

# 嘉实全球房地产证券投资基金 2019 年半年 度报告

2019 年 06 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：2019 年 08 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

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2019年8月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至2019年6月30日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	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
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	38
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	39
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.....	39
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	46
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	48

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 .....	48
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前所有资产支持证券投资明细 .....	48
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 .....	48
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....	48
7.11 投资组合报告附注.....	49
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>49</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	50
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>50</b>
<b>§ 10 重大事件揭示.....</b>	<b>50</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
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 .....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	51
10.8 其他重大事件.....	55
<b>§ 11 备查文件目录.....</b>	<b>56</b>
11.1 备查文件目录.....	56
11.2 存放地点.....	57
11.3 查阅方式.....	57

## § 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	31,908,047.57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	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，结合境外投资顾问的全球房地产证券投资管理经验和各地区的团队，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。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为 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）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期53层09-11单元	北京东城区建国门内大街69号
办公地址	北京市建国门北大街8号华润大厦8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	100005	100031
法定代表人	经雷	周慕冰

## 2.4 境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	中文	摩根大通银行
	英文	JPMorgan Chase Bank, National Association
注册地址		1111 Polaris Parkway, Columbus, OH 43240, U. S. A.
办公地址		270 Park Avenue, New York, New York 10017
邮政编码		10017

## 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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a>
基金半年度报告备置地点	北京市建国门北大街8号华润大厦8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	北京市建国门北大街8号华润大厦8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(2019年01月01日-2019年06月30日)
本期已实现收益	1,319,596.14
本期利润	4,594,933.43
加权平均基金份额本期利润	0.1679
本期加权平均净值利润率	14.27%
本期基金份额净值增长率	18.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年06月30日)
期末可供分配利润	1,357,897.70
期末可供分配基金份额利润	0.0426
期末基金资产净值	38,867,873.18
期末基金份额净值	1.218
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年06月30日)
基金份额累计净值增长率	50.73%

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

扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；（2）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

（3）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。

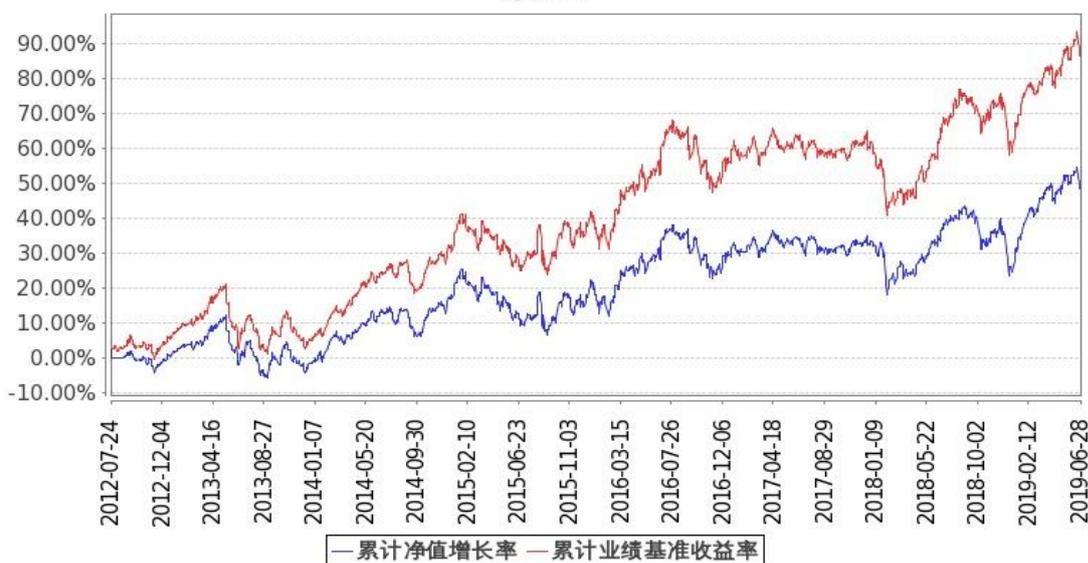
## 3.2 基金净值表现

### 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	0.16%	0.67%	1.54%	0.71%	-1.38%	-0.04%
过去三个月	1.70%	0.68%	3.35%	0.68%	-1.65%	0.00%
过去六个月	18.30%	0.68%	16.39%	0.66%	1.91%	0.02%
过去一年	10.31%	0.79%	13.96%	0.75%	-3.65%	0.04%
过去三年	12.78%	0.72%	17.88%	0.73%	-5.10%	-0.01%
自基金合同生效起至今	50.73%	0.74%	88.83%	0.75%	-38.10%	-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

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



图：嘉实全球房地产(QDII)基金份额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7月24日至2019年6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个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同（十四（三）投资范围和（八）投资禁止行为与限制2、基金投资组合比例限制）的有关约定。

## § 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

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司，成立于1999年3月25日，是经中国证监会批准设立的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，公司总部设在北京，在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和QDII、特定资产管理业务资格。

截止2019年6月30日，基金管理人共管理1只封闭式证券投资基金、154只开放式证券投资基金，具体包括嘉实元和、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深300ETF联接（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票（QDII）混合、嘉实研究精选混合、嘉

