

# 南方道琼斯美国精选 REIT 指数证券投资 基金 2019 年半年度报告摘要

2019 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 8 月 23 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 21 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 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	美国 REIT	
基金主代码	160140	
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)	
基金合同生效日	2017 年 10 月 26 日	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	63,533,599.23 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2017 年 11 月 24 日	
下属分级基金的基金简称	美国 REIT	美国 RE C
下属分级基金的交易代码	160140	160141
报告期末下属分级基金的份 额总额	41,881,896.98 份	21,651,702.25 份

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“美国 REIT”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效分散风险的基础上，力争获得与业绩比较基准相似的回报。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资，以实现对标指数的有效跟踪。主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份券组成及其权重构建 REIT 投资组合，并根据标的指数成份券及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	道琼斯美国精选 REIT 指数收益率 $\times 95\%$ + 银行人民币活期存款利率（税后） $\times 5\%$
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。 本基金主要投资于境外市场，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

### 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		南方基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负 责人	姓名	常克川	郭明
	联系电话	0755-82763888	010-66105799
	电子邮箱	manager@southernfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-889-8899	95588

传真	0755-82763889	010-66105798
----	---------------	--------------

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人	境外投资顾问
名称	中文	布朗兄弟哈里曼银行	-
	英文	Brown Brothers Harriman & Co.	-
注册地址		140 Broadway New York, NY 10005	-
办公地址		140 Broadway New York, NY 10005	-
邮政编码		10005	-

## 2.5 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

### § 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

##### 1、美国 REIT

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	808,065.48
本期利润	5,128,549.60
加权平均基金份额本期利润	0.1392
本期基金份额净值增长率	14.49%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0002
期末基金资产净值	47,024,196.22
期末基金份额净值	1.1228

##### 2、美国 RE C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	329,976.45
本期利润	2,089,833.80
加权平均基金份额本期利润	0.1303
本期基金份额净值增长率	14.24%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0069
期末基金资产净值	24,136,975.02
期末基金份额净值	1.1148

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

3、对期末可供分配利润，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。

### 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

美国 REIT

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	0.80%	0.88%	0.45%	0.89%	0.35%	-0.01%
过去三个月	2.41%	0.85%	1.91%	0.86%	0.50%	-0.01%
过去六个月	14.49%	0.82%	13.96%	0.83%	0.53%	-0.01%
过去一年	10.58%	0.93%	9.24%	0.94%	1.34%	-0.01%
自基金合同生效起至今	12.28%	0.90%	12.57%	0.89%	-0.29%	0.01%

