

**上投摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金（QDII）**  
**2021 年中期报告**  
**2021 年 6 月 30 日**

基金管理人：上投摩根基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十一日

## 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。本中期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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 30 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 2021 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         |
| <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                       | 7         |
| 2.5 信息披露方式                               | 7         |
| 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                               | 8         |
| <b>4 管理人报告</b>                           | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                         | 9         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明               | 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        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明        | 15        |
| <b>5 托管人报告</b>                           | <b>15</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明                   | 15        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明  | 15        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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>36</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                           | 36        |
| 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布               | 37        |
| 7.3 期末按行业分类的权益投资组合                       | 37        |
| 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        | 37        |
| 7.4.1 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      | 37        |
| 7.4.2 积极投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细 | 42        |
| 7.5 报告期内股票投资组合的重大变动                      | 42        |
| 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合                   | 44        |
| 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       | 44        |
| 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    | 44        |
| 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    | 44        |
| 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      | 44        |
| 7.11 本报告期投资基金情况                          | 45        |

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| 7.12 投资组合报告附注 .....                     | 45        |
| <b>8 基金份额持有人信息 .....</b>                | <b>46</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....             | 46        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....          | 46        |
| 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 ..... | 46        |
| <b>9 开放式基金份额变动 .....</b>                | <b>46</b> |
| <b>10 重大事件揭示 .....</b>                  | <b>46</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                  | 46        |
| 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 .....  | 46        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....       | 47        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                    | 47        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....             | 47        |
| 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 .....     | 47        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....            | 47        |
| 10.8 其他重大事件 .....                       | 49        |
| <b>11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>          | <b>50</b> |
| <b>12 备查文件目录 .....</b>                  | <b>50</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                       | 50        |
| 12.2 存放地点 .....                         | 50        |
| 12.3 查阅方式 .....                         | 50        |

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                                  |
|------------|----------------------------------|
| 基金名称       | 上投摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金（QDII） |
| 基金简称       | 上投摩根富时发达市场 REITs 指数（QDII）        |
| 基金主代码      | 005613                           |
| 交易代码       | 005613                           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                           |
| 基金合同生效日    | 2018 年 4 月 26 日                  |
| 基金管理人      | 上投摩根基金管理有限公司                     |
| 基金托管人      | 招商银行股份有限公司                       |
| 报告期末基金份额总额 | 401,822,904.66 份                 |
| 基金合同存续期    | 不定期                              |

### 2.2 基金产品说明

|      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 本基金采用被动式指数化投资策略，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力求实现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%。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 投资策略 | <p>本基金采用抽样复制策略进行被动式指数化投资，在富时发达市场 REITs 指数（英文为 FTSE EPRA/NAREIT Developed REITs Index）成分股、备选成分股中，优选流动性好、基本面稳健的 REITs 构建 REITs 组合，以较小的交易成本实现较低的跟踪误差。但因特殊情况导致基金无法有效跟踪标的指数时，本基金将运用其他方法建立实际组合，力求实现跟踪误差最小化。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>为了实现跟踪误差最小化，本基金将不低于 90%的非现金基金资产投资于富时发达市场 REITs 指数的成份股、备选成份股及以富时发达市场 REITs 指数为投资标的的指数基金（包括 ETF）。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>（1）投资组合构建</p> <p>本基金采用抽样复制指数的方法，综合考虑个股的市值规模、流动性、国别/行业代表性、价格波动率以及与标的指数相关度等因素，优选个股构建投资组合，力求在最小化跟踪误差的同时，将交易成本控制在合理的范围内。</p> <p>在初始建仓期或者为申购资金建仓时，本基金将依据市场流动性逐步买入投资组合并采取相应的交易策略降低建仓成本。在投资运作过程中，本基金将对标的指数成分的权重变化进行跟踪，并根据其权重的变动进行动态调整。</p> <p>（2）投资组合调整</p> <p>1) 定期调整</p> <p>本基金所构建的投资组合将定期根据所跟踪标的指数成份股的调整进行</p> |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>相应的跟踪调整。富时发达市场 REITs 指数的成份股每半年调整一次，指数调整方案公布后，本基金将及时对现有组合的构成进行相应的调整，若成份股的集中调整短期内会对跟踪误差产生较大影响，将采用逐步调整的方式。</p> <p>2) 不定期调整</p> <p>①根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时，本基金将根据标的指数权重比例的变化，进行相应调整。</p> <p>②当标的指数成份股因停牌、流动性不足等因素导致基金无法按照指数权重进行配置，基金管理人将综合考虑跟踪误差和投资者利益，选择相关 REITs 进行适当的替代。</p> <p>③本基金将根据申购和赎回情况对 REITs 组合进行调整，保证基金正常运行，从而有效跟踪标的指数。</p> <p>3) REITs 替代</p> <p>通常情况下，本基金根据标的指数成份股在指数中的权重确定成份 REITs 的买卖数量。但在如标的指数成份股流动性严重不足或停牌、标的指数成份股因法律法规的相关规定而为本基金限制投资的标的等特殊情况下，本基金可以选择其他 REITs 或 REITs 组合对标的指数中的成份股进行替换。在选择替代 REITs 时，为尽可能的降低跟踪误差，本基金将采用定性与定量相结合的方法，在对替代 REITs 与被替代 REITs 的基本面、股价技术面等指标进行相关性分析的基础上，优先从标的指数成份股及备选成份股中选择基本面良好，流动性充裕的 REITs 进行替代投资。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金将在控制市场风险与流动性风险的前提下，根据对财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪，结合不同债券品种的到期收益率、流动性、市场规模等情况，灵活运用久期策略、期限结构配置策略、信用债策略、可转债策略等多种投资策略，实施积极主动的组合管理，并根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预测，对债券组合进行动态调整。</p> <p>4、金融衍生品投资策略</p> <p>本基金可本着谨慎和风险可控的原则，适度投资于经中国证监会允许的各类金融衍生产品，如期货、期权、权证、远期合约、掉期以及其他衍生工具。本基金投资于金融衍生品主要是为了避险和增值、管理汇率风险，以便更好地实现基金的投资目标。本基金投资于各类金融衍生品的全部敞口不高于基金资产净值的 100%。</p> |
| 业绩比较基准 | 95%×富时发达市场 REITs 指数收益率+ 5%×税后银行活期存款收益率                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 风险收益特征 | 本基金为指数型基金，主要采用抽样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，风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |

## 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   |    | 上投摩根基金管理有限公司 | 招商银行股份有限公司 |
| 信息披露 | 姓名 | 邹树波          | 张燕         |

|        |      |                              |                        |
|--------|------|------------------------------|------------------------|
| 负责人    | 联系电话 | 021-38794888                 | 0755-83199084          |
|        | 电子邮箱 | services@cifm.com            | yan_zhang@cmbchina.com |
| 客户服务电话 |      | 400-889-4888                 | 95555                  |
| 传真     |      | 021-20628400                 | 0755-83195201          |
| 注册地址   |      | 中国（上海）自由贸易试验区富城路99号震旦国际大楼25楼 | 深圳市深南大道7088号招商银行大厦     |
| 办公地址   |      | 中国（上海）自由贸易试验区富城路99号震旦国际大楼25楼 | 深圳市深南大道7088号招商银行大厦     |
| 邮政编码   |      | 200120                       | 518040                 |
| 法定代表人  |      | 陈兵                           | 缪建民                    |

## 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 | -      | The Hong Kong and Shanghai Banking Corporation Limited |
|      | 中文 | -      | 香港上海汇丰银行有限公司                                           |
| 注册地址 |    | -      | 香港中环皇后大道中一号汇丰总行大厦                                      |
| 办公地址 |    | -      | 香港九龙深旺道一号，汇丰中心一座六楼                                     |
| 邮政编码 |    | -      | -                                                      |

注：本基金暂不设投资顾问。

## 2.5 信息披露方式

|                     |                                                       |
|---------------------|-------------------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《上海证券报》                                               |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.cifm.com">http://www.cifm.com</a> |
| 基金中期报告备置地点          | 基金管理人及基金托管人住所                                         |