实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势混合、嘉实 H 股指数 (QDII)、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产 (QDII)、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数 (LOF)、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票 (QDII)、嘉实丰益策略定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝 A/B、嘉实活期宝货币、嘉实 1 个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券 A/E、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实快线货币、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航混合、嘉实新财富混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽混合 (LOF)、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实研究增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安 6 个月定期债券、嘉实稳元纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实稳熙纯债债券、嘉实丰和混合、嘉实新添华定期混合、嘉实定期宝 6 个月理财债券、嘉实现金添利货币、嘉实沪港深回报混合、嘉实原油 (QDII-LOF)、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实稳宏债券、嘉实中关村 A 股 ETF、嘉实稳华纯债债券、嘉实 6 个月理财债券、嘉实稳怡债券、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实创业板 ETF、嘉实新添泽定期混合、嘉实合润双债两年期定期债券、嘉实新添丰定期混合、嘉实新添辉定期混合、嘉实领航资产配置混合 (FOF)、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康股票、嘉实润泽量化定期混合、嘉实核心优势股票、嘉实润和量化定期混合、嘉实金融精选股票、嘉实新添荣定期混合、嘉实致兴定期纯债债券、嘉实战略配售混合、嘉实瑞享定期混合、嘉实新添康定期混合、嘉实资源精选股票、嘉实致盈债券、嘉实恒生港股通新经济指数 (LOF)、嘉实中短债债券、嘉实致享纯债债券、嘉实互通精选股票、嘉实互

融精选股票、嘉实养老 2040 混合 ( FOF)、嘉实消费精选股票、嘉实新添元定期混合、嘉实中债 1-3 政金债指数、嘉实养老 2050 混合 ( FOF)、嘉实长青竞争优势股票、嘉实科技创新混合、嘉实基本面 50ETF、嘉实稳联纯债债券、嘉实汇达中短债债券。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券属于嘉实理财通系列基金。同时,基金管理人还管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

#### 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		
蔡德森	本基金基金经理	2012年7月24日-		18年	曾任摩根大通高级会计师、索罗斯基金管理公司会计师、美国国际集团(AIG)子公司南山人寿保险股份有限公司资深投资经理。2008年12月加入嘉实基金管理有限公司。哥伦比亚大学房地产开发学硕士,CFA,具有基金从业资格,中国香港国籍。

注:(1)任职日期是指本基金基金合同生效之日;(2)证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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%,合计4次,均为旗下组合被动跟踪标的指数需要,与其

他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

#### 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

2019年上半年全球经济增速有所放缓，市场主要关注中美经贸磋商、华为美国禁令、美国总统特朗普与朝鲜最高领导人金正恩会谈、西班牙政府预算法案被否决使得西班牙面临四年里的第三次大选、MSCI 决定将 A 股大盘股纳入因子提高、大湾区发展规划、美债收益率曲线出现倒挂、美国称伊朗击落美军无人机、英国脱欧谈判和英国下任首相候选人、执政党印度人民党大选获胜等事件。

货币和财政政策方面，经济前景面临的不确定性增加，宽松信号上升。美联储维持利率不变，在政策声明中取消对利率政策保持“耐心”的表述，并下调对今年通胀水平的预测。此举暗示美联储准备进行十多年来的首次降息。美联储主席鲍威尔重申，经济前景面临的风险上升，使决策者更有理由在一定程度上下调利率。美国国会参议院民主党领袖称，国会民主党高层与总统特朗普针对基建计划就 2 万亿美元数目达成共识。未来将讨论特朗普关于基建融资的想法。加拿大央行维持基准利率在 1.75% 不变，表示国内经济正在改善，但贸易紧张局势的升级正在打压未来前景。欧洲央行放鸽，修改前瞻指引，维持利率水平至少到 2020 年上半年，公布 TLTRO 关键细节，每一次 TLTRO 操作的利率将设定为比欧元区主要再融资平均利率高出 10 个基点。欧央行行长德拉吉称，短期前景较预期更差且偏向下行，受地缘政治、保护主义和新兴市场脆弱的不确定性打压，央行或需加码刺激措施。英国央行维持基准利率不变，承认对无协议脱欧的担忧增强，而且经济面临的下行风险加大。瑞士央行维持超宽松货币政策，并引入新的政策利率以取代 Libor 区间。自去年 9 月加息开启了货币政策紧缩以来，挪威央行加息 50 个基点至 1.25%，表示今年很有可能还会加息。澳洲联储近三年来首次降息，降息 25 个基点至 1.25%，澳洲联储主席称未来利率或进一步下调。新西兰联储降息 25 个基点至 1.5%。印度年内第三次降息，货币政策立场由中性转为宽松，还下调了 2019 年经济增速预估，称整体通胀轨迹仍低于目标。日本央行维持政策利率在 -0.1%，符合预期。黑田东彦还称，央行有多种宽松的选择，如降息、加快购买国债，如需要可能综合使用。中国央行行长易纲表示，中美贸易谈判能否继续充满不确定性和困难，如果贸易战恶化，中国有足够的政策应对空间，并暗示人民币汇率没有红线。

发达经济体经济复苏势头放缓，下行压力日益凸显。世界银行半年度《全球经济展望》报告，将 2019 年全球经济增长预期下调 0.3 个百分点至 2.6%，1 月时曾预期 2.9%。IMF 上调美国经济增长预期至 2.6%，比两个月前的预测高出 0.3 个百分点，并维持 2020 年经济增速在 1.9% 不变。美国 6 月非农业就业人数月增 224,000 人、创 1 月以来最高增额，优于市场预期的 16.0 万人。美国

6月失业率上扬0.1个百分点至3.7%、高于市场预期的3.6%。美国6月非制造业采购经理人指数(PMI)自5月的56.9%降至55.1%、创2017年7月(55.1%)以来最低,逊于经济学家预期的55.9%。欧元区5月制造业PMI初值为47.7,低于预期的48.1,前值为47.9。欧元区5月CPI同比不及预期,降至逾一年以来新低。英国6月份通胀率持稳于2%的目标水平,核心通胀率也符合预期。英国3-5月期间的薪资增速达到2008年以来最快,失业率维持在1970年代中期以来的最低水平。中国二季度GDP同比6.2%,预期6.2%,前值6.4%。中国国家统计局新闻发言人毛盛勇称,今年全年GDP增速目标任务是6.0%-6.5%之间,上半年6.3%为实现全年目标奠定了较好的基础。