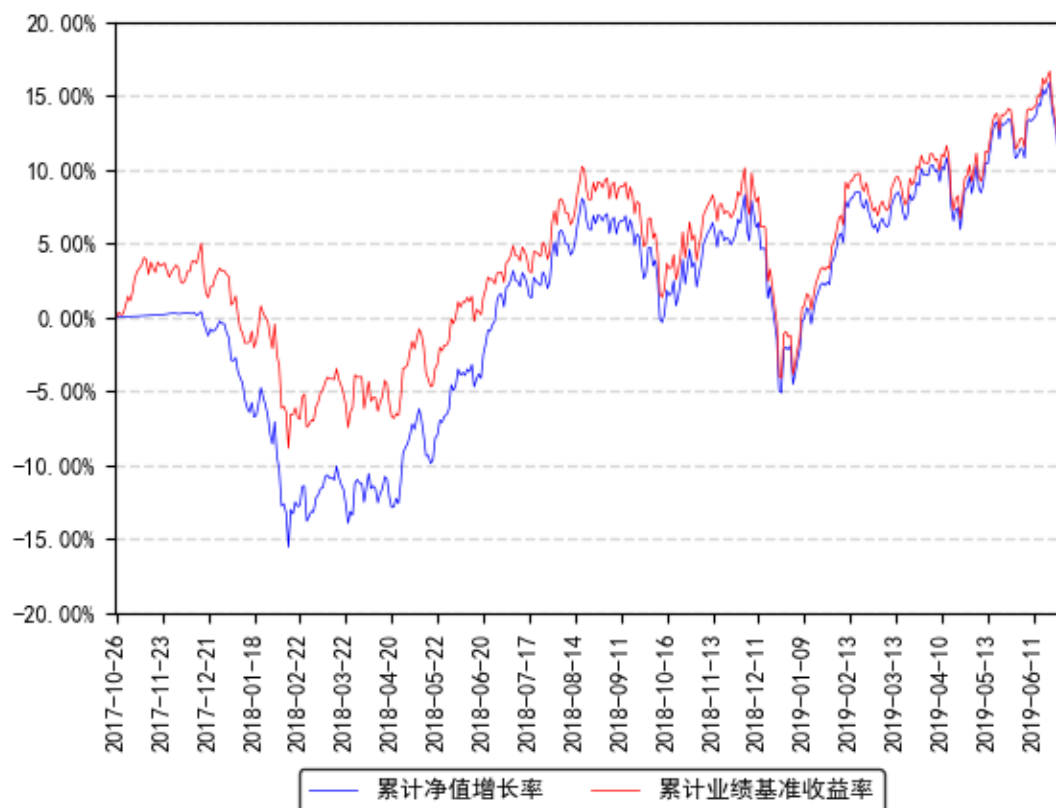
美国 RE C

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	0.76%	0.88%	0.45%	0.89%	0.31%	-0.01%
过去三个月	2.28%	0.85%	1.91%	0.86%	0.37%	-0.01%
过去六个月	14.24%	0.82%	13.96%	0.83%	0.28%	-0.01%
过去一年	10.06%	0.93%	9.24%	0.94%	0.82%	-0.01%
自基金合同生效起至今	11.48%	0.90%	12.57%	0.89%	-1.09%	0.01%

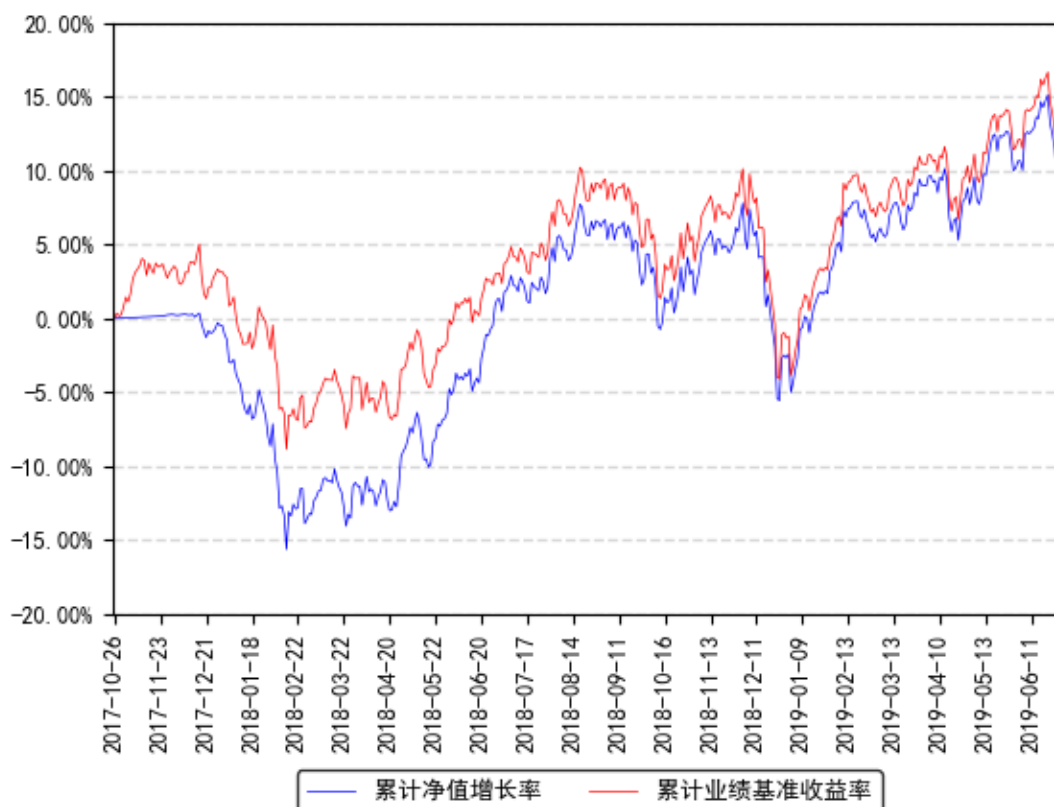
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基

