

# 嘉实全球房地产证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 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。本中期报告已经由全部独立董事签字同意，并由代董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年08月28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2024年01月01日起至2024年06月30日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	7
<b>§4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
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	10
<b>§5 托管人报告</b>	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	11
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	11
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	11
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>11</b>
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
<b>§7 投资组合报告</b>	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况	37
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 .....	38
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动 .....	40
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....	42
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 .....	43
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 .....	43
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 .....	43
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 .....	43
7.11 投资组合报告附注 .....	43
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>44</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	44
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情况 .....	44
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>44</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	45
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 .....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	45
10.4 基金投资策略的改变 .....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	45
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 .....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	45
10.8 其他重大事件 .....	53
<b>§11 备查文件目录 .....</b>	<b>54</b>
11.1 备查文件目录 .....	54
11.2 存放地点 .....	55
11.3 查阅方式 .....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实全球房地产证券投资基金
基金简称	嘉实全球房地产(QDII)
基金主代码	070031
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年7月24日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	31,960,297.07份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于全球房地产证券，在严格控制投资风险和保障资产流动性的基础上，力争长期、持续战胜业绩比较基准，为国内投资者分享全球房地产相对稳定的现金流收益和资本增值收益。
投资策略	<p>本基金采用自上而下的资产配置与自下而上的证券选择相结合的主动投资策略，在严格控制风险的同时为投资人提高分红收益和长期资本增值。同时本基金根据对汇率变动前景的预测，可选择相应的对冲工具进行外汇对冲。本基金主要根据市值规模，流动性，国家或地区的法规透明度、经济自由度和公司治理标准，盈利模式等指标建立房地产证券备选库。</p> <p>具体投资策略包括：房地产证券备选库的建立、资产配置策略、证券投资策略、组合构建策略、现金管理策略、衍生品投资策略、市场风险管理策略。</p>
业绩比较基准	FTSE EPRA/NAREIT Developed REITs Total Return Index (经汇率调整后的)
风险收益特征	本基金为股票型基金，主要投资于以 REITs 为代表的全球房地产证券，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的基金品种。

### 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	嘉实基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	胡勇钦
	联系电话	(010)65215588
	电子邮箱	service@jsfund.cn
客户服务电话	400-600-8800	95599
传真	(010)65215588	010-68121816
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号1806A单元	北京东城区建国门内大街69号
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街21号 北京国际俱乐部C座写字楼12A层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9

邮政编码	100020	100031
法定代表人	经雷	谷澍

## 2.4 境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	JP Morgan Chase Bank, National Association
	中文	摩根大通银行
注册地址		1111 Polaris Parkway, Columbus, OH 43240, U.S.A.
办公地址		383 Madison Avenue, New York, NY 10179-0001, U.S.A.
邮政编码		10179

## 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.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a>
基金中期报告备置地点	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

## 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	嘉实基金管理有限公司	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层

# § 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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-1,679,022.50
本期利润	-654,436.03
加权平均基金份额本期利润	-0.0194
本期加权平均净值利润率	-1.86%
本期基金份额净值增长率	-1.57%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-613,391.54
期末可供分配基金份额利润	-0.0192
期末基金资产净值	33,733,860.43
期末基金份额净值	1.055
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	54.46%

注：(1) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）

扣除相关费用和信用减值损失后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

(2) 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) 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

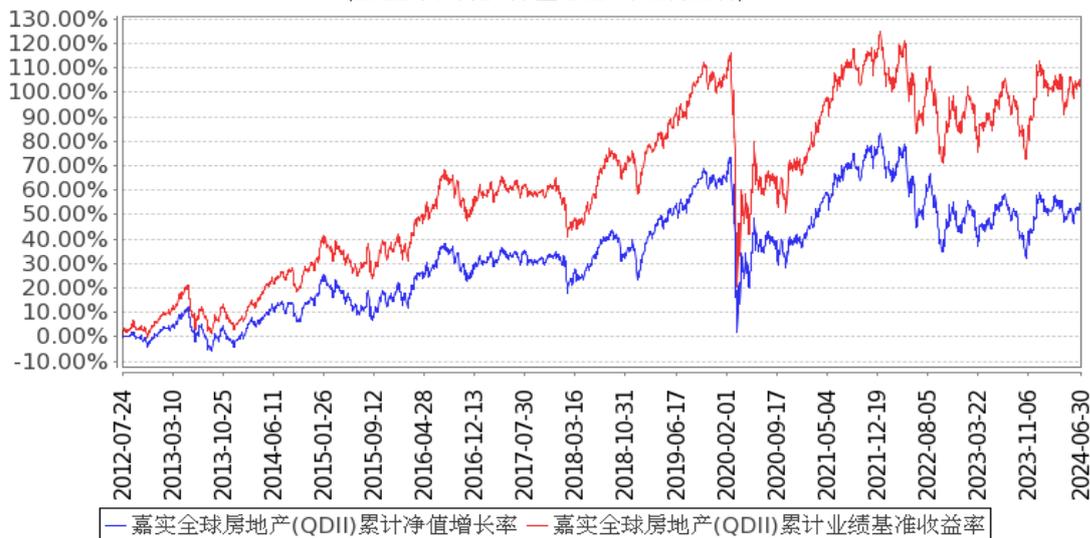
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.23%	0.46%	1.48%	0.57%	1.75%	-0.11%
过去三个月	-0.75%	0.76%	-0.82%	0.96%	0.07%	-0.20%
过去六个月	-1.57%	0.74%	-2.21%	0.87%	0.64%	-0.13%
过去一年	-0.05%	0.90%	3.49%	0.98%	-3.54%	-0.08%
过去三年	-5.46%	1.06%	1.50%	1.10%	-6.96%	-0.04%
自基金合同生效起至今	54.46%	1.03%	105.45%	1.09%	-50.99%	-0.06%