2019年上半年全球主要发达国家股市在波动中上涨。美国10年期国债收益率下降,上半年末收益率为2.006%,相比2018年末下跌67.91个基点。人民币贬值,在岸人民币兑美元6.8668,离岸人民币6.8679。受全球央行的鸽派态度和利率下降等因素影响,REITs在上半年波动中上涨,各地区表现不一。

考虑到中美经贸磋商的进展,央行的鸽派态度,房地产市场基本面在短期持平,REITs的价格处于较吸引水平,本基金对投资策略作出以下调整:一是在上半年维持房地产证券仓位在90%以上;二是在地区资产配置方面高配基本面相对向好和央行态度鸽派的地区如美国和澳大利亚;三是在业态资产配置方面低配零售的REITs;四是在证券选择上增加配置拥有优质资产、增长潜力、估值相对吸引的房地产证券。

#### 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1.218元;本报告期基金份额净值增长率为18.30%,业绩比较基准收益率为16.39%。

#### 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2019年下半年,全球经济不确定事件、不可预见性风险复杂严峻。中美和全球贸易战、美联储和欧央行量化宽松货币政策、英国脱欧进程等事件将仍是2019年下半年的关注点中心。IMF认为全球经济增长已超过峰值,将2019年世界增速预期下调,提示全球经济增长下行风险,称贸易紧张局势升级是风险主要来源。美联储降息概率上升;特朗普新政的执行情况能否如期实现、地缘政治局势、财政和货币政策等不确定因素将影响投资环境,增加美国10年期国债收益率的波动性。在房地产市场方面,机构投资者如主权基金,养老基金,保险公司等对房地产的投资性需求没有减少,而新供给在大部分市场仍然有限。过去几年房地产价格增长主要受利率下降和估值修复所带动,未来全球房地产投资的收益将更多取决于经济和租金增长。2019年仍然是REITs过渡的一年:一方面,财政政策加快经济复苏和通胀,推动全球REITs的现金流和估值提升,而风

险事件也有可能影响投资者对 REITs 资产配置的需求；另一方面，利率政策变化有可能对 REITs 价格增加波动风险。综上所述，我们对全球 REITs 市场的总体表现持谨慎乐观的态度。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构为美国、新加坡、加拿大、德国、挪威、香港、日本、英国、澳大利亚、法国等基金投资市场的证券交易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

(1) 本基金的基金管理人于 2019 年 1 月 14 日发布《嘉实全球房地产证券投资基金 2018 年第一次收益分配公告》，收益分配基准日为 2018 年 12 月 31 日，每 10 份基金份额发放现金红利 0.0100 元，具体参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。

(2) 本基金的基金管理人于 2019 年 4 月 12 日发布《嘉实全球房地产证券投资基金 2019 年第一次收益分配公告》，收益分配基准日为 2019 年 3 月 31 日，每 10 份基金份额发放现金红利 0.0640 元，具体参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。

(3) 本基金的基金管理人于 2019 年 7 月 11 日发布《嘉实全球房地产证券投资基金 2019 年第二次收益分配公告》，收益分配基准日为 2019 年 6 月 30 日，每 10 份基金份额发放现金红利 0.1070 元，具体参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。本基金的收益分配符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

#### 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 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 2019-01-01 至 2019-06-30，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。

鉴于基金资产净值的下滑主要受市场环境的影响，本基金将继续运作。

## § 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《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2019年1月1日至2019年6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《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

本托管人认为，嘉实基金管理有限公司的信息披露事务符合《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半年度报告中的财务指标、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：2019年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,856,633.94	1,312,768.97
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	37,109,424.84	22,976,550.63
其中：股票投资		36,197,085.08	22,976,550.63
基金投资		912,339.76	-
债券投资		-	-

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
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		-	4,082.71
应收利息	6.4.7.5	437.04	67.87
应收股利		207,982.95	80,844.13
应收申购款		221,913.87	39,230.82
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		40,396,392.64	24,413,545.13
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019年6月30日</b>	<b>上年度末 2018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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,433,899.89	240,901.60
应付管理人报酬		52,687.34	37,458.89
应付托管费		10,847.36	7,712.13
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		512.92	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	30,571.95	150,718.96
负债合计		1,528,519.46	436,791.58
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	31,908,047.57	23,146,711.32
未分配利润	6.4.7.10	6,959,825.61	830,042.23
所有者权益合计		38,867,873.18	23,976,753.55
负债和所有者权益总计		40,396,392.64	24,413,545.13

注：报告截止日2019年6月30日，基金份额净值1.218元，基金份额总额31,908,047.57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：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本 期	上年度可比期间
-----	-----	-----	---------

		2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入		5,001,733.78	982,855.57
1. 利息收入		6,541.53	1,681.17
其中：存款利息收入	6.4.7.11	6,541.53	1,681.17
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）		1,683,496.04	-914,040.70
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,089,325.58	-1,439,910.23
基金投资收益	6.4.7.13	56,508.72	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	537,661.74	525,869.53
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	3,275,337.29	1,912,252.37
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.21	9,049.28	-25,335.65
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	27,309.64	8,298.38
减：二、费用		406,800.35	460,750.42
1. 管理人报酬		269,801.41	259,993.21
2. 托管费		55,547.38	53,528.01
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	51,399.75	71,482.39
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		1,869.66	-
7. 其他费用	6.4.7.20	28,182.15	75,746.81
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		4,594,933.43	522,105.15
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,594,933.43	522,105.15