## 2.6 其他相关资料

| 项目     | 名称           | 办公地址                             |
|--------|--------------|----------------------------------|
| 注册登记机构 | 上投摩根基金管理有限公司 | 中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号震旦国际大楼 25 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（2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日） |
|---------------|--------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 7,274,458.58                         |
| 本期利润          | 54,359,167.71                        |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.1665                               |
| 本期加权平均净值利润率   | 14.41%                               |
| 本期基金份额净值增长率   | 15.98%                               |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2021 年 6 月 30 日)                |
| 期末可供分配利润      | 18,346,574.14                        |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0457                               |
| 期末基金资产净值      | 496,706,408.32                       |
| 期末基金份额净值      | 1.2361                               |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2021 年 6 月 30 日)                |
| 基金份额累计净值增长率   | 23.61%                               |

注：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。

上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

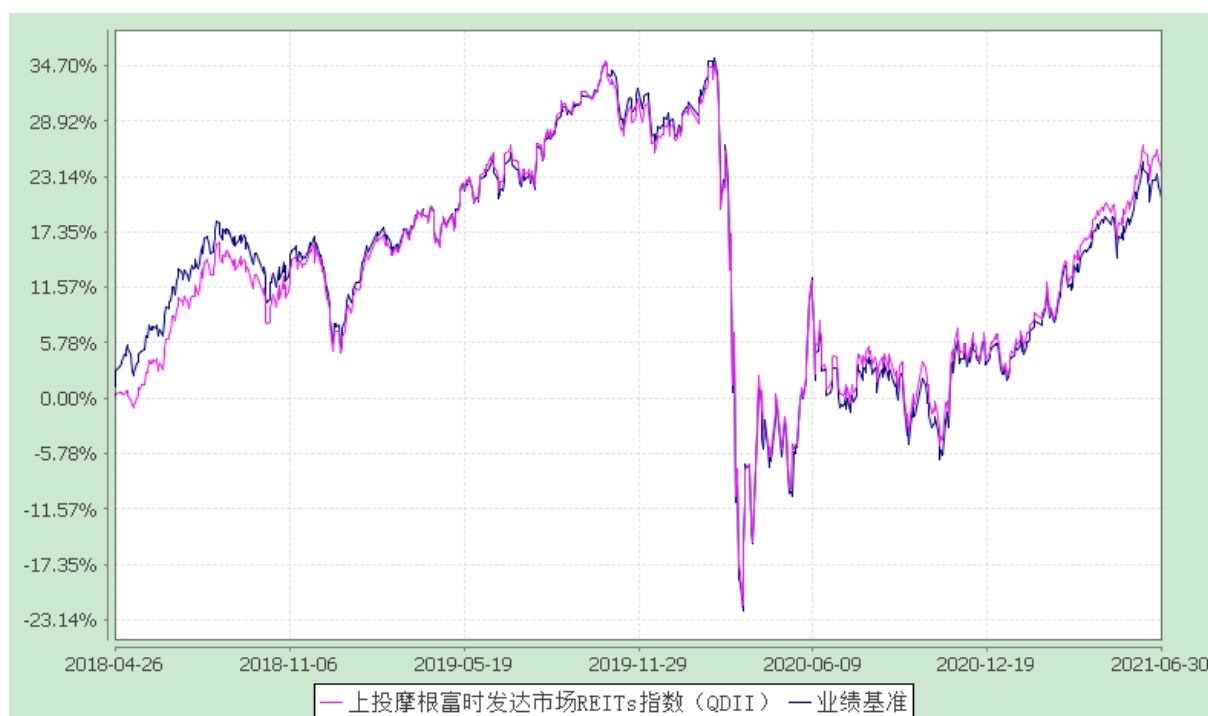
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③   | ②—④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去一个月      | 2.69%    | 0.79%       | 1.98%      | 0.82%         | 0.71% | -0.03% |
| 过去三个月      | 8.01%    | 0.71%       | 6.84%      | 0.72%         | 1.17% | -0.01% |
| 过去六个月      | 15.98%   | 0.77%       | 14.34%     | 0.77%         | 1.64% | 0.00%  |
| 过去一年       | 21.07%   | 1.04%       | 19.49%     | 1.02%         | 1.58% | 0.02%  |
| 过去三年       | 13.86%   | 1.51%       | 8.29%      | 1.49%         | 5.57% | 0.02%  |
| 自基金合同生效起至今 | 23.61%   | 1.47%       | 20.90%     | 1.46%         | 2.71% | 0.01%  |

注：本基金的业绩比较基准为：95%×富时发达市场 REITs 指数收益率+ 5%×税后银行活期存款收益率。

### 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

上投摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金（QDII）  
 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

(2018 年 4 月 26 日至 2021 年 6 月 30 日)



注：本基金合同生效日为 2018 年 4 月 26 日，图示的时间段为合同生效日至本报告期末。

本基金建仓期为本基金合同生效日起 6 个月，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

## 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

上投摩根基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于 2004 年 5 月 12 日正式成立。公司由上海国际信托投资有限公司（2007 年 10 月 8 日更名为“上海国际信托有限公司”）与摩根资产管理（英国）有限公司合资设立，注册资本为 2.5 亿元人民币，注册地上海。截至 2021 年 6 月底，公司旗下运作的基金共有七十六只，均为开放式基金，分别是：上投摩根中国优势证券投资基金、上投摩根货币市场基金、上投摩根阿尔法混合型证券投资基金、上投摩根双息平衡混合型证券投资基金、上投摩根成长先锋混合型证券投资基金、上投摩根内需动力混合型证券投资基金、上投摩根亚太优势混合型证券投资基金、上投摩根双核平衡混合型证券投资基金、上投摩根中小盘混合型证券投资基金、上投摩根纯债债券型证券投资基金、上投摩根行业轮动混合型证券投资基金、上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金、上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金、上投摩根新兴动力

混合型证券投资基金、上投摩根强化回报债券型证券投资基金、上投摩根健康品质生活混合型证券投资基金、上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金、上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金、上投摩根核心优选混合型证券投资基金、上投摩根智选 30 混合型证券投资基金、上投摩根成长动力混合型证券投资基金、上投摩根红利回报混合型证券投资基金、上投摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根双债增利债券型证券投资基金、上投摩根核心成长股票型证券投资基金、上投摩根民生需求股票型证券投资基金、上投摩根纯债丰利债券型证券投资基金、上投摩根天添盈货币市场基金、上投摩根天添宝货币市场基金、上投摩根稳进回报混合型证券投资基金、上投摩根安全战略股票型证券投资基金、上投摩根卓越制造股票型证券投资基金、上投摩根整合驱动灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根动态多因子策略灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根智慧互联股票型证券投资基金、上投摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根新兴服务股票型证券投资基金、上投摩根医疗健康股票型证券投资基金、上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根中国生物医药混合型证券投资基金（QDII）、上投摩根策略精选灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根安鑫回报混合型证券投资基金、上投摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金（QDII）、上投摩根全球多元配置证券投资基金（QDII）、上投摩根安丰回报混合型证券投资基金、上投摩根安通回报混合型证券投资基金、上投摩根优选多因子股票型证券投资基金、上投摩根丰瑞债券型证券投资基金、上投摩根标普港股通低波红利指数型证券投资基金、上投摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根安隆回报混合型证券投资基金、上投摩根创新商业模式灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金（QDII）、上投摩根香港精选港股通混合型证券投资基金、上投摩根尚睿混合型基金中基金（FOF）、上投摩根安裕回报混合型证券投资基金、上投摩根欧洲动力策略股票型证券投资基金（QDII）、上投摩根核心精选股票型证券投资基金、上投摩根动力精选混合型证券投资基金、上投摩根领先优选混合型证券投资基金、上投摩根日本精选股票型证券投资基金（QDII）、上投摩根锦程均衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、上投摩根瑞益纯债债券型证券投资基金、上投摩根慧选成长股票型证券投资基金、上投摩根瑞泰 38 个月定期开放债券型证券投资基金、上投摩根锦程稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、上投摩根锦程积极成长养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、上投摩根研究驱动股票型证券投资基金、上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上投摩根瑞盛 87 个月定期开放债券型证券投资基金、上投摩根慧见两年持有期混合型证券投资基金、上投摩根远见两年持有期混合型证券投资基金、上投摩根安享回报一年持有期债券型证券投资基金、上投摩根优势成长混合型证券投资基金、上投摩根行业睿选股票型证券投资基金。