### 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

#### 嘉实全球房地产(QDII)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

(2012年07月24日至2024年06月30日)



注:按基金合同和招募说明书的约定,本基金自基金合同生效日起6个月为建仓期,建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

## 3.3 其他指标

无。

## § 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

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5号文批准，于1999年3月25日成立，是中国第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，总部设在北京并设北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII和特定资产管理业务等资格。

截止2024年6月30日，基金管理人共管理351只公募基金，覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF、基础设施基金等不同类别。同时，还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

#### 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		
蒋一茜	本基金、嘉实原油(QDII-LOF)基金经理	2022年11月4日	-	26年	曾任上海申银证券机构销售部及国际部交易员、LG securities (HK) Co., Ltd 研究员、上海沪光国际资产管理(香港)有限公司基金经理助理、德意志资产管理(香港)有限公司基金经理。2009年9月加入嘉实国际资产管理有限公司。硕士研究生，具有基金从业资格。中国香港籍。
张琴	本基金、嘉实新兴市场债券、嘉实全球产业精选混合发起式(QDII)基金经理	2023年9月28日	-	16年	曾任职于摩根大通、苏格兰皇家银行、东方汇理证券(亚洲)股票研究部，覆盖科技、电信、中小盘等行业。2014年6月至2022年7月任瑞士百达资产管理公司绝对收益部资深投资经理。2022年8月加入嘉实基金管理有限公司多策略解决方案战队。硕士研究生，具有基金从业资格。中国香港籍。

注：（1）首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，此后的非首任基金经理的“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期。

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实全球房地产证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的

原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

### 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，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的，合计 9 次，均为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

### 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

2024 年上半年随着美国实际利率窄幅波动，全球 REITs 净值小幅下跌。行业和区域配置方面，按区域继续超配北美和日本，按业态从主要超配数据中心转为主要超配住宅和医疗健康。从空置率等运营指标看，REITs 的资产质量在住宅、零售、工业、办公等多个业态都好于私人房地产。目前 REITs 和私人房地产资本化率利差为 REITs 投资者提供了一个相对增配的机会。

美国商业地产交易量在 6 月底仍低迷但有望年内见底。商业地产整体价格继续下行，但幅度趋缓。各个业态呈现分化走势：

- 美国办公楼空置率仍在上升，地产抵押贷款推迟到期情况增加，仍需谨慎。
- 美国住宅空置率在历史底部位置，新开工从高位开始下行，二手房供应依然短缺。
- 美国长者公寓稳定入住率和租金稳定改善。未来长者公寓供给走低，而未来需求持续增长到 2050 年。
- 美国仓储物流供需情况短期平淡，但基本面扎实，其成长将由电子商务和近岸外包进一步推动。工业地产完工量已过高峰，租金稳定增长。
- 生成式人工智能推动美国数据中心需求。目前领先的美国科技公司的资本支出和研发占运营现金流比重目前为 72%（并且随着盈利成长已经小幅下降），而 40 年的中位数为 67%。

有利因素：1) 美国经济数据表现出韧性，投资者对于硬着陆的担心下降。2) 美元利率回到

历史长期平均附近，美元利率的正常化有助于抑制房地产行业新增供给。3) 机构投资人在 REITs 持仓水平为低配而且 REITs 相对标普 500 指数估值有折价。

风险因素：如果通胀和增长数据意外上升，导致利率上升或地区银行业担忧卷土重来，可能将 REITs 的估值压低。此外，特朗普赢得美国总统大选的概率上升，市场可能需要消化通胀重新加速和美债收益率曲线趋陡的风险。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.055 元；本报告期基金份额净值增长率为-1.57%，业绩比较基准收益率为-2.21%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

长期以来，全球 REITs 配置一直是构建多资产投资组合的重要基石，为投资者提供通胀保护和多元化收益。全球 REITs 和房地产长期表现高度相关，而 REITs 流动性更好，并且灵活提供多种业态资产敞口，例如数据中心、仓储物流、医疗保健、预制房屋、房车营地等。REITs 拥有房地产现金流，但短期会经历类似股票的估值波动和回撤。全球 REITs 应在投资者的房地产配置中占有一席之地；REITs 和直接持有的房地产或私人房地产基金相结合，可以改善风险调整后回报状况。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照《企业会计准则》及中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于基金资产估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。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。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，研究、指导基金估值业务。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，具备投研、风险管理、基金估值运作、法律合规等方面的专业胜任能力。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制，与估值相关的机构包括基金投资市场的证券交易场所以及境内相关机构等。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期，本基金实施了利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。

#### 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

报告期内，本基金存在连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，时间范围为 2024 年 4 月 3 日至 2024 年 6 月 30 日；本基金存在连续 60 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，