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实全球房地产证券投资基金

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)	23,146,711.32	830,042.23	23,976,753.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	4,594,933.43	4,594,933.43
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)	8,761,336.25	1,746,269.08	10,507,605.33
其中：1. 基金申购款	27,000,861.34	5,152,834.01	32,153,695.35
2. 基金赎回款	-18,239,525.09	-3,406,564.93	-21,646,090.02
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)	-	-211,419.13	-211,419.13
五、期末所有者权益(基金净值)	31,908,047.57	6,959,825.61	38,867,873.18
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)	32,702,020.07	2,920,464.99	35,622,485.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	522,105.15	522,105.15
三、本期基金份额交易产生的基	-5,294,543.88	-287,112.19	-5,581,656.07

金净值变动数 (净值减少以 “-”号填列)			
其中: 1. 基金申 购款	3,831,991.75	164,585.96	3,996,577.71
2. 基金赎 回款	-9,126,535.63	-451,698.15	-9,578,233.78
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)	-	-113,353.18	-113,353.18
五、期末所有者 权益(基金净值)	27,407,476.19	3,042,104.77	30,449,580.96

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

王红

张公允

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 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,首次设立募集不包括认购资金利息共募集835,863,168.94元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第277号验资报告予以验证。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,其中认购资金利息折合111,527.28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。

根据《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》的有关规定,本基金主要投资于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优质房地产投资信托收益凭证(以

下简称“REITs”)、投资于房地产投资信托凭证的交易型开放式指数基金和房地产行业上市公司股票等全球房地产证券,以及货币市场工具和法律法规、中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。此外,本基金为对冲外币的汇率风险,可以投资于外汇远期合约、结构性外汇远期合约、外汇期权及外汇期权组合、外汇互换协议、与汇率挂钩的结构性投资产品等金融工具。本基金资产配置范围是:投资于REITs的比例不低于基金资产的60%;现金或者到期日不超过一年的政府债券的投资比例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:

FTSE EPRA / NAREIT Developed REITs Total Return Index(经汇率调整后的)。

#### 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》、《嘉实全球房地产证券投资基金基金合同》和中国证监会、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。

#### 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 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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2014]81号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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）对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。（4）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。（5）基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。（6）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 2019年6月30日
活期存款	2,856,633.94
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月及以上	-
其他存款	-
合计	2,856,633.94

注：定期存款的存款期限指票面存期。

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	33,384,868.87	36,197,085.08	2,812,216.21
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	902,264.31	912,339.76	10,075.45
其他	-	-	-
合计	34,287,133.18	37,109,424.84	2,822,291.66

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末(2019年6月30日)，本基金未持有衍生金融资产/负债。

## 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

本期末(2019年6月30日)，本基金未持有买入返售金融资产。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末(2019年6月30日)，本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

## 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	436.91
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	0.13
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	437.04

#### 6.4.7.6 其他资产

本期末（2019年6月30日），本基金无其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

本期末（2019年6月30日），本基金无应付交易费用。

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4,699.85
预提费用	25,872.10
合计	30,571.95

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	23,146,711.32	23,146,711.32
本期申购	27,000,861.34	27,000,861.34
本期赎回（以“-”号填列）	-18,239,525.09	-18,239,525.09
本期末	31,908,047.57	31,908,047.57

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投。

#### 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	92,033.52	738,008.71	830,042.23
本期利润	1,319,596.14	3,275,337.29	4,594,933.43
本期基金份额交易产生的变动数	157,687.17	1,588,581.91	1,746,269.08
其中：基金申购款	532,826.37	4,620,007.64	5,152,834.01
基金赎回款	-375,139.20	-3,031,425.73	-3,406,564.93
本期已分配利润	-211,419.13	-	-211,419.13
本期末	1,357,897.70	5,601,927.91	6,959,825.61

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
----	----------------------------

活期存款利息收入	6,532.04
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	9.49
合计	6,541.53

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	11,693,710.35
减：卖出股票成本总额	10,589,083.00
减：买卖股票差价收入应缴纳增值税额	15,301.77
买卖股票差价收入	1,089,325.58

注：本期（2019年1月1日至2019年6月30日）“卖出股票成交总额”、“卖出股票成本总额”、“买卖股票差价收入应缴纳增值税额”、“买卖股票差价收入”包含投资“房地产信托凭证”（简称 REITs）的情况。

#### 6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	2,472,584.71
减：卖出/赎回基金成本总额	2,414,380.73
减：基金投资收益应缴纳增值税额	1,695.26
基金投资收益	56,508.72

#### 6.4.7.14 债券投资收益

本期（2019年1月1日至2019年6月30日），本基金无债券投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本期（2019年1月1日至2019年6月30日），本基金无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	528,606.95
基金投资产生的股利收益	9,054.79
合计	537,661.74

注：本期（2019年1月1日至2019年6月30日）“股票投资产生的股利收益”包含投资“房地产

信托凭证”(简称 REITs)产生的收益。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	3,275,337.29
股票投资	3,265,261.84
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	10,075.45
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	3,275,337.29

注：本期(2019年1月1日至2019年6月30日)“交易性金融资产—股票投资”包含投资房地产信托凭证(简称 REITs)的情况。

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	27,309.64
其他	-
合计	27,309.64

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	51,399.75
银行间市场交易费用	-
合计	51,399.75

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日

审计费用	24,795.19
信息披露费	1,076.91
银行划款手续费	1,622.36
其他	687.69
合计	28,182.15

#### 6.4.7.21 汇兑收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
汇兑收益	9,049.28
合计	9,049.28

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

2019年7月11日，本基金管理人发布《嘉实全球房地产证券投资基金2019年第二次收益分配公告》，收益分配基准日为2019年6月30日，权益登记日为2019年7月15日，除息日为2019年7月12日，红利发放日为2019年7月17日，收益分配方案为每10份基金份额派发现金红利0.1070元。