准收益率变动的比较

美国REIT累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



美国REIT C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 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

1998年3月6日,经中国证监会批准,南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立,成为我国“新基金时代”的起始标志。

2018年1月,公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。2019年7月,根据南方基金管理股份有限公司股东大会决议,并经中国证监会核准,本公司原股东及新增股东共同认购了本公司新增的注册资本,认购完成后注册资本为36172万元人民币。目前股权结构为:华泰证券股份有限公司41.16%、深圳市投资控股有限公司27.44%、厦门国际信托有限公司13.72%、兴业证券股份有限公司9.15%、厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙)2.10%、厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙)2.12%、厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙)2.11%、厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙)2.20%。目前,公司在北京、上海、合肥、成都、深圳、南京等地设有分公司,在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产



管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末，南方基金管理股份有限公司（不含子公司）管理资产规模超过 8800 亿元，旗下管理 191 只开放式基金，多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户理财投资组合。

#### 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		
黄亮	本基金基金经理	2017年10月26日	-	18年	北京大学工商管理硕士，具有基金从业资格。曾任职于招商证券股份有限公司、天华投资有限责任公司，2005年加入南方基金国际业务部，现任国际业务部总经理、国际投资决策委员会委员；2007年9月至2009年5月，任南方全球基金经理助理；2011年9月至2015年5月，任南方中国中小盘基金经理；2015年5月至2017年11月，任南方香港优选基金经理；2017年4月至2019年4月，任国企精明基金经理；2009年6月至今，任南方全球基金经理；2010年12月至今，任南方金砖基金经理；2016年6月至今，任南方原油基金经理；2017年10月至今，任美国 REIT 基金经理；2019年4月至今，任南方香港成长基金经理。

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，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，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律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

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。

本报告期内,两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在,并且交易占比也没有明显异常,未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的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%的交易次数为5次,是由于投资组合接受投资者申赎后被动增减仓位以及指数成分股调整所致。

## 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

2019年上半年全球宏观经济继续维持冷热不均的发展格局,欧美央行货币政策转向、中国经济数据有所起伏、中美贸易战反复引发全球股市震荡。发达经济体中美国经济虽然持续增长但增速略有放缓,6月ISM制造业PMI为51.7,仍然稳定在荣枯线上方,失业率在3.7%低位,每小时工资同比上涨3.1%,就业市场持续高度繁荣,经济活动保持强劲态势。与此同时,美联储6月会议给出了降息的信息,半数投票委员支持未来降息。目前期货市场反映出的数据,2019年7月议息会降息概率接近100%。美国国债收益率曲线相对上月继续整体下移,仍旧保持了明显的“勺子”形态。利率曲线倒挂,显示出债券市场对于1年内降息的预期,美联储“预防式”的宽松货币政策有助于支撑美国基本面,预防经济放缓,拉长经济增长周期。

二季度美国经济增长虽然面临一定的考验和压力,但在美联储即将开启降息的预期下,美国经济未来保持相对平稳状态值得期待。在相对平稳的经济基本面带动下,美国的房地产市场也有不错的表现。美国新屋销售上半年继续维持在60万套/月以上的水平,就业市场的持续走好也提振了美国的房屋租赁市场。

美元计价的道琼斯美国精选REIT指数二季度收益0.82%,整个上半年实现了16.67%的收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金 A 份额净值为 1.1228 元,报告期内,份额净值增长率为 14.49%,同期业绩基准增长率为 13.96%;本基金 C 份额净值为 1.1148 元,报告期内,份额净值增长率为 14.24%,同期业绩基准增长率为 13.96%。

#### 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,对于美国 REIT 市场的后市,我们维持乐观的判断。美国经济的内生性增长韧性使该经济体的复苏前景最具确定性,美国失业率已经下降到 3.7% 的低位,就业市场的繁荣以及未来工资收入的提升都将对美国房地产市场形成有力支撑。其次是美联储大概率会在目前的利率水平上停止本轮的加息,加息的结束将大大有利于利率相关资产的未来走势。目前道琼斯美国精选 REIT 指数的分红收益率为 3.82%,稳定分红收益的 REIT 未来将会吸引更多的防御避险资金的流入。随着美联储进入新一轮的降息周期,美债收益率明显下行,具备较强债性、有明显后周期特性的 REIT 将会受到更多投资者的关注,投资价值值得重点关注。