时间范围为2024年1月1日至2024年3月27日；未出现连续20个工作日基金份额持有人数量不满两百人的情形。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

## § 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—嘉实基金管理有限公司2024年01月01日至2024年06月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为，嘉实基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人认为，嘉实基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

## § 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：嘉实全球房地产证券投资基金

报告截止日：2024年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	962,888.99	2,080,317.30

结算备付金		4,541.35	-
存出保证金		117.99	23.78
交易性金融资产	6.4.7.2	32,982,735.81	36,109,624.01
其中：股票投资		31,260,017.81	35,906,784.56
基金投资		-	-
债券投资		1,722,718.00	202,839.45
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		48,751.71	-
应收股利		111,844.66	138,990.03
应收申购款		40,473.51	217,525.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	48,281.93	-
资产总计		34,199,635.95	38,546,480.52
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		320,403.66	383,551.81
应付管理人报酬		46,517.58	53,313.43
应付托管费		9,577.16	10,976.27
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	89,277.12	80,809.88
负债合计		465,775.52	528,651.39
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	31,960,297.07	35,128,028.94
未分配利润	6.4.7.12	1,773,563.36	2,889,800.19

净资产合计		33,733,860.43	38,017,829.13
负债和净资产总计		34,199,635.95	38,546,480.52

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.055 元，基金份额总额 31,960,297.07 份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉实全球房地产证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-256,057.22	3,187,157.11
1. 利息收入		18,248.55	9,178.40
其中：存款利息收入	6.4.7.13	17,762.73	9,178.40
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		485.82	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,326,745.82	-202,083.41
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,901,994.18	-1,024,505.22
基金投资收益	6.4.7.15	-	-
债券投资收益	6.4.7.16	24,168.36	2,603.50
资产支持证券投资	6.4.7.17	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	551,080.00	819,818.31
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	1,024,586.47	3,333,515.91
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-4,528.48	39,770.84
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	32,382.06	6,775.37
<b>减：二、营业总支出</b>		398,378.81	456,450.72
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	296,085.87	329,108.83
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	60,958.79	67,757.69
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.24	41,334.15	59,584.20
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-654,436.03	2,730,706.39
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-654,436.03	2,730,706.39
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-654,436.03	2,730,706.39

### 6.3 净资产变动表

会计主体：嘉实全球房地产证券投资基金

本报告期：2024年1月1日至2024年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	35,128,028.94	-	2,889,800.19	38,017,829.13
二、本期期初净资产	35,128,028.94	-	2,889,800.19	38,017,829.13
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,167,731.87	-	-1,116,236.83	-4,283,968.70
（一）、综合收益总额	-	-	-654,436.03	-654,436.03
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-3,167,731.87	-	-118,335.38	-3,286,067.25
其中：1. 基金申购款	25,236,366.60	-	1,187,816.36	26,424,182.96
2. 基金赎回款	-28,404,098.47	-	-1,306,151.74	-29,710,250.21
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资	-	-	-343,465.42	-343,465.42

产减少以“-”号填列)				
四、本期期末净资产	31,960,297.07	-	1,773,563.36	33,733,860.43
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	38,547,004.95	-	422,263.52	38,969,268.47
二、本期期初净资产	38,547,004.95	-	422,263.52	38,969,268.47
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	11,978,110.86	-	3,297,068.65	15,275,179.51
(一)、综合收益总额	-	-	2,730,706.39	2,730,706.39
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	11,978,110.86	-	822,039.17	12,800,150.03
其中：1. 基金申购款	20,201,756.59	-	1,083,668.64	21,285,425.23
2. 基金赎回款	-8,223,645.73	-	-261,629.47	-8,485,275.20
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-255,676.91	-255,676.91
四、本期期末净资产	50,525,115.81	-	3,719,332.17	54,244,447.98

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：

经雷

基金管理人负责人

梁凯

主管会计工作负责人

李袁

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

嘉实全球房地产证券投资基金(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[2012]320号《关于核准嘉实全球房地产证券投资基金募集的批复》核准,由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《嘉实全球房地产证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定。经向中国证监会备案,《嘉实全球房地产证券投资基金基金合同》于2012年7月24日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为835,974,696.22份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司,境外资产托管人为摩根大通银行。

### 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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<年度报告和中期报告>》、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》、《嘉实全球房地产证券投资基金基金合同》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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,开放式基金在基金合同生效后,连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。于2024年6月30日,本基金出现连续60个工作日基金资产净值低于5,000万元的情形,本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案,故本财务报表仍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本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和净资产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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金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

本基金本报告期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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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。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其他收益，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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	962,888.99
等于：本金	962,815.16
加：应计利息	73.83
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	962,888.99

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	28,740,993.61	-	31,260,017.81	2,519,024.20	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,704,554.29	18,688.00	1,722,718.00	-524.29
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,704,554.29	18,688.00	1,722,718.00	-524.29
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	30,445,547.90	18,688.00	32,982,735.81	2,518,499.91	

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

###### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

## 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

## 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

## 6.4.7.4 买入返售金融资产

## 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

## 6.4.7.5 债权投资

## 6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

## 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应收利息	-
其他应收款	48,281.93

待摊费用	-
合计	48,281.93

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	743.85
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	39,781.56
其他	48,751.71
合计	89,277.12