#### 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	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金代销机构
JPMorgan Chase Bank, National Association （摩根大通银行）	境外资产托管人

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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

本期（2019年1月1日至2019年6月30日）及上年度可比期间（2018年1月1日至2018年6月30日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

#### 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 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理费	269,801.41	259,993.21
其中：支付销售机构的客户维护费	90,401.12	79,047.90

注：支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.7%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：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.7% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.2 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	55,547.38	53,528.01

注：支付基金托管人中国农业银行的基金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：日基金托管费=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

本期（2019年1月1日至2019年6月30日）及上年度可比期间（2018年1月1日至2018年6月30日），本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期内（2019年1月1日至2019年6月30日）及上年度可比期间（2018年1月1日至2018年6月30日），基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

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

本期末（2019年6月30日）及上年度末（2018年12月31日），其他关联方未持有本基金。

**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 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
中国农业银行股份有限公司_活期	2,800,542.44	6,532.04	1,396,834.04	1,665.40
摩根大通银行_活期	56,091.50	-	336,765.35	-

注：本基金的活期银行存款分别由基金托管人和境外资产托管人保管，按适用利率或约定利率计息。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本期（2019年1月1日至2019年6月30日）及上年度可比期间（2018年1月1日至2018年6月30日），本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

**6.4.11 利润分配情况**

单位：人民币元

序号	权益 登记日	场内除 息日	场外除息 日	每10份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分 配合计	备注
1	2019年1月 16日	-	2019年1月 15日	0.0100	16,521.09	6,288.66	22,809.75	2018年年度 收益分配于 2019年实施
2	2019年4月 16日	-	2019年4月 15日	0.0640	137,947.85	50,661.53	188,609.38	-
合计	-	-	-	0.0740	154,468.94	56,950.19	211,419.13	-

注：2019年7月11日，本基金管理人发布《嘉实全球房地产证券投资基金2019年第二次收益分配公告》，收益分配基准日为2019年6月30日，权益登记日为2019年7月15日，除息日为2019年7月12日，红利发放日为2019年7月17日，收益分配方案为每10份基金份额派发现金红利0.1070元。

**6.4.12 期末(2019年06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**

本期末（2019年6月30日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本期末（2019年6月30日），本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本期末（2019年6月30日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本期末（2019年6月30日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

### 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董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设风险控制与内审委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

为了有效控制基金运作和管理中存在的风险，本基金的基金管理人设立风险控制委员会，由公司总经理、督察长以及部门总监组成，负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。监察稽核部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。公司管理层重视和支持监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确监察稽核部门及其各岗位的职责和 workflows、组织纪律。业务部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

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、监察稽核部、风险管理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。

基金的银行存款存放在境内和境外托管人，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**

本报告期末（2019年6月30日）及上年度末（2018年12月31日），本基金未持有按短期信用评级的债券投资。

##### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本报告期末（2019年6月30日）及上年度末（2018年12月31日），本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本报告期末（2019年6月30日）及上年度末（2018年12月31日），本基金未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本报告期末（2019年6月30日）及上年度末（2018年12月31日），本基金未持有按长期信用评级的债券投资。

##### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本报告期末（2019年6月30日）及上年度末（2018年12月31日），本基金未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本报告期末（2019年6月30日）及上年度末（2018年12月31日），本基金未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 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于开放日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于开放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。

于本报告期末，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在 1 个月内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同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 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》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。

本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不得超过基金净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构 10%以上具有投票权的证券发行总量。本基金持有非流动性资产市值不得超过基金资产净值的 10%。

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。

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或柜台市场交易，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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 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如下表所示：

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,856,633.94	-	-	-	2,856,633.94
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-37,109,424.84	37,109,424.84
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	437.04	437.04
应收股利	-	-	-	207,982.95	207,982.95
应收申购款	295.00	-	-	221,618.87	221,913.87
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,856,928.94	-	-	-37,539,463.70	40,396,392.64

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	-	-	-	1,433,899.89	1,433,899.89
应付管理人报酬	-	-	-	52,687.34	52,687.34
应付托管费	-	-	-	10,847.36	10,847.36
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应付税费	-	-	-	512.92	512.92
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	30,571.95	30,571.95
负债总计	-	-	-	1,528,519.46	1,528,519.46
利率敏感度缺口	2,856,928.94	-	-	-36,010,944.24	38,867,873.18
上年度末 2018年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,312,768.97	-	-	-	1,312,768.97
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	22,976,550.63	22,976,550.63
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	4,082.71	4,082.71
应收利息	-	-	-	67.87	67.87
应收股利	-	-	-	80,844.13	80,844.13
应收申购款	-	-	-	39,230.82	39,230.82
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,312,768.97	-	-	23,100,776.16	24,413,545.13
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	-	-	-	240,901.60	240,901.60
应付管理人报酬	-	-	-	37,458.89	37,458.89

应付托管费	-	-	-	7,712.13	7,712.13
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	150,718.96	150,718.96
负债总计	-	-	-	436,791.58	436,791.58
利率敏感度缺口	1,312,768.97	-	-	-22,663,984.58	23,976,753.55

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规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

于2019年6月30日，本基金未持有交易性债券投资（2018年12月31日：无）。因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2018年12月31日：同）。

#### 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 2019年6月30日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	56,941.90	-	-	56,941.90
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	27,049,586.75	1,007,263.48	9,052,574.61	37,109,424.84
衍生金融资产	-	-	-	-
应收股利	97,075.08	18,223.48	76,179.59	191,478.15