未来,本基金投资团队将密切关注市场变化趋势,谨慎勤勉、恪尽职守,实现对标的指数的有效跟踪。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定,本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度,明确基金估值的程序和技术;建立了估值委员会,组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、指数投资部总经理、现金投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统,估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监控、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术,导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的,对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值价格的最终决策。本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定,在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为 12 次,每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%,若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;本基金收益分配方

式分两种：现金分红与红利再投资，登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为同一类别的基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

#### 4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

## § 5 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，本基金托管人在对南方道琼斯美国精选 REIT 指数证券投资基金(QDII-LOF)的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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

本报告期内，南方道琼斯美国精选 REIT 指数证券投资基金 (QDII-LOF) 的托管人——南方基金管理股份有限公司在南方道琼斯美国精选 REIT 指数证券投资基金 (QDII-LOF) 的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，南方道琼斯美国精选 REIT 指数证券投资基金 (QDII-LOF) 未进行利润分配。

### 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

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的南方道琼斯美国精选 REIT 指数证券投资基金 (QDII-LOF) 2019 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：南方道琼斯美国精选 REIT 指数证券投资基金（QDII-LOF）

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	5,942,244.59	4,734,158.16
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	64,932,295.36	50,490,813.89
其中：股票投资	59,431,985.38	49,301,455.65
基金投资	5,500,309.98	1,189,358.24
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	415.23	564,349.41
应收利息	529.14	602.62
应收股利	202,972.36	222,953.03
应收申购款	1,682,369.79	341,647.85
递延所得税资产	-	-
其他资产	75,858.33	192,340.43
资产总计	72,836,684.80	56,546,865.39
负债和所有者权益	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：		
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	1,343,360.00	1,522,058.27
应付管理人报酬	41,387.86	37,645.08
应付托管费	12,933.68	11,764.06
应付销售服务费	5,924.16	5,197.10
应付交易费用	-	-
应交税费	-	4,583.84
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	271,907.86	273,955.60
负债合计	1,675,513.56	1,855,203.95
所有者权益：		
实收基金	63,533,599.23	55,846,306.31
未分配利润	7,627,572.01	-1,154,644.87
所有者权益合计	71,161,171.24	54,691,661.44
负债和所有者权益总计	72,836,684.80	56,546,865.39

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，美国 REIT 份额净值 1.1228 元，基金份额总额 41,881,896.98 份；美国 RE C 份额净值 1.1148 元，基金份额总额 21,651,702.25 份；总份额合计 63,533,599.23 份。

## 6.2 利润表

会计主体：南方道琼斯美国精选 REIT 指数证券投资基金 (QDII-LOF)

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入	7,810,259.27	190,453.53
1. 利息收入	7,932.96	6,046.23
其中：存款利息收入	7,932.96	6,046.23
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	-	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)	1,657,713.79	-592,526.70
其中: 股票投资收益	700,779.75	-1,151,573.09
基金投资收益	28,886.47	-29,278.94
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	928,047.57	588,325.33
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6,080,341.47	799,114.56
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)	-40,678.39	-56,324.82
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	104,949.44	34,144.26
减: 二、费用	591,875.87	539,115.63
1. 管理人报酬	226,401.54	140,081.80
2. 托管费	70,750.44	43,775.54
3. 销售服务费	34,161.52	24,707.05
4. 交易费用	25,813.27	13,931.27
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	234,749.10	316,619.97
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	7,218,383.40	-348,662.10
减: 所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	7,218,383.40	-348,662.10

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方道琼斯美国精选 REIT 指数证券投资基金（QDII-LOF）

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	55,846,306.31	-1,154,644.87	54,691,661.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,218,383.40	7,218,383.40
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）	7,687,292.92	1,563,833.48	9,251,126.40
其中：1. 基金申购款	51,562,083.72	5,383,810.73	56,945,894.45
2. 基金赎回款	-43,874,790.80	-3,819,977.25	-47,694,768.05
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）	63,533,599.23	7,627,572.01	71,161,171.24
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	59,837,692.09	-267,708.23	59,569,983.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-348,662.10	-348,662.10
三、本期基金份额交易产生的基金净值变	-22,626,025.70	1,155,764.59	-21,470,261.11



