | 0.20 |
| 99  | COUSINS<br>PROPERTI<br>ES INC              | Cousins<br>房地产公<br>司               | CUZ US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 8,020.00 | 553,095.13 | 0.20 |
| 100 | WP<br>GLIMCHER<br>INC                      | WP<br>GLIMCHER<br>股份有限<br>公司       | WPG US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 7,105.00 | 527,213.22 | 0.19 |

|     |   |                                       |         |                   |    |          |            |      |
|-----|---|---------------------------------------|---------|-------------------|----|----------|------------|------|
| 101 | LTC<br>PROPERTIES<br>INC                  | LTC 房地<br>产公司                         | LTC US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,517.00 | 520,379.51 | 0.19 |
| 102 | XENIA<br>HOTELS &<br>RESORTS<br>INC       | Xenia 酒店<br>与度假村<br>股份有限<br>公司        | XHR US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 4,559.00 | 507,286.93 | 0.18 |
| 103 | PEBBLEBR<br>OOK HOTEL<br>TRUST            | Pebblebro<br>ok 酒店信<br>托公司            | PEB US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 2,906.00 | 505,844.51 | 0.18 |
| 104 | DIAMONDR<br>OCK<br>HOSPITAL<br>ITY CO     | DiamondRo<br>ck<br>Hospitali<br>ty 公司 | DRH US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 8,152.00 | 488,139.61 | 0.18 |
| 105 | SELECT<br>INCOME<br>REIT                  | -                                     | SIR US  | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 2,637.00 | 454,473.47 | 0.17 |
| 106 | STAG<br>INDUSTRI<br>AL INC                | STAG 实业<br>公司                         | STAG US | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 2,743.00 | 433,089.18 | 0.16 |
| 107 | RAMCO-GE<br>RSHENSON<br>PROPERTI<br>ES    | Ramco-Ger<br>shenson<br>房地产信<br>托     | RPT US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 3,258.00 | 423,663.26 | 0.15 |
| 108 | MONOGRAM<br>RESIDENT<br>IAL TRUST<br>I    | Monogram<br>住宅信托<br>公司                | MORE US | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 6,183.00 | 418,617.25 | 0.15 |
| 109 | GOVERNME<br>NT<br>PROPERTI<br>ES INCOME   | 政府资产<br>收益信托                          | GOV US  | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 2,689.00 | 411,189.70 | 0.15 |
| 110 | PENN REAL<br>ESTATE<br>INVEST<br>TST      | 宾夕法尼<br>亚房地产<br>投资信托                  | PEI US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 2,818.00 | 400,830.18 | 0.15 |
| 111 | CBL &<br>ASSOCIAT<br>ES<br>PROPERTI<br>ES | CBL &<br>Associate<br>s 房地产公<br>司     | CBL US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 6,431.00 | 397,027.25 | 0.14 |
| 112 | NEW YORK<br>REIT INC                      | 纽约房地<br>产投资信<br>托股份有<br>限公            | NYRT US | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 6,386.00 | 391,708.30 | 0.14 |