## 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（助理）期限 |            | 证券从业年限              | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|-----|--------------|-----------------|------------|---------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |              | 任职日期            | 离任日期       |                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 张军  | 本基金基金经理、投资董事 | 2021-01-07      | -          | 17 年（金融领域从业经验 28 年） | 基金经理张军先生，毕业于上海复旦大学。曾担任上海国际信托有限公司国际业务部经理，交易部经理。2004 年 6 月加入上投摩根基金管理有限公司，先后担任交易部总监、投资经理、基金经理、投资组合管理部总监、投资绩效评估总监、国际投资部总监、组合基金投资部总监，现担任投资董事兼高级基金经理。自 2008 年 3 月起担任上投摩根亚太优势混合型证券投资基金基金经理，自 2012 年 3 月起同时担任上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金基金经理，自 2016 年 12 月起同时担任上投摩根全球多元配置证券投资基金基金经理，自 2018 年 10 月起同时担任上投摩根欧洲动力策略股票型证券投资基金（QDII）基金经理，自 2019 年 7 月起同时担任上投摩根日本精选股票型证券投资基金（QDII）基金经理，自 2021 年 1 月起同时担任上投摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金（QDII）基金经理，自 2021 年 6 月起同时担任上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金及上投摩根标普港股通低波红利指数型证券投资基金基金经理。 |
| 施斌文 | 本基金基金经       | 2018-04-26      | 2021-01-07 | 9 年                 | 基金经理施斌文先生，北                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |

|  |   |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|--|---|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | 理 |  |  |  | <p>京大学经济学硕士，2012 年 7 月起加入上投摩根基金管理有限公司，先后担任助理研究员、研究员/基金经理助理、基金经理，主要承担量化支持方面的工作。2017 年 1 月至 2019 年 9 月担任上投摩根安丰回报混合型证券投资基金基金经理，2017 年 1 月至 2018 年 10 月同时担任上投摩根安泽回报混合型证券投资基金基金经理，2017 年 12 月至 2021 年 1 月担任上投摩根标普港股通低波红利指数型证券投资基金基金经理，2018 年 2 月至 2019 年 4 月同时担任上投摩根安隆回报混合型证券投资基金基金经理，2018 年 2 月至 7 月同时担任上投摩根安腾回报混合型证券投资基金基金经理，2018 年 4 月至 2021 年 1 月同时担任上投摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金（QDII）基金经理，2018 年 9 月至 2020 年 5 月同时担任上投摩根安裕回报混合型证券投资基金基金经理，2019 年 4 月至 2020 年 5 月同时担任上投摩根安通回报混合型证券投资基金基金经理，2019 年 12 月至 2021 年 1 月同时担任上投摩根动态多因子策略灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根优选多因子股票型证券投资基金及上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金基金经理；2020 年 5 月至 2021 年 1 月</p> |
|--|---|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |  |  |  |                                                                                                          |
|--|--|--|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 同时担任上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2020 年 7 月至 2021 年 1 月同时担任上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|

注：1. 任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2. 施毓文先生为本基金首任基金经理，其任职日期指本基金基金合同生效之日。

3. 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

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。本基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金（QDII）基金合同》的规定。除以下情况外，基金经理对个股和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制，基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求：本基金曾出现个别由于市场原因引起的投资组合的投资指标被动偏离相关比例要求的情形，但已在规定时间内调整完毕。

#### 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

报告期内，本公司继续贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规和公司内部公平交易流程的各项要求，严格规范境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活动，通过系统和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析，以确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的环节均得到公平对待。

对于交易所市场投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量；对于银行间市场投资活动，本公司通过对手库控制和交易室询价机制，严格防范对手风险并检查价格公允性；对于申购投资行为，本公司遵循价格优先、比例分配的原则，根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差监控分析，未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,通过对交易价格、交易时间、交易方向等的抽样分析,未发现存在异常交易行为。

所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形:无。

## 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

2021 年一季度,本基金净值整体震荡上行。REITs 指数一季度表现优良主要得益于疫苗的广泛分发、美国新增确诊病例的下降、以及经济的持续复苏。

REITs 市场在二季度整体表现出色。其中,数据中心、基础设施、物流仓储等 2020 年表现强劲的板块继续表现出色;零售、住宅、办公楼等在 2020 年受到疫情较大冲击的板块在二季度延续了今年一季度以来的强劲反弹势头;酒店板块在一季度的快速反弹之后,在二季度有所放缓。REITs 市场的良好表现主要得益于疫苗的广泛接种和经济的持续复苏。报告期内,本基金继续采用抽样复制的方法跟踪标的指数,跟踪误差保持在合理范围内。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期上投摩根富时发达市场 REITs 指数 (QDII) 份额净值增长率为:15.98%,同期业绩比较基准收益率为:14.34%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市,我们继续对 REITs 资产的表现持乐观态度。首先,包括美国在内的全球经济将继续强劲复苏。海外主流媒体的调研研究显示,2021 年美国实际 GDP 增速将达到 6.4%,创下 1984 年以来的最高增速。经济的持续复苏推动了对各类型物业需求的复苏,从而带动 REITs 资产价格上行。第二,REITs 资产中不同板块的复苏和发展是不均衡的,包括办公楼、酒店、零售等在内的商业物业板块的复苏依然滞后于经济复苏,这也意味着这些板块未来仍有较大的上行空间。而以数据中心、信号塔、物流等为代表的新经济板块,预计在未来将继续表现出色并持续扩大在整个 REITs 市场中的占比。第三,伴随经济强劲复苏的是持续走高的通胀率,而历史数据显示 REITs 资产具有较好的抗通胀属性,在高通胀的环境下有相对别的资产更好的表现。其主要原因是物业租金往往会随着通胀走高而走高。第四,在疫情爆发前,大多数 REITs 的经营状况和财务状况都处在一个非常健康的水平,虽然疫情对很多 REITs 的经营性现金流产生了负面冲击,但宽松的货币和信用环境使得它们可以度过危机、迎来复苏。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司的基金估值和会计核算由基金会计部负责，根据相关的法律法规规定、基金合同的约定，制定了内部控制措施，对基金估值和会计核算的各个环节和整个流程进行风险控制，目的是保证基金估值和会计核算的准确性。基金会计部人员均具备基金从业资格和相关工作经历。本公司成立了估值委员会，并制订有关议事规则。估值委员会成员包括公司管理层、督察长、基金会计、风险管理等方面的负责人以及相关基金经理，所有相关成员均具有丰富的证券投资基金行业从业经验。公司估值委员会对估值事项发表意见，评估基金估值的公允性和合理性。基金经理是估值委员会的重要成员，参加估值委员会会议，参与估值程序和估值技术的讨论。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

本报告期内上投摩根富时发达市场 REITs 指数基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## 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：上投摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金 (QDII)

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            | -                              | -                                |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 55,109,848.73                  | 27,248,230.53                    |
| 结算备付金           |            | -                              | -                                |
| 存出保证金           |            | -                              | -                                |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 458,041,338.85                 | 269,780,600.37                   |
| 其中：股票投资         |            | 458,041,338.85                 | 269,780,600.37                   |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 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         |            | -                              | -                                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 2,619.89                       | 1,706.70                         |
| 应收股利            |            | 1,504,602.25                   | 1,240,655.21                     |
| 应收申购款           |            | 4,313,749.47                   | 5,163,336.80                     |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| <b>资产总计</b>     |            | <b>518,972,159.19</b>          | <b>303,434,529.61</b>            |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2020 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            | -                              | -                                |
| 短期借款            |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债          |            | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                              | -                                |
| 应付证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应付赎回款           |            | 21,679,551.01                  | 6,381,611.68                     |

|                   |          |                       |                       |
|-------------------|----------|-----------------------|-----------------------|
| 应付管理人报酬           |          | 321,400.57            | 195,764.13            |
| 应付托管费             |          | 100,437.67            | 61,176.28             |
| 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              |          | -                     | -                     |
| 递延所得税负债           |          | -                     | -                     |
| 其他负债              | 6.4.7.8  | 164,361.62            | 231,342.10            |
| <b>负债合计</b>       |          | <b>22,265,750.87</b>  | <b>6,869,894.19</b>   |
| <b>所有者权益：</b>     |          | <b>-</b>              | <b>-</b>              |
| 实收基金              | 6.4.7.9  | 401,822,904.66        | 278,246,432.22        |
| 未分配利润             | 6.4.7.10 | 94,883,503.66         | 18,318,203.20         |
| <b>所有者权益合计</b>    |          | <b>496,706,408.32</b> | <b>296,564,635.42</b> |
| <b>负债和所有者权益总计</b> |          | <b>518,972,159.19</b> | <b>303,434,529.61</b> |