应收利息	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
其它资产	-	-	-	-
资产合计	27,203,603.73	1,025,486.96	9,128,754.20	37,357,844.89
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	27,203,603.73	1,025,486.96	9,128,754.20	37,357,844.89
项目	上年度末 2018年12月31日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	848,705.99	-	-	848,705.99
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	17,589,327.21	2,016,878.54	3,370,344.88	22,976,550.63
衍生金融资产	-	-	-	-
应收股利	65,353.30	-	15,490.83	80,844.13
应收利息	11.94	-	-	11.94

应收申购款	-	-	-	-
应收证券清算款	4,082.71	-	-	4,082.71
其它资产	-	-	-	-
资产合计	18,507,481.15	2,016,878.54	3,385,835.71	23,910,195.40
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	18,507,481.15	2,016,878.54	3,385,835.71	23,910,195.40

#### 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		
	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（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
分析	所有外币相对人民币升值5%	1,867,892.24	1,195,509.77
	所有外币相对人民币贬值5%	-1,867,892.24	-1,195,509.77

#### 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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

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 2019年6月30日		上年度末 2018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	36,197,085.08	93.13	22,976,550.63	95.83
交易性金融资产—基金投资	912,339.76	2.35	—	—
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	37,109,424.84	95.48	22,976,550.63	95.83

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）	
分析	业绩比较基准上升 5%	1,881,381.88	1,082,726.27
	业绩比较基准下降 5%	-1,881,381.88	-1,082,726.27

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 37,109,424.84 元，无属于第二、第三层次的余额（上年度末：第一层次 22,976,550.63 元，无属于第二、第三层次的余额）。

(ii) 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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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）。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	36,197,085.08	89.60
	其中：普通股	4,392,103.83	10.87
	存托凭证	697,879.26	1.73
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	31,107,101.99	77.00
2	基金投资	912,339.76	2.26
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	2,856,633.94	7.07
8	其他各项资产	430,333.86	1.07
9	合计	40,396,392.64	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	26,460,754.95	68.08
中国香港	1,007,263.48	2.59
德国	17,400.64	0.04
日本	1,706,076.09	4.39
澳大利亚	3,655,978.70	9.41
西班牙	630,480.14	1.62
英国	1,088,764.32	2.80
法国	569,857.73	1.47
爱尔兰	302,908.75	0.78
瑞典	113,919.19	0.29
荷兰	643,681.09	1.66
合计	36,197,085.08	93.13

## 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(%)
存托凭证信息技术	697,879.26	1.80
股票非必需消费品	485,827.23	1.25
股票信息技术	376,629.06	0.97
股票房地产	3,529,647.54	9.08
房地产信托多元化类	3,283,114.69	8.45
房地产信托医疗保健类	3,185,107.73	8.19
房地产信托酒店及度假村类	1,652,006.63	4.25
房地产信托工业类	4,752,383.30	12.23
房地产信托写字楼类	4,261,223.48	10.96
房地产信托住宅类	7,120,393.76	18.32
房地产信托零售类	4,089,427.17	10.52
房地产信托特殊类	2,763,445.23	7.11
合计	36,197,085.08	93.13

注:本基金持有的权益投资采用全球行业分类标准(GICS)进行行业分类。

## 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	Prologis Inc	普洛斯公司	PLD UN	纽约证券交易所	美国	3,136	1,726,880.64	4.44
2	Aveo Group	Aveo 集团有限公司	AOG AT	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	171,748	1,557,595.79	4.01
3	HCP Inc	HCP 公司	HCP UN	纽约证券交易所	美国	4,935	1,084,974.09	2.79
4	American Campus Communities Inc	美国校园社区公司	ACC UN	纽约证券交易所	美国	3,261	1,034,833.19	2.66
5	Camden Property Trust	Camden 房地产信托公司	CPT UN	纽约证券交易所	美国	1,400	1,004,709.91	2.58
6	Invitation Homes Inc	邀请家园公司	INVH UN	纽约证券交易所	美国	5,240	962,906.23	2.48
7	AvalonBay Communities Inc	AvalonBay 社区股份有限公司	AVB UN	纽约证券交易所	美国	550	768,240.85	1.98

8	Equity Residential	公寓物业权益信托	EQR UN	纽约证券交易所	美国	1,400	730,698.11	1.88
9	Ventas Inc	Ventas 公司	VTR UN	纽约证券交易所	美国	1,522	715,166.10	1.84
10	Simon Property Group Inc	西蒙房地产集团公司	SPG UN	纽约证券交易所	美国	640	702,913.33	1.81
11	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	724	702,244.83	1.81
12	GDS Holdings Ltd	万国数据服务有限公司	GDS UQ	纳斯达克证券交易所	美国	2,702	697,879.26	1.80
13	Japan Rental Housing Investments Inc	日本赁贷住宅投资股份有限公司	8986 JT	日本证券交易所	日本	126	673,820.38	1.73
14	Unibail-Rodamco-Westfield	Unibail-Rodamco-Westfield	URW NA	阿姆斯特丹交易所	荷兰	625	643,681.09	1.66
15	Life Storage Inc	Life 仓储公司	LSI UN	纽约证券交易所	美国	984	643,188.13	1.65
16	CubeSmart	CubeSmart	CUBE UN	纽约证券交易所	美国	2,700	620,702.91	1.60
17	Hudson Pacific Properties Inc	哈德森太平洋地产公司	HPP UN	纽约证券交易所	美国	2,700	617,547.43	1.59
18	Host Hotels & Resorts Inc	Host 酒店及度假股份有限公司	HST UN	纽约证券交易所	美国	4,800	601,233.76	1.55
19	Nippon Healthcare Investment Corp	日本医疗保健投资公司	3308 JP	日本证券交易所	日本	53	600,349.02	1.54
20	Duke Realty Corp	杜克房地产公司	DRE UN	纽约证券交易所	美国	2,596	564,134.86	1.45
21	Gecina SA	热驰那	GFC FP	巴黎证券交易所	法国	535	550,363.70	1.42
22	Essex Property Trust	埃塞克斯房地产信托公司	ESS UN	纽约证券交易所	美国	264	529,829.83	1.36