|     |                               |                             |         |           |    |          |            |      |
|-----|-------------------------------|-----------------------------|---------|-----------|----|----------|------------|------|
| 113 | AMERICAN ASSETS TRUST INC     | 美国资产信托公司                    | AAT US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 1,357.00 | 381,897.97 | 0.14 |
| 114 | CHESAPEAKE LODGING TRUST      | Chesapeake Lodging 信托       | CHSP US | 纽约证券交易所   | 美国 | 2,395.00 | 369,250.08 | 0.13 |
| 115 | PARKWAY PROPERTIES INC        | Parkway 房地产公司               | PKY US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 3,317.00 | 367,987.90 | 0.13 |
| 116 | SABRA HEALTH CARE REIT INC    | Sabra 医疗保健房地产投资信托           | SBRA US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 2,646.00 | 362,064.91 | 0.13 |
| 117 | REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | Rexford Industrial Realty 股 | REXR US | 纽约证券交易所   | 美国 | 2,475.00 | 346,133.72 | 0.13 |
| 118 | GLOBAL NET LEASE INC          | Global Net 租赁股份有限公司         | GNL US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 6,469.00 | 341,033.00 | 0.12 |
| 119 | COLONY STARWOOD HOMES         | 柯罗尼喜达屋住宅信托                  | SFR US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 1,605.00 | 323,762.37 | 0.12 |
| 120 | FOUR CORNERS PROPERTY TRUST   | Four Corners 房地产信托股份有       | FCPT US | 纽约证券交易所   | 美国 | 2,306.00 | 314,852.96 | 0.11 |
| 121 | SERITAGE GROWTH PROP- A REIT  | Seritage 成长房地产投资信托公         | SRG US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 930.00   | 307,364.08 | 0.11 |
| 122 | TERRENO REALTY CORP           | Terreno 房地产公司               | TRNO US | 纽约证券交易所   | 美国 | 1,743.00 | 299,010.16 | 0.11 |
| 123 | SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC   | Summit 酒店物业公司               | INN US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 3,390.00 | 297,632.13 | 0.11 |
| 124 | AGREE REALTY CORP             | 艾格里不动产公司                    | ADC US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 904.00   | 289,179.74 | 0.11 |
| 125 | FRANKLIN STREET PROPERTIES    | Franklin Street 物业公司        | FSP US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 3,318.00 | 269,968.49 | 0.10 |

|     |                                |                         |         |           |    |          |            |      |
|-----|--------------------------------|-------------------------|---------|-----------|----|----------|------------|------|
|     | ES C                           |                         |         |           |    |          |            |      |
| 126 | ALEXANDER'S INC                | 亚历山大公司                  | ALX US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 91.00    | 246,945.42 | 0.09 |
| 127 | FELCOR LODGING TRUST INC       | FelCor Lodging 信托公司     | FCH US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 5,515.00 | 227,837.75 | 0.08 |
| 128 | CHATHAM LODGING TRUST          | Chatham Lodging 信托      | CLDT US | 纽约证券交易所   | 美国 | 1,511.00 | 220,233.96 | 0.08 |
| 129 | CARETRUST REIT INC             | CareTrust REIT 有限公司     | CTRE US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 2,391.00 | 218,484.64 | 0.08 |
| 130 | INVESTORS REAL ESTATE TRUST    | IRET 房产信托               | IRET US | 纽约证券交易所   | 美国 | 5,019.00 | 215,334.49 | 0.08 |
| 131 | MONMOUTH REAL ESTATE INV COR   | -                       | MNR US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 2,403.00 | 211,295.10 | 0.08 |
| 132 | SAUL CENTERS INC               | 邵罗中心公司                  | BFS US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 500.00   | 204,605.68 | 0.07 |
| 133 | NEW SENIOR INVESTMENT GROUP    | New Senior 投资集团 股份有限公司  | SNR US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 2,884.00 | 204,248.39 | 0.07 |
| 134 | HERSHA HOSPITALITY TRUST       | Hersha 酒店信托             | HT US   | 纽约证券交易所   | 美国 | 1,753.00 | 199,360.07 | 0.07 |
| 135 | ROUSE PROPERTIES INC           | Rouse 地产公司              | RSE US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 1,581.00 | 191,331.67 | 0.07 |
| 136 | TIER REIT INC                  | Tier 房地产投资信托股份有限公司      | TIER US | 纽约证券交易所   | 美国 | 1,750.00 | 177,898.52 | 0.06 |
| 137 | UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME | Universal Health 不动产投资信 | UHT US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 451.00   | 171,006.58 | 0.06 |
| 138 | EASTERLY GOVERNMENT            | Easterly 政府物业股份有限公司     | DEA US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 1,269.00 | 166,027.81 | 0.06 |