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日,基金份额净值 1.2361 元,基金份额总额 401,822,904.66 份。

## 6.2 利润表

会计主体：上投摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金 (QDII)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                    | 附注号      | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至<br>2020 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|----------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>           |          | <b>56,923,409.43</b>                     | <b>-52,732,608.61</b>                         |
| 1.利息收入                |          | 35,535.35                                | 39,934.23                                     |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11 | 35,535.35                                | 39,934.23                                     |
| 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            |          | -                                        | -                                             |
| 证券出借利息收入              |          | -                                        | -                                             |
| 其他利息收入                |          | -                                        | -                                             |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |          | 9,843,138.36                             | -15,501,695.54                                |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12 | 4,414,171.89                             | -19,811,475.02                                |
| 基金投资收益                | 6.4.7.13 | -                                        | -                                             |
| 债券投资收益                | 6.4.7.14 | -                                        | -                                             |
| 资产支持证券投资收益            | 6.4.7.15 | -                                        | -                                             |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.16 | -                                        | -                                             |
| 股利收益                  | 6.4.7.17 | 5,428,966.47                             | 4,309,779.48                                  |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | 47,084,709.13                            | -37,732,530.79                                |

|                             |          |                      |                       |
|-----------------------------|----------|----------------------|-----------------------|
| 4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)         |          | -401,539.67          | -112,525.18           |
| 5. 其他收入 (损失以“-”号填列)         | 6.4.7.19 | 361,566.26           | 574,208.67            |
| <b>减: 二、费用</b>              |          | <b>2,564,241.72</b>  | <b>1,700,969.64</b>   |
| 1. 管理人报酬                    |          | 1,490,653.48         | 1,004,584.31          |
| 2. 托管费                      |          | 465,829.15           | 313,932.54            |
| 3. 销售服务费                    |          | -                    | -                     |
| 4. 交易费用                     | 6.4.7.20 | 196,977.34           | 183,260.44            |
| 5. 利息支出                     |          | -                    | -                     |
| 其中: 卖出回购金融资产支出              |          | -                    | -                     |
| 6. 税金及附加                    |          | -                    | -                     |
| 7. 其他费用                     | 6.4.7.21 | 410,781.75           | 199,192.35            |
| <b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b> |          | <b>54,359,167.71</b> | <b>-54,433,578.25</b> |
| 减: 所得税费用                    |          | -                    | -                     |
| <b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>   |          | <b>54,359,167.71</b> | <b>-54,433,578.25</b> |

### 6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 上投摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金 (QDII)

本报告期: 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

| 项目                                      | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 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)                        | 278,246,432.22                             | 18,318,203.20  | 296,564,635.42  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)               | -                                          | 54,359,167.71  | 54,359,167.71   |
| 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)      | 123,576,472.44                             | 22,206,132.75  | 145,782,605.19  |
| 其中: 1. 基金申购款                            | 258,584,690.44                             | 42,851,974.44  | 301,436,664.88  |
| 2. 基金赎回款                                | -135,008,218.00                            | -20,645,841.69 | -155,654,059.69 |
| 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)                        | 401,822,904.66                             | 94,883,503.66  | 496,706,408.32  |
| 项目                                      | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 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)                        | 221,826,187.17                             | 64,156,688.89  | 285,982,876.06  |

|                                        |                 |                |                 |
|----------------------------------------|-----------------|----------------|-----------------|
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -               | -54,433,578.25 | -54,433,578.25  |
| 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）      | 70,855,274.35   | -3,577,043.48  | 67,278,230.87   |
| 其中：1.基金申购款                             | 226,991,452.17  | 6,496,653.93   | 233,488,106.10  |
| 2.基金赎回款                                | -156,136,177.82 | -10,073,697.41 | -166,209,875.23 |
| 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）                        | 292,681,461.52  | 6,146,067.16   | 298,827,528.68  |

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：王大智，主管会计工作负责人：杨怡，会计机构负责人：张璐

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

上投摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金(QDII)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]第 64 号《关于准予上投摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金(QDII)注册的批复》核准，由上投摩根基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金(QDII)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 110,593,367.08 元和美元 16,978,012.59 元，美元按照募集期最后一日(2018 年 4 月 20 日)中国人民银行最新公布的人民币对美元汇率中间价折算后募集资本合计为人民币 217,379,976.49 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第 0269 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上投摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金(QDII)基金合同》于 2018 年 4 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 217,433,561.84 份基金份额，其中认购资金利息折合 53,585.35 份基金份额。本基金的基金管理人为上投摩根基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司，境外资产托管人为香港上海汇丰银行有限公司。

根据《上投摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金(QDII)基金合同》和《上投摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金(QDII)招募说明书》的有关规定，本基金根据认购/申购、赎回使用货币的不同，将基金份额分为不同的类别。以人民币计价并进行认购/申购、赎回的份额类别称

为人民币份额；以美元计价并进行认购/申购、赎回的份额类别称为美元份额，美元份额又分为美元现钞份额和美元现汇份额。人民币份额、美元现钞份额和美元现汇份额分别设置代码，分别公布基金份额净值，不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金(QDII)基金合同》的有关规定，本基金的境外投资范围为富时发达市场 REITs 指数(FTSE EPRA/NAREIT Developed REITs Index)成分券、备选成分券及以富时发达市场 REITs 指数为投资标的的指数基金(包括 ETF)等，以及银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；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；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。本基金的境内投资范围为具有良好流动性的金融工具，具体包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、证券公司短期公司债、地方政府债、次级债、短期融资券、中期票据、中小企业私募债、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款等，及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为：投资于 REITs 的资产不低于基金资产的 90%，投资于富时发达市场 REITs 指数成分券、备选成分券及以富时发达市场 REITs 指数为投资标的的指数基金(包括 ETF)的投资比例不低于非现金基金资产的 90%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{富时发达市场 REITs 指数收益率} + 5\% \times \text{税后银行活期存款收益率}$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人上投摩根基金管理有限公司于 2021 年 8 月 30 日批准报出。

#### 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于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国

基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上投摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金(QDII)基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报告相一致。

#### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《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》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 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>2021 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 55,109,848.73          |
| 定期存款 | -                      |
| 其他存款 | -                      |
| 合计   | 55,109,848.73          |

注：于 2021 年 06 月 30 日，银行存款中包含的外币余额为：美元 4,058,744.82 元(折合人民币 26,219,897.41 元)。

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目     |       | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |                |               |
|--------|-------|------------------------|----------------|---------------|
|        |       | 成本                     | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票     |       | 412,629,139.95         | 458,041,338.85 | 45,412,198.90 |
| 债券     | 交易所市场 | -                      | -              | -             |
|        | 银行间市场 | -                      | -              | -             |
|        | 合计    | -                      | -              | -             |
| 资产支持证券 |       | -                      | -              | -             |
| 基金     |       | -                      | -              | -             |
| 其他     |       | -                      | -              | -             |
| 合计     |       | 412,629,139.95         | 458,041,338.85 | 45,412,198.90 |

注：股票投资为富时发达市场 REITs 指数(FTSE EPRA/NAREIT Developed REITs Index)成分券及备选成分券等。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 2,619.89               |
| 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     | -                      |
| 应收资产支持证券利息 | -                      |
| 应收买入返售证券利息 | -                      |
| 应收申购款利息    | -                      |
| 应收出借证券利息   | -                      |
| 其他         | -                      |
| 合计         | 2,619.89               |

#### 6.4.7.6 其他资产

无余额。

**6.4.7.7 应付交易费用**

无余额。

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 28,094.82              |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 预提费用        | 92,235.79              |
| 其他          | 44,031.01              |
| 合计          | 164,361.62             |