动数（净值减少以“—”号填列）			
其中：1. 基金申购款	11,777,192.63	-673,185.97	11,104,006.66
2. 基金赎回款	-34,403,218.33	1,828,950.56	-32,574,267.77
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）	37,211,666.39	539,394.26	37,751,060.65

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：

\_\_\_\_杨小松\_\_\_\_                      \_\_\_\_徐超\_\_\_\_                      \_\_\_\_徐超\_\_\_\_  
基金管理人负责人              主管会计工作负责人              会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

### 6.4.2 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。

### 6.4.3 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.3.1 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。

#### 6.4.3.2 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。

#### 6.4.3.3 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。

## 6.4.4 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,对金融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。

(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。

## 6.4.5 关联方关系

### 6.4.5.1 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。

### 6.4.5.2 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
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
布朗兄弟哈里曼银行 (“BrownBrothersHarriman&Co.”)	境外资产托管人
华泰金融控股(香港)有限公司(“华泰香港”)	基金管理人的股东华泰证券的子公司

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。

## 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰香港	18,364,635.77	73.72%	10,199,177.05	49.73%

#### 6.4.6.1.2 基金交易

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期基金成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华泰香港	17,351,166.11	80.32%	3,337,240.63	80.15%

#### 6.4.6.1.3 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。

#### 6.4.6.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰香港	20,810.26	82.09%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰香港	7,176.17	53.60%	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

### 6.4.6.2 关联方报酬

#### 6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管	226,401.54	140,081.80

理费		
其中：支付销售机构的客户维护费	27,676.91	0.00

注：支付基金管理人南方基金管理股份有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.80%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：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

#### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	70,750.44	43,775.54

支付基金托管人工商银行的基金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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

#### 6.4.6.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	美国 REIT	美国 RE C	合计
工商银行	-	13,512.85	13,512.85
华泰证券	-	498.62	498.62
南方基金	-	1,984.51	1,984.51
兴业证券	-	130.09	130.09
合计	-	16,126.07	16,126.07
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	美国 REIT	美国 RE C	合计
南方基金	-	698.31	698.31
华泰证券	-	540.43	540.43
中国工商银行	-	12,163.93	12,163.93
合计	-	13,402.67	13,402.67

注：C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.4%。本基金销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.4% 年费率计提。基金销售服务费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性划付到由基金管理人开立的 TA 清算账户中。计算方法如下：

C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费 = C 类基金份额前一日基金资产净值 × 年销售服务费率 ÷ 当年天数

**6.4.6.3 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。

**6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.6.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	美国 RE C	美国 REIT
基金合同生效日（2017 年 10 月 26 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	7,412,658.70
报告期间申购/买入总份额	-	0.00
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	7,412,658.70
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	11.67%

**6.4.6.4.2 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**

无。

**6.4.6.5 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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
布朗兄弟哈里曼银行	2,460,731.22	-	623,917.26	-
中国工商银行股份有限公司	3,481,513.37	7,864.98	2,241,010.63	5,228.66

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

**6.4.6.6 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证券的情况。

**6.4.6.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.7 期末（2019 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券****6.4.7.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

**6.4.7.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

**6.4.7.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

**§ 7 投资组合报告****7.1 期末基金资产组合情况**

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	59,431,985.38	81.60
	其中：普通股	-	-
	房地产存托凭证	59,431,985.38	81.60
2	基金投资	5,500,309.98	7.55
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	5,942,244.59	8.16
8	其他资产	1,962,144.85	2.69
9	合计	72,836,684.80	100.00

**7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布**

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
--------	------------	--------------

美国	59,431,985.38	83.52
合计	59,431,985.38	83.52

注：国家（地区）类别根据股票及存托凭证所在的交易所确定。

### 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权益投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
保健 REIT	7,384,086.47	10.38
酒店 REIT	4,016,019.42	5.64
住宅 REIT	14,774,734.92	20.76
工业 REIT	7,593,619.55	10.67
多种资产类别 REIT	620,177.69	0.87
办公楼 REIT	7,330,382.34	10.30
停车场 REIT	-	-
零售 REIT	9,794,068.10	13.76
自助仓库 REIT	5,378,027.22	7.56
特殊与其他 REIT	2,540,869.67	3.57
合计	59,431,985.38	83.52