|     | PROPERTI                     | 公司                        |        |         |    |          |            |      |
|-----|------------------------------|---------------------------|--------|---------|----|----------|------------|------|
| 139 | SILVER BAY REALTY TRUST CORP | Silver Bay 房地产信托公司        | SBY US | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,371.00 | 154,826.12 | 0.06 |
| 140 | GETTY REALTY CORP            | Getty 房地产公司               | GTU US | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,083.00 | 154,045.10 | 0.06 |
| 141 | CEDAR REALTY TRUST INC       | Cedar 房地产信托公司             | CDR US | 纽约证券交易所 | 美国 | 3,108.00 | 153,130.59 | 0.06 |
| 142 | NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP | NorthStar 房地产欧洲公司         | NRE US | 纽约证券交易所 | 美国 | 2,468.00 | 151,383.66 | 0.05 |
| 143 | URSTADT BIDDLE - CLASS A     | Urstadt Biddle 房地产公司      | UBA US | 纽约证券交易所 | 美国 | 875.00   | 143,780.99 | 0.05 |
| 144 | ASHFORD HOSPITALITY TRUST    | Ashford 酒店信托公司            | AHT US | 纽约证券交易所 | 美国 | 3,858.00 | 137,381.62 | 0.05 |
| 145 | FIRST POTOMAC REALTY TRUST   | 第一波托马克房地产信托               | FPO US | 纽约证券交易所 | 美国 | 2,230.00 | 136,045.70 | 0.05 |
| 146 | ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN | -                         | AHP US | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,024.00 | 96,015.53  | 0.03 |
| 147 | WHITESTONE REIT              | Whitestone REIT 公司        | WSR US | 纽约证券交易所 | 美国 | 917.00   | 91,698.62  | 0.03 |
| 148 | RAIT FINANCIAL TRUST         | RAIT 金融信托公司               | RAS US | 纽约证券交易所 | 美国 | 3,969.00 | 82,379.20  | 0.03 |
| 149 | WINTHROP REALTY TRUST        | 温斯洛普房地产投资信托               | FUR US | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,122.00 | 65,399.41  | 0.02 |
| 150 | ONE LIBERTY PROPERTIES INC   | One Liberty Properties 公司 | OLP US | 纽约证券交易所 | 美国 | 400.00   | 63,261.65  | 0.02 |

注：本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

## 7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称（英文）                     | 证券代码     | 本期累计买入金额     | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|------------------------------|----------|--------------|----------------|
| 1  | SIMON PROPERTY GROUP INC     | SPG US   | 5,027,380.02 | 2.92           |
| 2  | PUBLIC STORAGE               | PSA US   | 3,019,846.08 | 1.75           |
| 3  | EQUINIX INC                  | EQIX US  | 2,210,752.41 | 1.28           |
| 4  | AVALONBAY COMMUNITIES INC    | AVB US   | 2,092,587.50 | 1.21           |
| 5  | WELLTOWER INC                | HCN US   | 2,062,978.23 | 1.20           |
| 6  | EQUITY RESIDENTIAL           | EQR US   | 2,026,845.88 | 1.18           |
| 7  | PROLOGIS INC                 | PLD US   | 2,024,451.92 | 1.18           |
| 8  | VENTAS INC                   | VTR US   | 1,858,028.29 | 1.08           |
| 9  | BOSTON PROPERTIES INC        | BXP US   | 1,629,563.77 | 0.95           |
| 10 | REALTY INCOME CORP           | O US     | 1,429,318.74 | 0.83           |
| 11 | DIGITAL REALTY TRUST INC     | DLR US   | 1,380,540.86 | 0.80           |
| 12 | VORNADO REALTY TRUST         | VNO US   | 1,339,794.12 | 0.78           |
| 13 | HCP INC                      | HCP US   | 1,310,325.73 | 0.76           |
| 14 | FOREST CITY REALTY TRUST- A  | FCE/A US | 1,298,336.55 | 0.75           |
| 15 | GENERAL GROWTH PROPERTIES    | GGP US   | 1,267,493.47 | 0.74           |
| 16 | ESSEX PROPERTY TRUST INC     | ESS US   | 1,155,183.40 | 0.67           |
| 17 | GAMING AND LEISURE PROPERTIE | GLPI US  | 1,131,171.47 | 0.66           |
| 18 | IRON MOUNTAIN INC            | IRM US   | 1,098,152.12 | 0.64           |
| 19 | EXTRA SPACE STORAGE INC      | EXR US   | 1,035,364.35 | 0.60           |
| 20 | HOST HOTELS & RESORTS INC    | HST US   | 1,015,344.94 | 0.59           |