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	35,128,028.94	35,128,028.94
本期申购	25,236,366.60	25,236,366.60
本期赎回（以“-”号填列）	-28,404,098.47	-28,404,098.47
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	31,960,297.07	31,960,297.07

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 6.4.7.12 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	1,411,424.72	1,478,375.47	2,889,800.19
本期期初	1,411,424.72	1,478,375.47	2,889,800.19
本期利润	-1,679,022.50	1,024,586.47	-654,436.03
本期基金份额交易产生	-2,328.34	-116,007.04	-118,335.38

的变动数			
其中：基金申购款	-832,907.70	2,020,724.06	1,187,816.36
基金赎回款	830,579.36	-2,136,731.10	-1,306,151.74
本期已分配利润	-343,465.42	-	-343,465.42
本期末	-613,391.54	2,386,954.90	1,773,563.36

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入		17,709.08
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		53.01
其他		0.64
合计		17,762.73

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		-1,901,994.18
股票投资收益——赎回差价收入		-
股票投资收益——申购差价收入		-
股票投资收益——证券出借差价收入		-
合计		-1,901,994.18

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额		45,389,838.26
减：卖出股票成本总额		47,215,315.17
减：交易费用		76,517.27
买卖股票差价收入		-1,901,994.18

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 6.4.7.15 基金投资收益

无。

## 6.4.7.16 债券投资收益

## 6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	10,341.52
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	13,826.84
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	24,168.36

## 6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	8,113,122.78
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	8,093,828.54
减：应计利息总额	5,467.40
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	13,826.84

## 6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.17 资产支持证券投资收益

## 6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

## 6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.18 贵金属投资收益

## 6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.19 衍生工具收益

## 6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	551,080.00
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	551,080.00

## 6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	1,024,586.47
股票投资	1,024,906.76
债券投资	-320.29
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
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预估增值税	-
合计	1,024,586.47

#### 6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	32,378.36
其他	3.70
合计	32,382.06

#### 6.4.7.23 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	14,918.54
信息披露费	24,863.02
证券出借违约金	-
银行划款手续费	1,339.12
其他	213.47
合计	41,334.15

注：自2024年7月4日起，本基金处于“迷你基金”期间的信息披露费、审计费等费用由本基金的基金管理人承担。

#### 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

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司（“嘉实基金”）	基金管理人
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人
JPMorgan Chase Bank, National Association（“摩	境外资产托管人

根大通银行” )

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 6.4.10.1.4 基金交易

无。

###### 6.4.10.1.5 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	296,085.87	329,108.83
其中：应支付销售机构的客户维护费	100,027.63	110,954.28
应支付基金管理人的净管理费	196,058.24	218,154.55

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.70%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×1.70%/当年天数。

2. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年
----	------------------------	----------------------------

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	60,958.79	67,757.69

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.35% 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 × 0.35% / 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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.10.5.2 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。

#### 6.4.10.6 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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司_活期	729,642.39	17,709.08	16,349,972.09	9,177.62
摩根大通银行_活期	233,246.60	-	1,428,040.13	-

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份 额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分 配合计	备注
		场内	场外					
1	2024 年 1 月 16 日	-	2024 年 1 月 15 日	0.1010	207,735.72	135,729.70	343,465.42	2023 年 年度收 益分配 于 2024 年实施
合计	-	-	-	0.1010	207,735.72	135,729.70	343,465.42	-

#### 6.4.12 期末（2024 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。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

本基金为股票型基金，主要投资于以 REITs 为代表的全球房地产证券，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的基金品种。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。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主要投资于全球房地产证券，在严格控制投资风险和保障资产流动性的基础上，力争长期、持续战胜业绩比较基准，为国内投资者分享全球房地产相对稳定的现金流收益和资本增值收益。本基金的基金管理人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和风险管理制，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

公司建立包括董事会、管理层、各部门及一线员工组成的四道风控防线，还有董事会风险控制与内审委员会、公司风险控制委员会、督察长及其合规管理部门、风险管理部门，评估各项风险并提出防控措施并有效执行。

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。

基金的银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均与授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算或通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	1,722,718.00	202,839.45
未评级	-	-
合计	1,722,718.00	202,839.45

注：评级取自第三方评级机构。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人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。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 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相关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、流通受限制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。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%。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%(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上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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。

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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	962,888.99	-	-	-	962,888.99
结算备付金	4,541.35	-	-	-	4,541.35
存出保证金	117.99	-	-	-	117.99
交易性金融资产	1,722,718.00	-	-	31,260,017.81	32,982,735.81
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	48,751.71	48,751.71
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	111,844.66	111,844.66
应收申购款	-	-	-	40,473.51	40,473.51
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	48,281.93	48,281.93
资产总计	2,690,266.33	-	-	31,509,369.62	34,199,635.95
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	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	320,403.66	320,403.66
应付管理人报酬	-	-	-	46,517.58	46,517.58
应付托管费	-	-	-	9,577.16	9,577.16
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-