注：本基金对以上行业分类采用彭博行业分类标准。

#### 7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的权益投资。

### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

#### 7.4.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	Simon Property Group Inc	西蒙房地产集团公司	SPG UN	美国证券交易所	美国	4,350	4,777,614.01	6.71
2	Prologis Inc	普洛斯公司	PLD UN	美国证券交易所	美国	8,593	4,731,851.20	6.65

3	Public Storage	公共存储公司	PSA UN	美国证券交易所	美国	2,044	3,346,737.88	4.70
4	Welltower Inc	Welltower 股份有限公司	WELL UN	美国证券交易所	美国	5,516	3,091,686.51	4.34
5	AvalonBay Communities Inc	AvalonBay 社区股份有限公司	AVB UN	美国证券交易所	美国	1,899	2,652,526.14	3.73
6	Equity Residential	公寓物业权益信托	EQR UN	美国证券交易所	美国	5,046	2,633,644.77	3.70
7	Ventas Inc	Ventas 公司	VTR UN	美国证券交易所	美国	5,032	2,364,465.07	3.32
8	Digital Realty Trust Inc	数字房地产信托有限公司	DLR UN	美国证券交易所	美国	2,837	2,297,320.08	3.23
9	Boston Properties Inc	波士顿地产公司	BXP UN	美国证券交易所	美国	2,105	1,866,790.41	2.62
10	Essex Property Trust Inc	埃塞克斯房地产信托公司	ESS UN	美国证券交易所	美国	895	1,796,203.40	2.52

注:1. 本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2. 投资者欲了解本报告期末基金投资的所有权益明细, 应阅读登载于南方基金网站的 2019 年半年度报告正文。

#### 7.4.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的权益投资。

### 7.5 报告期内权益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

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 UN	1,887,663.79	3.45
2	Prologis Inc	PLD UN	1,441,677.55	2.64



3	Welltower Inc	WELL UN	1,144,611.04	2.09
4	Public Storage	PSA UN	1,080,359.09	1.98
5	AvalonBay Communities Inc	AVB UN	892,135.48	1.63
6	Equity Residential	EQR UN	886,583.42	1.62
7	Digital Realty Trust Inc	DLR UN	750,057.92	1.37
8	Ventas Inc	VTR UN	700,231.39	1.28
9	Boston Properties Inc	BXP UN	645,449.21	1.18
10	Essex Property Trust Inc	ESS UN	583,697.92	1.07
11	HCP Inc	HCP UN	337,789.87	0.62
12	Invitation Homes Inc	INVH UN	299,586.81	0.55
13	Extra Space Storage Inc	EXR UN	293,028.06	0.54
14	Camden Property Trust	CPT UN	286,574.57	0.52
15	UDR Inc	UDR UN	285,063.78	0.52
16	Regency Centers Corp	REG UQ	268,693.15	0.49
17	Duke Realty Corp	DRE UN	256,118.02	0.47
18	Federal Realty Investment Trust	FRT UN	246,743.57	0.45
19	Equity LifeStyle Properties Inc	ELS UN	234,131.36	0.43
20	Vornado Realty Trust	VNO UN	225,622.99	0.41

1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2、买入金额按买入成交金额（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

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 UN	1,478,160.03	2.70
2	Alexandria Real Estate Equities Inc	ARE UN	1,455,927.44	2.66
3	Prologis Inc	PLD UN	1,019,786.46	1.86

4	Public Storage	PSA UN	791,011.08	1.45
5	Equity Residential	EQR UN	664,712.00	1.22
6	AvalonBay Communities Inc	AVB UN	661,316.56	1.21
7	Welltower Inc	WELL UN	654,878.46	1.20
8	Digital Realty Trust Inc	DLR UN	542,600.54	0.99
9	Ventas Inc	VTR UN	424,246.64	0.78
10	Boston Properties Inc	BXP UN	419,510.76	0.77
11	Essex Property Trust Inc	ESS UN	362,775.87	0.66
12	Extra Space Storage Inc	EXR UN	304,722.00	0.56
13	HCP Inc	HCP UN	266,850.07	0.49
14	UDR Inc	UDR UN	223,466.57	0.41
15	Host Hotels & Resorts Inc	HST UN	203,430.96	0.37
16	Vornado Realty Trust	VNO UN	158,175.96	0.29
17	Camden Property Trust	CPT UN	152,393.70	0.28
18	Sun Communities Inc	SUI UN	145,484.41	0.27
19	Federal Realty Investment Trust	FRT UN	132,901.63	0.24
20	Equity LifeStyle Properties Inc	ELS UN	117,963.35	0.22