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |                 |
|---------------|---------------------------------------|-----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额            |
| 上年度末          | 278,246,432.22                        | 278,246,432.22  |
| 本期申购          | 258,584,690.44                        | 258,584,690.44  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -135,008,218.00                       | -135,008,218.00 |
| 本期末           | 401,822,904.66                        | 401,822,904.66  |

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

**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           | 6,945,017.70  | 11,373,185.50  | 18,318,203.20  |
| 本期利润           | 7,274,458.58  | 47,084,709.13  | 54,359,167.71  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 4,127,097.86  | 18,079,034.89  | 22,206,132.75  |
| 其中：基金申购款       | 8,572,288.34  | 34,279,686.10  | 42,851,974.44  |
| 基金赎回款          | -4,445,190.48 | -16,200,651.21 | -20,645,841.69 |
| 本期已分配利润        | -             | -              | -              |
| 本期末            | 18,346,574.14 | 76,536,929.52  | 94,883,503.66  |

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 35,535.35                             |
| 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        | 35,535.35                             |

**6.4.7.12 股票投资收益**

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 53,641,537.99                         |
| 减：卖出股票成本总额 | 49,227,366.10                         |
| 买卖股票差价收入   | 4,414,171.89                          |

**6.4.7.13 基金投资收益**

无。

**6.4.7.14 债券投资收益**

无。

**6.4.7.15 资产支持证券投资收益**

无。

**6.4.7.16 衍生工具收益**

无。

**6.4.7.17 股利收益**

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 5,428,966.47               |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | -                          |
| 基金投资产生的股利收益   | -                          |

|    |              |
|----|--------------|
| 合计 | 5,428,966.47 |
|----|--------------|

**6.4.7.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|----------------------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产                  | 47,084,709.13              |
| ——股票投资                     | 47,084,709.13              |
| ——债券投资                     | -                          |
| ——资产支持证券投资                 | -                          |
| ——基金投资                     | -                          |
| ——其他                       | -                          |
| 2.衍生工具                     | -                          |
| ——权证投资                     | -                          |
| 3.其他                       | -                          |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的<br>预估增值税 | -                          |
| 合计                         | 47,084,709.13              |

**6.4.7.19 其他收入**

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 361,566.26                 |
| 印花税返还   | -                          |
| 其他      | -                          |
| 配股手续费   | -                          |
| 新股手续费返还 | -                          |
| 转换费收入   | -                          |
| 合计      | 361,566.26                 |

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

**6.4.7.20 交易费用**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 196,977.34                            |
| 银行间市场交易费用 | -                                     |
| 合计        | 196,977.34                            |

**6.4.7.21 其他费用**

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用    | 32,728.42                  |
| 信息披露费   | 59,507.37                  |
| 证券出借违约金 | -                          |
| 银行费用    | 58,696.86                  |
| 指数使用费   | 74,532.64                  |
| 其他      | 185,316.46                 |
| 合计      | 410,781.75                 |

**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，本基金并无须作披露的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至财务报表报出日，本基金并无须作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             |
|-----------------------|---------------------|
| 上投摩根基金管理有限公司          | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 招商银行股份有限公司("招商银行")    | 基金托管人、基金代销机构        |
| 香港上海汇丰银行有限公司 ("汇丰银行") | 境外资产托管人             |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**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**

无。

**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 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

|                 | 2021年1月1日至2021年6月<br>30日 | 2020年1月1日至2020年6<br>月30日 |
|-----------------|--------------------------|--------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 1,490,653.48             | 1,004,584.31             |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 373,418.48               | 214,815.00               |

注：支付基金管理人上投摩根基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.8% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.8% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6<br>月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 465,829.15                     | 313,932.54                          |

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

#### 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

无。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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

无。

#### 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>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |           | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 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    |
| 汇丰银行  | 2,919,762.42                          | 60.24     | 11,537,532.63                              | 4,169.76  |
| 招商银行  | 52,190,086.31                         | 35,475.11 | 16,176,232.22                              | 35,764.47 |

注：本基金的银行存款分别由基金托管人招商银行和境外资产托管人汇丰银行保管，按适用利率计息。

#### 6.4.10.6 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.6.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.10.6.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本报告期本基金未实施利润分配。

#### 6.4.12 期末（2021 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

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 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

无。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，主要采用抽样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，风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争控制本基金的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%，年跟踪误差不超过 5%，以实现富时发达市场 REITs 指数的有效跟踪。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会主要负责基金管理人风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。董事会下设督察长，负责对基金管理人各业务环节合法合规运作的监督检查和基金管理人内部稽核监控工作，并可向基金管理人董事会和中国证监会直接报

告。经营管理层下设风险评估联席会议，进行各部门管理程序的风险确认，并对各类风险予以事先充分的评估和防范，并进行及时控制和采取应急措施；在业务操作层面监察稽核部负责基金管理人各部门的风险控制检查，定期或不定期对业务部门内部控制制度执行情况和遵循国家法律，法规及其他规定的执行情况进行检查，并适时提出修改建议；风险管理部负责投资限制指标体系的设定和更新，对于违反指标体系的投资进行监查和风险评估，并负责协助各部门修正、修订内部控制作业制度，并对各部门的日常作业，依据风险管理的考评，定期或不定期对各项风险指标进行管控，并提出内控建议。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行招商银行以及境外次托管行香港上海汇丰银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持债券投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### **6.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，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**

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款等。

## 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金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>2021 年 6 月 30 日   |               |                       |                |                |
|-------------------|--------------------------|---------------|-----------------------|----------------|----------------|
|                   | 美元<br>折合人民币              | 港币<br>折合人民币   | (其他主要<br>币种)<br>折合人民币 | 其他币种<br>折合人民币  | 合计             |
| 以外币计价的资产          |                          |               |                       |                |                |
| 银行存款              | 26,219,897.41            | -             | -                     | -              | 26,219,897.41  |
| 交易性金融资产           | 344,363,904.15           | 10,450,279.94 | -                     | 103,227,154.76 | 458,041,338.85 |
| 应收股利              | 943,041.97               | 206,005.92    | -                     | 355,554.36     | 1,504,602.25   |
| 应收申购款             | 586,448.39               | -             | -                     | -              | 586,448.39     |
| 应收利息              | 39.08                    | -             | -                     | -              | 39.08          |
| 资产合计              | 372,113,331.00           | 10,656,285.86 | -                     | 103,582,709.12 | 486,352,325.98 |
| 以外币计价的负债          |                          |               |                       |                |                |
| 应付赎回款             | 5,028,633.19             | -             | -                     | -              | 5,028,633.19   |
| 其他负债              | 8,670.23                 | -             | -                     | -              | 8,670.23       |
| 负债合计              | 5,037,303.42             | -             | -                     | -              | 5,037,303.42   |
| 资产负债表<br>外汇风险敞口净额 | 367,076,027.58           | 10,656,285.86 | -                     | 103,582,709.12 | 481,315,022.56 |
| 项目                | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |               |                       |                |                |

|                   | 美元<br>折合人民币    | 港币<br>折合人民币  | (其他主要<br>币种)<br>折合人民币 | 其他币种<br>折合人民币 | 合计             |
|-------------------|----------------|--------------|-----------------------|---------------|----------------|
| 以外币计价的资产          |                |              |                       |               |                |
| 银行存款              | 12,934,937.81  | -            | -                     | -             | 12,934,937.81  |
| 交易性金融资产           | 199,987,499.15 | 6,452,988.54 | -                     | 63,340,112.68 | 269,780,600.37 |
| 应收股利              | 966,673.07     | -            | -                     | 273,982.14    | 1,240,655.21   |
| 应收申购款             | 275,803.61     | -            | -                     | -             | 275,803.61     |
| 应收利息              | 6.53           | -            | -                     | -             | 6.53           |
| 资产合计              | 214,164,920.17 | 6,452,988.54 | -                     | 63,614,094.82 | 284,232,003.53 |
| 以外币计价的负债          |                |              |                       |               |                |
| 应付证券清算款           | -              | -            | -                     | -             | -              |
| 应付赎回款             | 567,285.57     | -            | -                     | -             | 567,285.57     |
| 其他负债              | 698.10         | -            | -                     | -             | 698.10         |
| 负债合计              | 567,983.67     | -            | -                     | -             | 567,983.67     |
| 资产负债表<br>外汇风险敞口净额 | 213,596,936.50 | 6,452,988.54 | -                     | 63,614,094.82 | 283,664,019.86 |