应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	89,277.12	89,277.12
负债总计	-	-	-	465,775.52	465,775.52
利率敏感度缺口	2,690,266.33	-	-	31,043,594.10	33,733,860.43
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,080,317.30	-	-	-	2,080,317.30
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	23.78	-	-	-	23.78
交易性金融资产	202,839.45	-	-	35,906,784.56	36,109,624.01
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	138,990.03	138,990.03
应收申购款	-	-	-	217,525.40	217,525.40
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,283,180.53	-	-	36,263,299.99	38,546,480.52
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	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	383,551.81	383,551.81
应付管理人报酬	-	-	-	53,313.43	53,313.43
应付托管费	-	-	-	10,976.27	10,976.27
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	80,809.88	80,809.88
负债总计	-	-	-	528,651.39	528,651.39
利率敏感度缺口	2,283,180.53	-	-	35,734,648.60	38,017,829.13

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

## 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利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影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	市场利率上升 25 个基点	-2,101.38	-161.38
市场利率下降 25 个基点	2,106.84	161.64	

## 6.4.13.4.2 外汇风险

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

## 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	589,597.74	-	3.68	589,601.42
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	26,222,251.93	-	5,037,765.88	31,260,017.81
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	82,087.40	-	29,757.26	111,844.66
应收申购款	-	-	-	-

应收清算款	-	-	48,751.71	48,751.71
其他资产	48,281.93	-	-	48,281.93
资产合计	26,942,219.00	-	5,116,278.53	32,058,497.53
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
其他负债	-	-	48,751.71	48,751.71
负债合计	-	-	48,751.71	48,751.71
资产负债表外汇风险敞口净额	26,942,219.00	-	5,067,526.82	32,009,745.82
项目	上年度末 2023年12月31日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	974,830.89	-	-	974,830.89
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	26,849,524.36	303,076.21	8,754,183.99	35,906,784.56
衍生金融资产	-	-	-	-

债权投资	-	-	-	-
应收股利	82,824.88	-	56,165.15	138,990.03
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	27,907,18 0.13	303,076.21	8,810,349.14	37,020,605.48
以外币计价的 负债				
应付清算款	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报 酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务 费	-	-	-	-
应付投资顾问 费	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	27,907,18 0.13	303,076.21	8,810,349.14	37,020,605.48

#### 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 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月 31日）
	所有外币相对人民 币升值 5%	1,600,487.29	1,851,030.27
所有外币相对人民 币贬值 5%	-1,600,487.29	-1,851,030.27	

### 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。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、债券及基金，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。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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，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 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例(%)	公允价值	占基金资产净值 比例(%)
交易性金融资产—股票投资	31,260,017.81	92.67	35,906,784.56	94.45
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	31,260,017.81	92.67	35,906,784.56	94.45

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准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影响金额(单位：人民币元)	
		本期末(2024年6月30日)	上年度末(2023年12月31日)
	业绩比较基准上升5%		1,304,793.30
业绩比较基准下降5%		-1,304,793.30	-1,796,433.78

## 6.4.14 公允价值

### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	31,260,017.81	35,906,784.56
第二层次	1,722,718.00	202,839.45
第三层次	-	-
合计	32,982,735.81	36,109,624.01

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债(上年度末：无)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

## 6.4.15 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	31,260,017.81	91.40
	其中：普通股	1,819,094.95	5.32
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	29,440,922.86	86.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,722,718.00	5.04
	其中：债券	1,722,718.00	5.04
	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	967,430.34	2.83
8	其他各项资产	249,469.80	0.73
9	合计	34,199,635.95	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	26,222,251.93	77.73
日本	5,037,765.88	14.93
合计	31,260,017.81	92.67

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
房地产	1,819,094.95	5.39
房地产信托住宅类	7,301,396.83	21.64
房地产信托特殊类	3,909,694.99	11.59
房地产信托零售类	4,992,917.35	14.80

房地产信托多元化类	3,049,647.98	9.04
房地产信托医疗保健类	4,977,297.97	14.75
房地产信托酒店及度假村类	1,407,837.75	4.17
房地产信托数据中心类	3,328,911.18	9.87
房地产信托自主仓储类	473,218.81	1.40
合计	31,260,017.81	92.67

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

#### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (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	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	纽约证 券交易 所	美国	3,086	3,338,583.67	9.90
2	Digital Realty Trust Inc	数字房 地产信 托有限 公司	DLR UN	纽约证 券交易 所	美国	3,072	3,328,911.18	9.87
3	Iron Mountain Inc	美国铁 山公司	IRM UN	纽约证 券交易 所	美国	5,157	3,293,795.58	9.76
4	AvalonBay Communiti es Inc	Avalon Bay 社 区股份 有限公 司	AVB UN	纽约证 券交易 所	美国	2,226	3,282,156.09	9.73
5	Welltower Inc	Wellto wer Inc	WELL UN	纽约证 券交易 所	美国	4,387	3,259,404.56	9.66
6	Japan Hotel REIT Investmen t Corp	日本酒 店 REIT 投资公 司	8985 JT	日本证 券交易 所	日本	405	1,407,837.75	4.17
7	Essex Property Trust Inc	埃塞克 斯房地 产信托 公司	ESS UN	纽约证 券交易 所	美国	716	1,388,979.11	4.12
8	American Homes 4	Americ an	AMH UN	纽约证 券交易	美国	4,688	1,241,531.89	3.68