注：本项及下项 7.5.2、7.5.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称（英文）                 | 证券代码   | 本期累计卖出金额     | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------------------------|--------|--------------|----------------|
| 1  | SIMON PROPERTY GROUP INC | SPG US | 1,492,487.41 | 0.87           |

|    |                           |        |              |      |
|----|---------------------------|--------|--------------|------|
| 2  | BIOMED REALTY TRUST INC   | BMR US | 1,086,704.36 | 0.63 |
| 3  | PUBLIC STORAGE            | PSA US | 958,946.11   | 0.56 |
| 4  | EQUITY RESIDENTIAL        | EQR US | 695,540.78   | 0.40 |
| 5  | AVALONBAY COMMUNITIES INC | AVB US | 567,646.49   | 0.33 |
| 6  | WELLTOWER INC             | HCN US | 536,971.92   | 0.31 |
| 7  | PROLOGIS INC              | PLD US | 510,205.28   | 0.30 |
| 8  | BOSTON PROPERTIES INC     | BXP US | 502,328.51   | 0.29 |
| 9  | VENTAS INC                | VTR US | 465,208.63   | 0.27 |
| 10 | VORNADO REALTY TRUST      | VNO US | 404,306.30   | 0.23 |
| 11 | GENERAL GROWTH PROPERTIES | GGP US | 391,896.57   | 0.23 |
| 12 | ESSEX PROPERTY TRUST INC  | ESS US | 356,659.82   | 0.21 |
| 13 | HCP INC                   | HCP US | 354,734.45   | 0.21 |
| 14 | REALTY INCOME CORP        | O US   | 353,076.09   | 0.20 |
| 15 | HOST HOTELS & RESORTS INC | HST US | 337,190.77   | 0.20 |
| 16 | KIMCO REALTY CORP         | KIM US | 294,411.20   | 0.17 |
| 17 | DIGITAL REALTY TRUST INC  | DLR US | 284,936.34   | 0.17 |
| 18 | MACERICH CO/THE           | MAC US | 273,389.65   | 0.16 |
| 19 | FEDERAL REALTY INVS TRUST | FRT US | 268,790.93   | 0.16 |
| 20 | EXTRA SPACE STORAGE INC   | EXR US | 248,803.15   | 0.14 |

### 7.5. 3权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

|            |               |
|------------|---------------|
| 买入成本（成交）总额 | 68,030,117.60 |
| 卖出收入（成交）总额 | 19,383,709.11 |

### 7.6 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。

### 7.7 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。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

### 7.9 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。



## 7.10 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 基金名称              | 基金类型 | 运作方式   | 管理人                | 公允价值          | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-------------------|------|--------|--------------------|---------------|---------------|
| 1  | VANGUARD REIT ETF | ETF  | 契约型开放式 | The Vanguard Group | 20,758,346.15 | 7.54          |
| -  | -                 | -    | -      | -                  | -             | -             |
| -  | -                 | -    | -      | -                  | -             | -             |
| -  | -                 | -    | -      | -                  | -             | -             |
| -  | -                 | -    | -      | -                  | -             | -             |
| -  | -                 | -    | -      | -                  | -             | -             |
| -  | -                 | -    | -      | -                  | -             | -             |
| -  | -                 | -    | -      | -                  | -             | -             |
| -  | -                 | -    | -      | -                  | -             | -             |
| -  | -                 | -    | -      | -                  | -             | -             |

## 7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 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。

## 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额           |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | -            |
| 2  | 应收证券清算款 | 86,780.86    |
| 3  | 应收股利    | 744,062.14   |
| 4  | 应收利息    | 3,294.11     |
| 5  | 应收申购款   | 2,296,005.26 |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | 96,431.71    |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 3,226,574.08 |