## 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设 | 除汇率以外的其他市场变量保持不变 |                                    |                  |
|----|------------------|------------------------------------|------------------|
| 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<br>影响金额 (单位: 人民币万元) |                  |
|    |                  | 本期末                                | 上年度末             |
|    |                  | 2021 年 6 月 30 日                    | 2020 年 12 月 31 日 |
|    | 所有外币相对人民币升值 5%   | 增加约 2,407                          | 增加约 1,418        |
|    | 所有外币相对人民币贬值 5%   | 减少约 2,407                          | 减少约 1,418        |

## 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用抽样复制策略，在指数成分股、备选成分股中，优选流动性好、基本面稳健的 REITs 构建 REITs 组合，以较小的交易成本实现较低的跟踪误差。但因特殊情况导致基金无法有效跟踪标的指数时，本基金将运用其他方法建立实际组合，力求实现跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于 REITs 的资产不低于基金资产的 90%，投资于富时发达市场 REITs 指数成分券、备选成分券及以富时发达市场 REITs 指数为投资标的的指数基金(包括 ETF)的投资比例不低于非现金基金资产的 90%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 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>2021 年 6 月 30 日 |                      | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |                      |
|--------------|------------------------|----------------------|--------------------------|----------------------|
|              | 公允价值                   | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 458,041,338.85         | 92.22                | 269,780,600.37           | 90.97                |
| 交易性金融资产—基金投资 | -                      | -                    | -                        | -                    |
| 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           | 458,041,338.85         | 92.22                | 269,780,600.37           | 90.97                |

## 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<br>影响金额 (单位: 人民币万元) |                          |
|----|-------------------------|------------------------------------|--------------------------|
|    |                         | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日             | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|    | 业绩比较基准 (附注 6.4.1) 上升 5% | 增加约 2,279                          | 增加约 1,527                |
|    | 业绩比较基准 (附注 6.4.1) 下降 5% | 减少约 2,279                          | 减少约 1,527                |

## 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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               | 458,041,338.85 | 88.26         |
|    | 其中: 普通股            | -              | -             |
|    | 存托凭证               | -              | -             |
|    | 优先股                | -              | -             |
|    | 房地产信托凭证            | 458,041,338.85 | 88.26         |
| 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       | 55,109,848.73  | 10.62         |
| 8  | 其他各项资产             | 5,820,971.61   | 1.12          |

|   |    |                |        |
|---|----|----------------|--------|
| 9 | 合计 | 518,972,159.19 | 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     | 344,363,904.15 | 69.33        |
| 日本     | 27,051,644.00  | 5.45         |
| 英国     | 24,549,450.43  | 4.94         |
| 澳大利亚   | 22,497,332.58  | 4.53         |
| 中国香港   | 10,450,279.94  | 2.10         |
| 新加坡    | 9,448,436.62   | 1.90         |
| 法国     | 8,725,604.22   | 1.76         |
| 荷兰     | 6,095,997.01   | 1.23         |
| 比利时    | 4,858,689.90   | 0.98         |
| 合计     | 458,041,338.85 | 92.22        |

注：国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定，ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

### 7.3.1 期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

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（%） |
|------------------|----------------|--------------|
| 股权房地产投资信托（REITs） | 458,041,338.85 | 92.22        |
| 合计               | 458,041,338.85 | 92.22        |

注：行业分类标准：MSCI

### 7.3.2 期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 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

### 7.4.1 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  | Prologis     | 安博           | PLD  | 纽约证        | 美国           | 58,802.00 | 45,405,478.63 | 9.14                 |

|    |                                     |            |      |                 |      |            |               |      |
|----|-------------------------------------|------------|------|-----------------|------|------------|---------------|------|
|    | Inc                                 |            |      | 券交易<br>所        |      |            |               |      |
| 2  | Public Storage Inc                  | 公共存储<br>公司 | PSA  | 纽约证<br>券交易<br>所 | 美国   | 12,019.00  | 23,346,756.89 | 4.70 |
| 3  | Simon Property Group Inc            | 西蒙地产       | SPG  | 纽约证<br>券交易<br>所 | 美国   | 26,001.00  | 21,916,602.96 | 4.41 |
| 4  | Digital Realty Trust Inc            | -          | DLR  | 纽约证<br>券交易<br>所 | 美国   | 22,373.00  | 21,746,257.23 | 4.38 |
| 5  | Welltower Inc                       | -          | WELL | 纽约证<br>券交易<br>所 | 美国   | 33,296.00  | 17,874,435.19 | 3.60 |
| 6  | Avalonbay Communities Inc           | 阿湾物产       | AVB  | 纽约证<br>券交易<br>所 | 美国   | 11,111.00  | 14,979,386.53 | 3.02 |
| 7  | Equity Residential                  | 资产住宅<br>公司 | EQR  | 纽约证<br>券交易<br>所 | 美国   | 29,377.00  | 14,612,933.54 | 2.94 |
| 8  | Alexandria Real Estate Equities Inc | -          | ARE  | 纽约证<br>券交易<br>所 | 美国   | 11,665.00  | 13,710,464.68 | 2.76 |
| 9  | Realty Income Corp                  | -          | O    | 纽约证<br>券交易<br>所 | 美国   | 29,786.00  | 12,842,146.75 | 2.59 |
| 10 | Extra Space Storage Inc             | -          | EXR  | 纽约证<br>券交易<br>所 | 美国   | 10,452.00  | 11,061,284.52 | 2.23 |
| 11 | Ventas Inc                          | -          | VTR  | 纽约证<br>券交易<br>所 | 美国   | 29,876.00  | 11,020,411.21 | 2.22 |
| 12 | Invitation Homes Inc                | -          | INVH | 纽约证<br>券交易<br>所 | 美国   | 45,245.00  | 10,899,390.60 | 2.19 |
| 13 | Link Real Estate Investment Trust   | 领展房产<br>基金 | 0823 | 香港证<br>券交易<br>所 | 中国香港 | 166,900.00 | 10,450,279.94 | 2.10 |
| 14 | Essex Property                      | -          | ESS  | 纽约证<br>券交易      | 美国   | 5,165.00   | 10,010,258.61 | 2.02 |

|    |                                       |           |        |              |    |           |              |      |
|----|---------------------------------------|-----------|--------|--------------|----|-----------|--------------|------|
|    | Trust Inc                             |           |        | 所            |    |           |              |      |
| 15 | Mid-America Apartment Communities Inc | -         | MAA    | 纽约证券交易所      | 美国 | 9,074.00  | 9,872,603.12 | 1.99 |
| 16 | Sun Communities Inc                   | -         | SUI    | 纽约证券交易所      | 美国 | 8,899.00  | 9,853,516.88 | 1.98 |
| 17 | Segro plc                             | 思格卢公司     | SGRO   | 伦敦证券交易所      | 英国 | 94,876.00 | 9,284,493.73 | 1.87 |
| 18 | HCP Inc                               | -         | PEAK   | 纽约证券交易所      | 美国 | 42,964.00 | 9,239,697.30 | 1.86 |
| 19 | Boston Properties Inc REIT            | -         | BXP    | 纽约证券交易所      | 美国 | 12,442.00 | 9,210,350.49 | 1.85 |
| 20 | Duke Realty Corp                      | -         | DRE    | 纽约证券交易所      | 美国 | 29,831.00 | 9,124,877.36 | 1.84 |
| 21 | VICI Properties Inc                   | -         | VICI   | 纽约证券交易所      | 美国 | 42,801.00 | 8,576,990.92 | 1.73 |
| 22 | UDR Inc                               | -         | UDR    | 纽约证券交易所      | 美国 | 23,534.00 | 7,446,527.04 | 1.50 |
| 23 | Equity Lifestyle Properties Inc       | -         | ELS    | 纽约证券交易所      | 美国 | 13,847.00 | 6,647,252.78 | 1.34 |
| 24 | Camden Property Trust                 | -         | CPT US | 纽约证券交易所      | 美国 | 7,478.00  | 6,409,105.65 | 1.29 |
| 25 | Host Hotels & Resorts Inc             | 豪斯特酒店及度假村 | HST    | 美国纳斯达克市场     | 美国 | 55,718.00 | 6,151,440.43 | 1.24 |
| 26 | Unibail-Rodamco SE                    | -         | URW NA | 阿姆斯特丹泛欧证券交易所 | 荷兰 | 10,866.00 | 6,095,997.01 | 1.23 |
| 27 | Medical Properties                    | -         | MPW    | 纽约证券交易所      | 美国 | 46,176.00 | 5,995,861.71 | 1.21 |