	Rent	Homes 4 Rent		所				
9	Essential Properties Realty Trust Inc	Essential Properties 房地产信托股份有限公司	EPRT UN	纽约证券交易所	美国	6,273	1,238,814.80	3.67
10	Nomura Real Estate Holdings Inc	野村不动产控股	3231 JT	日本证券交易所	日本	5,100	919,728.28	2.73
11	Daiwa House REIT Investment Corp	大和房屋 REIT 投资法人	8984 JT	日本证券交易所	日本	83	912,717.83	2.71
12	Activia Properties Inc	东急 Activa 不动产投资信托有限公司	3279 JT	日本证券交易所	日本	55	898,115.35	2.66
13	Alexandria Real Estate Equities Inc	亚历山大房地产股份有限公司	ARE UN	纽约证券交易所	美国	1,075	896,143.43	2.66
14	Mid-America Apartment Communities Inc	Mid-America Apartment Communities 股份有限公司	MAA UN	纽约证券交易所	美国	731	742,954.00	2.20
15	Tokyo Tatemono Co Ltd	东京建物有限公司	8804 JT	日本证券交易所	日本	6,150	698,577.16	2.07
16	Agree Realty Corp	艾格里不动产公司	ADC UN	纽约证券交易所	美国	1,471	649,349.40	1.92

17	UDR Inc	UDR 公司	UDR UN	纽约证券交易所	美国	2,202	645,775.74	1.91
18	Federal Realty Investment Trust	联邦房地产投资信托公司	FRT UN	纽约证券交易所	美国	888	638,998.58	1.89
19	Lamar Advertising Co	拉马尔广告公司	LAMR UW	纳斯达克证券交易所	美国	723	615,899.41	1.83
20	Sabra Health Care REIT Inc	Sabra 医疗保健房地产投资信托公司	SBRA UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,425	485,655.79	1.44
21	CubeSmart	CubeSmart	CUBE UN	纽约证券交易所	美国	1,470	473,218.81	1.40
22	Macerich Co/The	Macerich 公司	MAC UN	纽约证券交易所	美国	3,326	365,985.70	1.08
23	Ventas Inc	Ventas 公司	VTR UN	纽约证券交易所	美国	920	336,094.19	1.00
24	Mitsubishi Estate Co Ltd	三菱地所	8802 JT	日本证券交易所	日本	1,781	200,789.51	0.60

注：本表所使用的证券代码为彭博代码。

## 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

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	Iron Mountain Inc	IRM UN	3,107,671.64	8.17
2	American Tower Corp	AMT UN	2,800,036.33	7.37
3	Mitsubishi Estate Co Ltd	8802 JT	2,792,344.00	7.34
4	AvalonBay Communities Inc	AVB UN	2,502,369.77	6.58
5	Digital Realty Trust Inc	DLR UN	2,310,149.51	6.08
6	Welltower Inc	WELL UN	2,252,169.81	5.92

7	Simon Property Group Inc	SPG UN	1,910,829.10	5.03
8	Japan Hotel REIT Investment Corp	8985 JT	1,530,282.64	4.03
9	Equinix Inc	EQIX UW	1,328,293.75	3.49
10	Essex Property Trust Inc	ESS UN	1,284,037.09	3.38
11	Essential Properties Realty Trust Inc	EPRT UN	1,168,426.02	3.07
12	Mitsui Fudosan Co Ltd	8801 JT	1,104,139.95	2.90
13	Ventas Inc	VTR UN	1,103,172.92	2.90
14	Tokyo Tatemono Co Ltd	8804 JT	1,045,608.56	2.75
15	Activia Properties Inc	3279 JT	1,013,405.24	2.67
16	Daiwa House REIT Investment Corp	8984 JT	1,005,096.33	2.64
17	Nomura Real Estate Holdings Inc	3231 JT	1,001,863.82	2.64
18	Agree Realty Corp	ADC UN	990,840.62	2.61
19	Sun Communities Inc	SUI UN	963,816.51	2.54
20	Alexandria Real Estate Equities Inc	ARE UN	917,389.96	2.41
21	SBA Communications Corp	SBAC UW	850,116.49	2.24
22	CubeSmart	CUBE UN	821,955.18	2.16

### 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	Equinix Inc	EQIX UW	2,916,128.48	7.67
2	Prologis Inc	PLD UN	2,876,180.53	7.57
3	American Tower Corp	AMT UN	2,733,087.46	7.19
4	Mitsubishi Estate Co Ltd	8802 JT	2,713,671.40	7.14
5	Realty Income Corp	O UN	1,880,866.90	4.95
6	STAG Industrial Inc	STAG UN	1,128,924.21	2.97
7	Mid-America Apartment Communities Inc	MAA UN	1,126,542.23	2.96
8	Mitsui Fudosan Co Ltd	8801 JT	1,120,011.52	2.95