## 7.11.4 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。

## 7.11.5 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未存在流通受限情况。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的<br>基金份额 | 持有人结构     |            |                |            |
|----------|---------------|-----------|------------|----------------|------------|
|          |               | 机构投资者     |            | 个人投资者          |            |
|          |               | 持有份额      | 占总份额<br>比例 | 持有份额           | 占总份额<br>比例 |
| 26,268   | 7,893.17      | 49,456.47 | 0.02%      | 207,288,308.45 | 99.98%     |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 61,032.83 | 0.0294%  |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目                                 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和<br>研究部门负责人持有本开放式基金 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 0                 |

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                          |                |
|--------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2013年8月9日）基金份额总额 | 500,086,542.96 |
| 本报告期期初基金份额总额             | 129,276,291.73 |
| 本报告期基金总申购份额              | 156,170,745.16 |

|               |                |
|---------------|----------------|
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 78,109,271.97  |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -              |
| 本报告期期末基金份额总额  | 207,337,764.92 |

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

自 2016 年 4 月 30 日起，王志伟不再担任本基金管理人的董事长。自 2016 年 5 月 26 日起，孙树明担任本基金管理人的新任董事长。自 2016 年 5 月 5 日起，本基金管理人聘任魏恒江为公司的副总经理。相关事项已向中国证券投资基金业协会备案。 本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，涉及本基金管理人的诉讼事项有两起，分别是：

1、吴明芳诉平安银行股份有限公司义乌福田小微企业专营支行财产损害赔偿纠纷一案，我公司系本案第三人。原告认为银行未尽适当推介义务导致投资损失，请求银行赔偿损失。该案尚在浙江省义乌市人民法院审理中。

2、喇永强诉平安银行股份有限公司宁波慈溪支行和我公司合同纠纷一案，在浙江省慈溪市人民法院审理过程中，原告向法院申请撤回对我公司的起诉，经法院裁定准许后我公司不再参与该诉讼。本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2016 年 4 月 18 日，本基金管理人收到中国证监会关于责令整改的行政监管措施决定书（【2016】34 号）。中国证监会指出我司对火炬电子的跟踪研究报告未及时更新。我司高度重视该问题的整改，进一步梳理了股票入库的流程，并强化了研究报告的跟踪要求。

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称  | 交易单元数量 | 股票交易          |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|---|--------|---------------|--------------|-----------|------------|----|
|   |        | 成交金额          | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| Citigroup                                       | -      | 73,707,760.36 | 85.88%       | 24,956.14 | 58.89%     | -  |
| China International Capital Corporation Limited | -      | 35,677.57     | 0.04%        | 8,961.89  | 21.15%     | -  |
| Goldman Sachs Group Inc.                        | -      | 12,086,363.14 | 14.08%       | 8,459.87  | 19.96%     | -  |
| Morgan Stanley                                  | -      | -             | -            | -         | -          | -  |
| BOCI Securities Limited                         | -      | -             | -            | -         | -          | -  |
| Credit Suisse                                   | -      | -             | -            | -         | -          | -  |
| GF Holdings (Hong Kong) Corporation Limited     | -      | -             | -            | -         | -          | -  |

注：1、为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i. 财务状况良好，经营状况稳定，信誉良好，符合监管标准；
- ii. 研究实力较强，分析报告质量高，准确及时，同时报告覆盖范围广泛；
- iii. 交易执行能力强，交易效率高，能保证较佳成交价格，及时反馈交易结果；

iv. 清算和交割能力强，能确保流程顺畅以及结果准确；

v. 能与服务匹配的合理的佣金和收费标准；

vi. 经营行为规范，有健全的内部控制制度；

vii. 具备高效、安全的通讯条件。

2、券商专用交易单元选择程序：

i. 本基金管理人组织相关部门人员，根据经纪商选择原则与标准对交易单元候选经纪商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用的交易单元经纪商。