	rust Inc							
23	Regency Centers Corp	Regency Centers 公司	REG UN	纳斯达克证券交易所	美国	1,100	504,245.50	1.30
24	Lendlease Group	联实集团	LLC AT	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	7,937	497,742.77	1.28
25	APN Industrial REIT	APN Industrial 房地产投资信托	ADI AT	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	35,000	487,945.27	1.26
26	Zhenro Properties Group Ltd	正荣地产	6158 HK	香港证券交易所	中国香港	110,000	482,845.37	1.24
27	GPT Group /The	GPT 集团	GPT AT	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	16,000	474,679.34	1.22
28	Apartment Investment & Management Co	公寓投资与管理	AIV UN	纽约证券交易所	美国	1,350	465,155.95	1.20
29	Capital & Counties Properties PLC	Capital & Counties 房地产有	CAPC LN	伦敦证券交易所	英国	23,266	438,998.65	1.13
30	Terreno Realty Corp	Terreno 房地产公司	TRNO UN	纽约证券交易所	美国	1,300	438,275.87	1.13
31	Healthcare Trust of America Inc	美国医疗保健信托公司	HTA UN	纽约证券交易所	美国	2,317	436,923.69	1.12
32	Samty Residential Investment Corp	Samty 住宅投资公司	3459 JT	日本证券交易所	日本	60	431,906.69	1.11
33	Paramount Group Inc	百乐门集团有限公司	PGRE UN	纽约证券交易所	美国	4,400	423,784.01	1.09
34	Boston Properties Inc	波士顿地产公司	BXP UN	纽约证券交易所	美国	475	421,247.24	1.08
35	Monmouth Real Estate Investm	Monmouth Real Estate Investm	MNR UN	纽约证券交易所	美国	4,511	420,209.51	1.08

	stment Co rp							
36	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	510	412,983.17	1.06
37	Taubman Centers Inc	塔伯曼中心公司	TCO UN	纽约证券交易所	美国	1,457	408,971.16	1.05
38	Rexford Industrial Realty Inc	Rexford Industrial Realty 股	REXR UN	纽约证券交易所	美国	1,400	388,544.29	1.00
39	InterXion Holding NV	InterXion 控股	INXN UN	纽约证券交易所	美国	720	376,629.06	0.97
40	Mack-Cali Realty Corp	Mack-Cali 房地产公司	CLI UN	纽约证券交易所	美国	2,300	368,257.05	0.95
41	SL Green Realty Corp	SL Green 房地产公司	SLG UN	纽约证券交易所	美国	650	359,137.77	0.92
42	American Homes 4 Rent	American Homes 4 Rent	AMH UN	纽约证券交易所	美国	2,100	350,960.31	0.90
43	Physicians Realty Trust	医生房地产信托	DOC UN	纽约证券交易所	美国	2,900	347,694.83	0.89
44	Retail Properties of America Inc	美国零售物业公司	RPAI UN	纽约证券交易所	美国	4,200	339,555.18	0.87
45	RLJ Lodging Trust	RLJ Lodging 信托	RLJ UN	纽约证券交易所	美国	2,764	337,089.64	0.87
46	Neinor Homes SA	Neinor Homes 股份公司	HOME S Q	西班牙证券交易所	西班牙	4,000	334,567.60	0.86
47	Cousins Properties Inc	Cousins 房地产股份有限公司	CUZ UN	纽约证券交易所	美国	1,294	321,763.32	0.83
48	UDR Inc	UDR 公司	UDR UN	纽约证券交易所	美国	1,000	308,605.28	0.79
49	Liberty Property Trust	Liberty 房地产信托公司	LPT UN	纽约证券交易所	美国	880	302,728.79	0.78
50	Mid-America	Mid-America	MAA UN	纽约证券交	美国	359	290,633.72	0.75

	a Apartment Communities Inc	Apartment Communities Inc		易所				
51	Americold Realty Trust	Americold Realty Trust	COLD UN	纽约证券交易所	美国	1,300	289,741.11	0.75
52	Jernigan Capital Inc	Jernigan 资本公司	JCAP UN	纽约证券交易所	美国	2,041	287,640.89	0.74
53	Ronshine China Holdings Ltd	融信中国	3301 HK	香港证券交易所	中国香港	32,000	271,076.03	0.70
54	Extra Space Storage Inc	额外空间仓储公司	EXR UN	纽约证券交易所	美国	369	269,150.69	0.69
55	Vicinity Centres	Vicinity 中心	VCX AT	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	22,700	268,285.48	0.69
56	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	300	265,555.91	0.68
57	Vornado Realty Trust	沃那多房地产信托	VNO UN	纽约证券交易所	美国	600	264,400.96	0.68
58	American Assets Trust Inc	美国资产信托公司	AAT UN	纽约证券交易所	美国	800	259,148.69	0.67
59	Link REIT	领展房产基金	823 HK	香港证券交易所	中国香港	3,000	253,342.08	0.65
60	Xenia Hotels & Resorts Inc	Xenia 酒店与度假村股份有限公司	XHR UN	纽约证券交易所	美国	1,700	243,673.74	0.63
61	American Tower Corp	美国发射塔公司	AMT UN	纽约证券交易所	美国	170	238,940.51	0.61
62	Kilroy Realty Corp	Kilroy 房地产公司	KRC UN	纽约证券交易所	美国	450	228,339.72	0.59
63	Brixmor Property Group Inc	Brixmor 房地产集团股份有限公司	BRX UN	纽约证券交易所	美国	1,802	221,501.18	0.57