1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2、卖出包括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，卖出金额按成交金额（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	14,121,164.56
卖出收入（成交）总额	10,788,942.81

买入成本和卖出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序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 (元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	Schwab U.S. REIT ETF	ETF	交易型开放式	Charles Schwab Investment Management Inc	3,055,116.68	4.29
2	SPDR Dow Jones REIT ETF	ETF	交易型开放式	SSgA Funds Management Inc	2,445,193.30	3.44

### 7.11 投资组合报告附注

**7.11.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明**

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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**7.11.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明**

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，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

### 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 (元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	415.23
3	应收股利	202,972.36
4	应收利息	529.14
5	应收申购款	1,682,369.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,858.33
8	其他	-
9	合计	1,962,144.85

#### 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债券。

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

##### 7.11.5.2 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股票中不存在流通受限情况。

## § 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

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
美国 REIT	7,623	5,494.15	7,858,858.70	18.76%	34,023,038.28	81.24%
美国 RE C	3,811	5,681.37	109,317.13	0.50%	21,542,385.12	99.50%
合计	11,434	5,556.55	7,968,175.83	12.54%	55,565,423.40	87.46%

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额），户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
----	-------	----------	----------

1	深圳长欣基金管理有限公司—华欣号 私募证券投资基金	389,500.00	14.79%
2	华宇斌	227,760.00	8.65%
3	宋波	209,712.00	7.96%
4	李腾飞	171,652.00	6.52%
5	马桂兰	140,213.00	5.32%
6	熊义华	89,900.00	3.41%
7	肖文婷	69,400.00	2.63%
8	任玲阁	59,600.00	2.26%
9	赵燕军	58,400.00	2.22%
10	上海斯诺波投资管理有限公司—蓝星 一号私募证券投资基金	54,300.00	2.06%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	美国 REIT	649,904.45	1.5518%
	美国 RE C	-	-
	合计	649,904.45	1.0229%

注：分级基金机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.4 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情况

项目	份额级别	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 研究部门负责人持有本开放式基金	美国 REIT	0
	美国 RE C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	美国 REIT	10~50
	美国 RE C	0
	合计	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	美国 REIT	美国 RE C
基金合同生效日(2017年10月26日)基金份额总额	86,001,416.95	185,025,043.39

本报告期期初基金份额总额	39,778,742.46	16,067,563.85
本报告期基金总申购份额	25,441,898.97	26,120,184.75
减: 报告期基金总赎回份额	23,338,744.45	20,536,046.35
本报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	41,881,896.98	21,651,702.25

注: 报告截止日 2019 年 6 月 30 日, 南方道琼斯美国精选 REIT 指数证券投资基金份额总额 63,533,599.23 份, 其中 A 类基金份额为 41,881,896.98 份, C 类基金份额为 21,651,702.25 份。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期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

本报告期内, 本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内, 基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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, 无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内, 无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期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

本报告期内, 基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内, 基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 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	
Huatai Financial Holdings (Hong Kong) Limited	-	18,364,635.77	73.72%	20,810.26	82.09%	-
China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	-	6,545,471.60	26.28%	4,541.55	17.91%	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元的选择标准和程序根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

**A：选择标准**

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

**B：选择流程** 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

**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	基金交易	
	成交金额	占当期基金成交总额的比例
Huatai Financial Holdings (Hong Kong) Limited	17,351,166.11	80.32%
China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	4,252,418.92	19.68%
高华证券	-	-
海通证券	-	-
华泰证券	-	-
瑞银证券	-	-

注：当期由基金交易产生所需支付给

China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited 的佣金为 2,026.78 元；

当期由基金交易产生所需支付给 Huatai Financial Holdings (Hong Kong) Limited 的佣金为 7,232.59 元。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。