|    |                                              |         |         |           |      |            |              |      |
|----|----------------------------------------------|---------|---------|-----------|------|------------|--------------|------|
|    | Trust Inc                                    |         |         | 所         |      |            |              |      |
| 28 | Scentre Group Stapled Securities             | -       | SCG     | 澳大利亚证券交易所 | 澳大利亚 | 417,731.00 | 5,554,432.09 | 1.12 |
| 29 | Vereit Inc                                   | -       | VER     | 纽约证券交易所   | 美国   | 18,235.00  | 5,410,550.49 | 1.09 |
| 30 | Americold Realty Trust Shares of USD0.01     | -       | COLD US | 纽约证券交易所   | 美国   | 20,417.00  | 4,992,258.37 | 1.01 |
| 31 | Nippon Building Fund Inc                     | 日本建设    | 8951    | 东京证券交易所   | 日本   | 120.00     | 4,858,872.48 | 0.98 |
| 32 | CyrusOne Inc                                 | -       | CONE    | 美国纳斯达克市场  | 美国   | 9,890.00   | 4,569,440.62 | 0.92 |
| 33 | Mirvac Group Stapled Securities Unit         | -       | MGR     | 澳大利亚证券交易所 | 澳大利亚 | 312,422.00 | 4,427,074.73 | 0.89 |
| 34 | Stockland Stapled Securities Unit            | -       | SGP     | 澳大利亚证券交易所 | 澳大利亚 | 195,169.00 | 4,413,561.13 | 0.89 |
| 35 | Dexus Property Group Stapled Securities Unit | -       | DXS     | 澳大利亚证券交易所 | 澳大利亚 | 84,719.00  | 4,386,696.96 | 0.88 |
| 36 | Store Capital Corp Shares of USD0.01         | -       | STOR    | 纽约证券交易所   | 美国   | 19,464.00  | 4,339,266.22 | 0.87 |
| 37 | Vornado Realty Trust REIT                    | -       | VNO US  | 纽约证券交易所   | 美国   | 13,979.00  | 4,214,568.79 | 0.85 |
| 38 | Japan Real                                   | 日本房地产投资 | 8952    | 东京证券交易所   | 日本   | 104.00     | 4,150,257.70 | 0.84 |

|    |                                                    |            |          |                   |      |            |              |      |
|----|----------------------------------------------------|------------|----------|-------------------|------|------------|--------------|------|
|    | Estate<br>Investmen<br>t Corp                      |            |          | 所                 |      |            |              |      |
| 39 | Gecina<br>SA                                       | -          | GFC FP   | 巴黎泛<br>欧证券<br>交易所 | 法国   | 4,095.00   | 4,066,568.58 | 0.82 |
| 40 | Japan<br>Retail<br>Fund<br>Investmen<br>t Corp     | -          | 8953     | 东京证<br>券交易<br>所   | 日本   | 547.00     | 3,847,997.97 | 0.77 |
| 41 | Nomura<br>Real<br>Estate<br>Master<br>Fund Inc     | -          | 3462     | 东京证<br>券交易<br>所   | 日本   | 360.00     | 3,746,169.65 | 0.75 |
| 42 | GLP<br>J-REIT                                      | -          | 3281     | 东京证<br>券交易<br>所   | 日本   | 333.00     | 3,727,870.00 | 0.75 |
| 43 | GPT<br>Group<br>Stapled<br>Securities<br>Unit      | -          | GPT      | 澳大利<br>亚证券<br>交易所 | 澳大利亚 | 156,256.00 | 3,715,567.67 | 0.75 |
| 44 | Nippon<br>Prologis<br>REIT Inc                     | -          | 3283     | 东京证<br>券交易<br>所   | 日本   | 179.00     | 3,697,119.34 | 0.74 |
| 45 | Ascendas<br>Real<br>Estate<br>Investmen<br>t Trust | -          | AREIT SP | 新加坡<br>交易所        | 新加坡  | 260,200.00 | 3,686,504.49 | 0.74 |
| 46 | CapitaLand<br>Mall<br>Trust                        | -          | CT SP    | 新加坡<br>交易所        | 新加坡  | 352,652.00 | 3,539,794.88 | 0.71 |
| 47 | Land<br>Securities<br>Group plc                    | 兰德证券<br>集团 | LAND     | 伦敦证<br>券交易<br>所   | 英国   | 56,468.00  | 3,409,962.12 | 0.69 |
| 48 | British<br>Land Co<br>plc                          | -          | BLND     | 伦敦证<br>券交易<br>所   | 英国   | 73,277.00  | 3,242,434.61 | 0.65 |
| 49 | Daiwahouse<br>Residential                          | -          | 8984     | 东京证<br>券交易<br>所   | 日本   | 158.00     | 3,023,356.86 | 0.61 |

|    |                               |          |         |           |     |            |              |      |
|----|-------------------------------|----------|---------|-----------|-----|------------|--------------|------|
|    | Investment Corp               |          |         |           |     |            |              |      |
| 50 | SL Green Realty Corp REIT     | SL 格林不动产 | SLG     | 纽约证券交易所   | 美国  | 5,580.00   | 2,883,788.64 | 0.58 |
| 51 | Warehouses De Pauw SCA        | -        | WDP BB  | 布鲁塞尔证券交易所 | 比利时 | 11,098.00  | 2,746,706.61 | 0.55 |
| 52 | Klepierre                     | -        | LI FP   | 巴黎泛欧证券交易所 | 法国  | 14,596.00  | 2,437,840.36 | 0.49 |
| 53 | Unite Group plc               | 联合集团     | UTG     | 伦敦证券交易所   | 英国  | 25,217.00  | 2,421,496.22 | 0.49 |
| 54 | Tritax Big Box REIT PLC       | -        | BBOX    | 伦敦证券交易所   | 英国  | 136,032.00 | 2,387,522.56 | 0.48 |
| 55 | Derwent London plc            | -        | DLN     | 伦敦证券交易所   | 英国  | 7,980.00   | 2,368,792.78 | 0.48 |
| 56 | Mapletree Logistics Trust     | -        | MLT SP  | 新加坡交易所    | 新加坡 | 225,700.00 | 2,222,137.25 | 0.45 |
| 57 | Fonciere des Regions SA       | -        | FDR FP  | 巴黎泛欧证券交易所 | 法国  | 4,007.00   | 2,221,195.28 | 0.45 |
| 58 | Cofinimm o SA                 | -        | COFB BB | 布鲁塞尔证券交易所 | 比利时 | 2,140.00   | 2,111,983.29 | 0.43 |
| 59 | Primary Health Properties plc | -        | PHP     | 伦敦证券交易所   | 英国  | 104,268.00 | 1,434,748.41 | 0.29 |