9	VICI Properties Inc	VICI UN	1,091,370.79	2.87
10	Public Storage	PSA UN	1,091,295.05	2.87
11	Invitation Homes Inc	INVH UN	1,023,610.07	2.69
12	Sun Communities Inc	SUI UN	918,658.23	2.42
13	Kite Realty Group Trust	KRG UN	847,258.08	2.23
14	SBA Communications Corp	SBAC UW	792,918.16	2.09
15	Ventas Inc	VTR UN	749,610.12	1.97
16	Tanger Inc	SKT UN	705,380.87	1.86
17	KDX Realty Investment Corp	8972 JT	682,912.86	1.80
18	Boardwalk Real Estate Investment Trust	BEI-U CT	670,356.97	1.76
19	Apple Hospitality REIT Inc	APLE UN	643,278.00	1.69
20	Camden Property Trust	CPT UN	623,137.01	1.64

### 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	41,543,641.66
卖出收入（成交）总额	45,389,838.26

注：7.5.1 项“买入金额”、7.5.2 项“卖出金额”及 7.5.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（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

金额单位：人民币元

债券信用等级	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
AAA	-	-
AA+	-	-
A+	1,722,718.00	5.11
A	-	-
A-	-	-
BBB+	-	-
BBB	-	-
BBB-	-	-
BB+	-	-
BB	-	-
BB-	-	-
B+	-	-
B	-	-

B-	-	-
CCC+	-	-
CCC	-	-
CCC-	-	-

注：本基金持有的债券主要采用国际权威评级机构（标普、惠誉、穆迪等）提供的债券信用评级信息，上述机构未提供评级信息的债券采用内部评级。

### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019733	24 国债 02	1,100,000	1,111,803.75	3.30
2	019727	23 国债 24	600,000	610,914.25	1.81

注：（1）报告期末，本基金仅持有上述 2 只债券；（2）数量列示债券面值，以外币计价的债券面值按照期末中国人民银行公布的人民币兑外币汇率中间价折算为人民币。

### 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

无。

### 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

无。

### 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

无。

### 7.11 投资组合报告附注

#### 7.11.1 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

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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 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

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

#### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	117.99
2	应收清算款	48,751.71
3	应收股利	111,844.66
4	应收利息	-
5	应收申购款	40,473.51
6	其他应收款	48,281.93

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	249,469.80

#### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 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 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 (%)
7,789	4,103.26	231.09	0.00	31,960,065.98	100.00

### 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	961,929.95	3.01

### 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 (2012 年 7 月 24 日) 基金份额总额	835,974,696.22
本报告期期初基金份额总额	35,128,028.94
本报告期基金总申购份额	25,236,366.60
减：本报告期基金总赎回份额	28,404,098.47
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	31,960,297.07

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

本报告期内，基金管理人无重大人事变动情况。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。

### 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

#### 10.6.1 管理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无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
花旗环球金融亚洲有限公司 Citigroup	-	10,567,921.32	12.25	3,236.32	4.44	-

Global Markets Asia Limited						
极讯欧洲有限公司 Instinet Europe Limited	-	1,348,041.90	1.56	1,686.23	2.31	-
摩根大通证券(亚太)有限公司 J.P.Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	9,831,424.40	11.40	6,707.02	9.19	新增
元大证券(香港)有限公司 Yuanta Securities (Hong Kong) Company Limited	-	14,282,724.88	16.56	28,565.55	39.15	新增
野村证券 NOMURA	-	1,640,950.17	1.90	470.78	0.65	-
中国国际金融香港证券有限公司 China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	-	9,086,009.62	10.53	3,363.81	4.61	新增
瑞银集团	-	100,274.14	0.12	117.71	0.16	新增

Union Bank of Switzerland						
法国巴黎证券(亚洲)有限公司 BNP PARIBAS Securities (Asia) Limited	-	16,912.42	0.02	33.82	0.05	新增
美林证券公司 Bank of America Merrill Lynch	-	25,024,057.31	29.01	17,516.73	24.01	-
富瑞金融集团 Jefferies Hong Kong Limited	-	3,274,896.08	3.80	4,912.31	6.73	新增
招商证券(香港)有限公司 China Merchants Securities (HK) Co., Ltd.	-	4,346,730.45	5.04	2,606.52	3.57	新增
里昂证券有限公司 CLSA Limited	-	742,622.94	0.86	2,229.40	3.06	-
香港上海汇丰银行有限公司 The Hongkong and Shanghai Bank	-	6,010,725.06	6.97	1,515.72	2.08	-

ing Corporation Limited						
德意志银行股份有限公司 Deutsche Bank	-	-	-	-	-	-
建银国际证券有限公司 CCB International Securities Limited	-	-	-	-	-	-
金贝塔证券有限公司 iGoldenbeta Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-
联昌证券有限公司 CIMB Securities Limited	-	-	-	-	-	-
麦格理资本证券股份有限公司 Macquarie Securities Group	-	-	-	-	-	-
美林(亚太)有限公司 Merrill Lynch (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-