ii. 本基金管理人与选用的交易单元经纪商签署交易单元租用协议，并通知基金托管人。

iii. 本基金管理人定期对经纪商的服务进行评分，可根据结果调整交易分配比例以及更换经纪商。

3、此处股票交易含股票、存托凭证及信托凭证交易，佣金指基金通过单一券商进行股票、基金等交易而合计支付该券商的佣金合计。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称  | 债券交易 |              | 回购交易 |              | 权证交易 |              | 基金交易          |              |
|---|------|--------------|------|--------------|------|--------------|---------------|--------------|
|   | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 | 成交金额          | 占当期基金成交总额的比例 |
| Citigroup                                       | -    | -            | -    | -            | -    | -            | 357,249.24    | 1.46%        |
| China International Capital Corporation Limited | -    | -            | -    | -            | -    | -            | 24,173,531.02 | 98.54%       |

### 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                   | 法定披露方式                 | 法定披露日期     |
|----|--|------------------------|------------|
| 1  | 广发基金管理有限公司关于广发美国房地产指数证券投资基金暂停申购业务的公告   | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》 | 2016-06-29 |
| 2  | 广发基金管理有限公司关于增加天津银行为旗下部分基金代销机构的公告       | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》 | 2016-06-27 |
| 3  | 广发基金管理有限公司关于广发美国房地产指数证券投资基金暂停大额申购业务的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》 | 2016-06-23 |
| 4  | 广发基金管理有限公司关于增加苏宁基金为                    | 《中国证券报》、《证券时           | 2016-06-07 |

|    |  |                        |            |
|----|--|------------------------|------------|
|    | 旗下部分基金代销机构的公告                            | 报》、《上海证券报》             |            |
| 5  | 广发基金管理有限公司关于广发美国房地产指数证券投资基金暂停大额申购业务的公告   | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》 | 2016-06-06 |
| 6  | 广发基金管理有限公司关于增加德州银行为旗下部分基金代销机构的公告         | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》 | 2016-06-06 |
| 7  | 广发基金管理有限公司关于增加大智慧财富为旗下部分基金代销机构的公告        | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》 | 2016-05-20 |
| 8  | 广发基金管理有限公司关于增加徽商银行为旗下部分基金代销机构的公告         | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》 | 2016-05-17 |
| 9  | 广发基金管理有限公司关于增加汇成基金为旗下部分基金代销机构的公告         | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》 | 2016-05-13 |
| 10 | 广发基金管理有限公司关于增加首创证券为旗下部分基金代销机构的公告         | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》 | 2016-05-05 |
| 11 | 广发基金管理有限公司关于广发美国房地产指数证券投资基金恢复申购业务的公告     | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》 | 2016-03-30 |
| 12 | 广发基金管理有限公司关于增加鼎信汇金为旗下部分基金代销机构的公告         | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》 | 2016-03-30 |
| 13 | 广发基金管理有限公司关于广发美国房地产指数证券投资基金暂停申购业务的公告     | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》 | 2016-03-22 |
| 14 | 广发基金管理有限公司关于增加北京增财基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》 | 2016-02-18 |
| 15 | 广发基金管理有限公司关于广发美国房地产指数证券投资基金收益分配公告        | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》 | 2016-02-16 |
| 16 | 广发基金管理有限公司广发基金管理有限公司旗下 QDII 基金资产净值公告     | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》 | 2016-01-04 |
| 17 | 广发基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国农业银行实行申购费率优惠的公告     | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》 | 2016-01-04 |

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准广发美国房地产指数证券投资基金募集的文件；
2. 《广发美国房地产指数证券投资基金基金合同》；
3. 《广发美国房地产指数证券投资基金托管协议》；
4. 《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
5. 《广发美国房地产指数证券投资基金招募说明书》及其更新版；
6. 广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照；
7. 基金托管人业务资格批件、营业执照。

## 11.2 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

## 11.3 查阅方式

1. 书面查阅：查阅时间为每工作日 8:30-11:30，13:30-17:00。投资者可免费查阅，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  
二〇一六年八月二十六日