#### 7.4.2 积极投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

#### 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  | Prologis Inc                          | PLD US  | 19,016,176.60 | 6.41           |
| 2  | Simon Property Group Inc              | SPG US  | 9,740,113.78  | 3.28           |
| 3  | Digital Realty Trust Inc              | DLR US  | 9,090,657.89  | 3.07           |
| 4  | Public Storage Inc                    | PSA US  | 8,699,689.18  | 2.93           |
| 5  | Realty Income Corp                    | O US    | 6,388,776.66  | 2.15           |
| 6  | Avalonbay Communities Inc             | AVB US  | 6,201,518.92  | 2.09           |
| 7  | Welltower Inc                         | WELL US | 6,141,669.06  | 2.07           |
| 8  | Equity Residential                    | EQR US  | 5,964,418.25  | 2.01           |
| 9  | Alexandria Real Estate Equities Inc   | ARE US  | 5,964,049.23  | 2.01           |
| 10 | Ventas Inc                            | VTR US  | 4,296,842.54  | 1.45           |
| 11 | Invitation Homes Inc                  | INVH    | 4,136,092.62  | 1.39           |
| 12 | Essex Property Trust Inc              | ESS US  | 4,043,689.25  | 1.36           |
| 13 | Link Real Estate Investment Trust     | 0823    | 3,956,430.75  | 1.33           |
| 14 | Sun Communities Inc                   | SUI     | 3,950,445.21  | 1.33           |
| 15 | Extra Space Storage Inc               | EXR US  | 3,874,211.60  | 1.31           |
| 16 | Boston Properties Inc REIT            | BXP US  | 3,513,539.15  | 1.18           |
| 17 | HCP Inc                               | PEAK    | 3,511,830.37  | 1.18           |
| 18 | Mid-America Apartment Communities Inc | MAA US  | 3,432,553.25  | 1.16           |
| 19 | Duke Realty Corp                      | DRE US  | 3,381,465.59  | 1.14           |
| 20 | VICI Properties Inc                   | VICI    | 3,226,537.80  | 1.09           |

注：“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  | WP Carey Inc REIT               | WPC    | 5,075,350.16 | 1.71           |
| 2  | Prologis Inc                    | PLD US | 3,933,403.51 | 1.33           |
| 3  | Regency Centers Corp            | REG    | 3,647,114.11 | 1.23           |
| 4  | Omega Healthcare Investors Inc  | OHI US | 3,387,600.91 | 1.14           |
| 5  | Federal Realty Investment Trust | FRT US | 3,134,888.94 | 1.06           |
| 6  | Kimco Realty Corp               | KIM US | 3,094,092.87 | 1.04           |
| 7  | Apartment Income REIT Corp      | AIRC   | 2,361,630.09 | 0.80           |

|    |                              |         |              |      |
|----|------------------------------|---------|--------------|------|
| 8  | Simon Property Group Inc     | SPG US  | 2,261,945.41 | 0.76 |
| 9  | ORIX JREIT Inc               | 8954    | 1,851,657.13 | 0.62 |
| 10 | Public Storage Inc           | PSA US  | 1,777,984.49 | 0.60 |
| 11 | United Urban Investment Corp | 8960    | 1,609,818.94 | 0.54 |
| 12 | Avalonbay Communities Inc    | AVB US  | 1,608,030.73 | 0.54 |
| 13 | Realty Income Corp           | O US    | 1,372,556.27 | 0.46 |
| 14 | Digital Realty Trust Inc     | DLR US  | 1,339,633.12 | 0.45 |
| 15 | Equity Residential           | EQR US  | 1,167,204.41 | 0.39 |
| 16 | Alstria Office REIT AG       | AOX GR  | 1,093,877.51 | 0.37 |
| 17 | ICADE SA                     | ICAD FP | 874,921.40   | 0.30 |
| 18 | Great Portland Estates plc   | GPOR LN | 868,224.48   | 0.29 |
| 19 | Essex Property Trust Inc     | ESS US  | 808,117.13   | 0.27 |
| 20 | Invitation Homes Inc         | INVH    | 718,205.99   | 0.24 |

注：“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。

### 7.5.3 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 | 190,403,395.45 |
| 卖出收入（成交）总额 | 53,641,537.99  |

注：“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。

### 7.6 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

本基金本报告期末未持有基金。

## 7.11 本报告期投资基金情况

### 7.11.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

## 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1** 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**7.12.2** 报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 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 | -            |
| 3  | 应收股利    | 1,504,602.25 |
| 4  | 应收利息    | 2,619.89     |
| 5  | 应收申购款   | 4,313,749.47 |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 5,820,971.61 |

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资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。

#### 7.12.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他需要说明的事项

因四舍五入原因,投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

## 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 |
| 46,814   | 8,583.39      | 26,397,929.89 | 6.57%      | 375,424,974.77 | 93.43%     |

### 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 | 104,933.70 | 0.0261%  |

### 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（2018 年 4 月 26 日）基金份额总额 | 217,433,561.84 |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 278,246,432.22 |
| 本报告期基金总申购份额                    | 258,584,690.44 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 135,008,218.00 |
| 本报告期基金拆分变动份额                   | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 401,822,904.66 |

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 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

基金管理人：无。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所的情况。

### 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

报告期内，管理人、托管人未受稽查或处罚，亦未发现管理人、托管人的高级管理人员受稽查或处罚。

### 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 Global Mkts Ltd London    | 1      | 18,659,607.62  | 4.00%        | 10,529.34  | 3.92%      | -  |
| Instinet LLC New York               | 1      | 326,160,550.20 | 69.94%       | 162,762.38 | 60.58%     | -  |
| Instinet Pacific Ltd Hong Kong      | 1      | 30,762,204.88  | 6.60%        | 31,895.58  | 11.87%     | -  |
| Instinet Europe Limited             | 1      | 82,230,552.39  | 17.63%       | 54,581.65  | 20.32%     | -  |
| Instinet Singapore Services Pte Ltd | 1      | 8,514,535.92   | 1.83%        | 8,885.88   | 3.31%      | -  |
| 安信证券                                | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 中金公司                                | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| Goldman Sachs International London  | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2. 交易单元的选择标准：

1) 资本金雄厚,信誉良好。

2) 财务状况良好,经营行为规范。

3) 内部管理规范、严格,具备健全的内控制度。

4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要,并能为本基金提供全面的信息服

5) 研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

### 3. 交易单元的选择程序:

1) 本基金管理人定期召开会议,组织相关部门依据交易单元的选择标准对交易单元候选券商进行评估,确定选用交易单元的券商。

2) 本基金管理人与券商签订交易单元租用协议,并通知基金托管人。

4. 本期无增席位,无注销席位。

### 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 Global Mkts Ltd London | -    | -            | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| Institute LLC New York           | -    | -            | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| Institute Pacific Ltd Hong Kong  | -    | -            | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| Institute                        | -    | -            | -    | -            | -    | -            | -    | -            |

|                                                             |   |   |   |   |   |   |   |   |
|-------------------------------------------------------------|---|---|---|---|---|---|---|---|
| et<br>Euro<br>pe<br>Limit<br>ed                             |   |   |   |   |   |   |   |   |
| Instin<br>et<br>Singa<br>pore<br>Servi<br>ces<br>Pte<br>Ltd | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 安信<br>证券                                                    | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中金<br>公司                                                    | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Gold<br>man<br>Sachs<br>Inter<br>natio<br>nal<br>Lond<br>on | - | - | - | - | - | - | - | - |

注：无。

## 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  | 上投摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金（QDII）基金经理变更公告                 | 基金管理人公司网站及<br>本基金选定的信息披露<br>报纸 | 2021-01-09 |
| 2  | 上投摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金（QDII）暂停申购、赎回、定期定额投资及转换转入业务的公告 | 同上                             | 2021-01-14 |
| 3  | 上投摩根基金管理有限公司关于修改公司旗下部分基金基金合同及托管协议的公告                     | 同上                             | 2021-02-26 |
| 4  | 关于降低上投摩根旗下部分基金单笔最低交易限额的公告                                | 同上                             | 2021-03-10 |
| 5  | 上投摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金（QDII）暂停申购、赎回、定期定额投资及转换转入业务的公告 | 同上                             | 2021-03-30 |

|   |                                                                                                                  |    |            |
|---|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|------------|
| 6 | 上投摩根基金管理有限公司关于修改公司旗下 5 只指数基金基金合同的公告                                                                              | 同上 | 2021-03-31 |
| 7 | 上投摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金（QDII）暂停申购、赎回、定期定额投资及转换转入业务的公告上投摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金（QDII）暂停申购、赎回、定期定额投资及转换转入业务的公告 | 同上 | 2021-05-29 |

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准上投摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金（QDII）设立的文件；
2. 《上投摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金（QDII）基金合同》；
3. 《上投摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金（QDII）基金托管协议》；
4. 《上投摩根开放式基金业务规则》；
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照；
6. 基金托管人业务资格批件和营业执照。

### 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人住所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

网址：[www.cifm.com](http://www.cifm.com)

上投摩根基金管理有限公司

二〇二一年八月三十一日