摩根士丹利亚洲有限公司 Morgan Stanley Asia Limited	-	-	-	-	-	-
瑞士信贷(香港)有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-
瑞穗证券亚洲有限公司 Mizuho Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-
盛博香港有限公司 Sanford C. Bernstein (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-
星展唯高达香港有限公司 DBS Vickers (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-
野村国际(香港)有限公司 Nomura International (Hong Ko	-	-	-	-	-	-

ng) Limited						
中国银河 证券股份 有限公司 China Galaxy International Financials Holdings	-	-	-	-	-	-
中泰国际 证券有限 公司 ZHONGTAI INTERNATIONAL SECURITIES LIMITED	-	-	-	-	-	-
中信建投 (国际)证 券有限公 司 China Securities (International) Brokerage Company Limited	-	-	-	-	-	-
中银国际 证券有限 公司 BOCI Securities Limited	-	-	-	-	-	-
麦格理银 行有限公 司香港分 行 Macquaire Bank Limited Hong K	-	-	-	-	-	-

ong Branch.						
华兴证券 有限公司 China Renaissance Securities	-	-	-	-	-	-
富国证券 Wells Fargo Securities LLC	-	-	-	-	-	新增
中信证券 CITIC Securities Co., Ltd	-	-	-	-	-	新增
花旗环球 金融亚洲 有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited	-	-	-	-	-	-

注：1. 本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

## 2. 交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范；
- (2) 财务状况良好；
- (3) 研究能力较强；

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

## 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		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当	成交	占当	成交	占当	成交	占当

		期 金 额	期 金 额	期 金 额	期 金 额	期 金 额	期 金 额	期 金 额
		券 成 交 总 额 的 比 例 (%)	回 购 成 交 总 额 的 比 例 (%)	证 成 交 总 额 的 比 例 (%)	成 交 总 额 的 比 例 (%)	成 交 总 额 的 比 例 (%)	成 交 总 额 的 比 例 (%)	成 交 总 额 的 比 例 (%)
花旗环球金融亚洲有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
极讯欧洲有限公司 Instinet Europe Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券 (亚太) 有限公司 J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
元大证券 (香港) 有限公司 Yuanta Securities (Hong Kong) Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
野村证券 NOMURA	-	-	-	-	-	-	-	-
中国国际金融香港证券有限公司 China International Capital Corporation H ong Kong Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银集团 Union Bank of Switzerland	-	-	-	-	-	-	-	-
法国巴黎证券 (亚洲) 有限公司 BNP PARIBAS Securities (Asia) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
美林证券公司 Bank of America Merrill Lynch	-	-	-	-	-	-	-	-
富瑞金融集团 Jefferies Hong Kong Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券 (香港) 有限公司 China Merchants Securities (HK) Co., Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
里昂证券有限公司 CLSA Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
香港上海汇丰银行有限公司 The Hongkong and Shanghai Banking Corpor ation Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
德意志银行股份有限公司 Deutsche Bank	-	-	-	-	-	-	-	-
建银国际证券有限公司 CCB International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
金贝塔证券有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-

iGoldenbeta Securities Company Limited								
联昌证券有限公司 CIMB Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
麦格理资本证券股份有限公司 Macquarie Securities Group	-	-	-	-	-	-	-	-
美林 (亚太) 有限公司 Merrill Lynch (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
摩根士丹利亚洲有限公司 Morgan Stanley Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞士信贷 (香港) 有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞穗证券亚洲有限公司 Mizuho Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
盛博香港有限公司 Sanford C. Bernstein (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
星展唯高达香港有限公司 DBS Vickers (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
野村国际 (香港) 有限公司 Nomura International (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司 China Galaxy International Financials Holdings	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰国际证券有限公司 ZHONGTAI INTERNATIONAL SECURITIES LIMITED	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投 (国际) 证券有限公司 China Securities (International) Brokerage Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际证券有限公司 BOCI Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
麦格理银行有限公司香港分行 Macquarie Bank Limited Hong Kong Branch.	-	-	-	-	-	-	-	-
华兴证券有限公司 China Renaissance Security	-	-	-	-	-	-	-	-
富国证券 Wells Fargo Securities LLC	11,339,593.90	81.27	-	-	-	-	-	-
中信证券 CITIC Securities Co., Ltd	1,905,091.00	13.65	-	-	-	-	-	-
花旗环球金融亚洲有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited	709,009.31	5.08	-	-	-	-	-	-

## 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	关于嘉实全球房地产 (QDII) 2024 年 1 月 15 日暂停申购、赎回及定投业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 11 日
2	嘉实全球房地产证券投资基金 2023 年第三次收益分配公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 12 日

3	关于嘉实全球房地产(QDII)2024年1月26日暂停申购、赎回及定投业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024年1月24日
4	关于嘉实全球房地产(QDII)2024年2月19日暂停申购、赎回及定投业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024年2月7日
5	关于嘉实全球房地产(QDII)2024年3月29日、4月1日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024年3月27日
6	关于嘉实全球房地产(QDII)2024年4月25日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024年4月23日
7	关于嘉实全球房地产(QDII)2024年5月15日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024年5月13日
8	关于嘉实全球房地产(QDII)2024年5月20日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024年5月16日
9	关于嘉实全球房地产(QDII)2024年5月27日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024年5月23日
10	关于嘉实全球房地产(QDII)2024年6月19日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024年6月17日
11	嘉实全球房地产证券投资基金暂停大额申购(含定期定额投资)业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024年6月27日
12	关于嘉实全球房地产(QDII)2024年7月1日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024年6月28日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会核准嘉实全球房地产证券投资基金募集的文件；
- (2) 《嘉实全球房地产证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实全球房地产证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实全球房地产证券投资基金招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实全球房地产证券投资基金公告的各项原稿。

## 11.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街21号北京国际俱乐部C座写字楼12A层嘉实基金管理有限公司

## 11.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2024年8月30日