64	Stockland	Stockland 公司	SGP AT	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	11,000	221,275.82	0.57
65	Merlin Properties Socimi SA	Merlin Properties Socimi 有限	MRL SQ	西班牙证券交易所	西班牙	2,300	219,345.02	0.56
66	VEREIT Inc	VEREIT 股份有限公司	VER UN	纽约证券交易所	美国	3,500	216,793.66	0.56
67	Pebblebrook Hotel Trust	Pebblebrook 酒店信托公司	PEB UN	纽约证券交易所	美国	1,100	213,101.95	0.55
68	Green REIT plc	Green 房地产投资信托公共有限	GRN ID	爱尔兰证券交易所	爱尔兰	15,000	212,231.55	0.55
69	Equinix Inc	Equinix 有限公司	EQIX UN	纳斯达克证券交易所	美国	61	211,477.39	0.54
70	Summit Hotel Properties Inc	Summit 酒店物业公司	INN UN	纽约证券交易所	美国	2,600	205,017.30	0.53
71	Essential Properties Realty Trust Inc	Essential Properties Realty	EPRT UN	纽约证券交易所	美国	1,436	197,836.27	0.51
72	Segro PLC	Segro 股份有限公司	SGRO LN	伦敦证券交易所	英国	2,907	184,913.98	0.48
73	British Land PLC/The	英国置地公司	BLND LN	伦敦证券交易所	英国	3,500	164,155.74	0.42
74	First Industrial Realty Trust Inc	第一工业地产信托公司	FR UN	纽约证券交易所	美国	600	151,545.89	0.39
75	Peet Ltd	Peet 有限公司	PPC AT	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	27,477	148,454.23	0.38
76	Land Securities Group PLC	地产证券集团公共有限公司	LAND LN	伦敦证券交易所	英国	2,000	145,165.10	0.37
77	Macerich Co/The	Macerich 公司	MAC UN	纽约证券交易所	美国	600	138,140.22	0.36
78	Fabege AB	Fabege 公共有限公司	FABG SS	斯德哥尔摩证券交易所	瑞典	1,100	113,919.19	0.29
79	Lexington	莱星顿置业信	LXP UN	纽约证券交	美国	1,700	109,974.58	0.28

	Realty Trust	托		易所				
80	Derwent London PLC	Derwent London 公共有限公司	DLN LN	伦敦证券交易所	英国	400	108,577.64	0.28
81	Industrial Logistics Properties Trust	Industrial Logistics Property	ILPT U W	纳斯达克证券交易所	美国	700	100,191.88	0.26
82	Colony Capital Inc	Colony 资本有限公司	CLNY U N	纽约证券交易所	美国	2,700	92,808.45	0.24
83	Hibernia REIT plc	Hibernia REIT 公共有限公司	HBRN I D	爱尔兰证券交易所	爱尔兰	8,000	90,677.20	0.23
84	Extended Stay America Inc	Extended Stay America 股份有	STAY U W	纳斯达克证券交易所	美国	724	84,066.31	0.22
85	Retail Opportunity Investments Corp	Retail Opportunity 投资公司	ROIC U W	纳斯达克证券交易所	美国	686	80,785.84	0.21
86	CyrusOne Inc	CyrusOne 股份有限公司	CONE U W	纳斯达克证券交易所	美国	200	79,361.54	0.20
87	Inmobiliaria Colonial Soci mi SA	Inmobiliaria Colonial Socimi	COL SQ	西班牙证券交易所	西班牙	1,000	76,567.52	0.20
88	Urban Edge Properties	Urban Edge 房地产	UE UN	纽约证券交易所	美国	600	71,483.13	0.18
89	Hilton Worldwide Holdings Inc	希尔顿全球控股股份有限公司	HLT UN	纽约证券交易所	美国	100	67,193.32	0.17
90	Empire State Realty Trust Inc	Empire State 房地产信托公司	ESRT U N	纽约证券交易所	美国	600	61,088.58	0.16
91	Chatham Lodging Trust	Chatham Lodging 信托	CLDT U N	纽约证券交易所	美国	400	51,890.24	0.13
92	Great Portl	Great Portl	GPOR L	伦敦证券交	英国	788	46,953.21	0.12

	land E states PL C	and Estat es 公共有	N	易所				
93	Pennsylvan ia Real Estate Investment Trust	宾夕法尼亚房 地产投资信托	PEI UN	纽约证券交 易所	美国	600	26,811.33	0.07
94	Societe F onciere Lyonnais e SA	Societe Fon ciere Lyo nnaise 股	FLY FP	巴黎证券交 易所	法国	37	19,494.03	0.05
95	Vonovia S E	Vonovia 有限 公司	VNA GY	德国证券交 易所	德国	53	17,400.64	0.04
96	RMR Group Inc/The	RMR 集团股份 有限公司	RMR UR	纳斯达克证 券交易所	美国	5	1,614.87	0.00

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	Aveo Group	AOG AT	1,356,615.15	5.66
2	Zhenro Properties Group Ltd	6158 HK	1,263,878.75	5.27
3	HCP Inc	HCP UN	1,048,893.15	4.37
4	Grand City Proper ties SA	GYC GY	797,026.65	3.32
5	Japan Rental Hous ing Investments I nc	8986 JT	693,759.20	2.89
6	Ventas Inc	VTR UN	683,261.49	2.85
7	Camden Property T rust	CPT UN	682,862.97	2.85
8	Unibail-Rodamco-Wes tfield	URW NA	665,546.11	2.78
9	Host Hotels & Re sorts Inc	HST UN	630,053.16	2.63
10	Gecina SA	GFC FP	552,297.01	2.30
11	Lendlease Group	LLC AT	521,380.58	2.17
12	GPT Group/The	GPT AT	471,110.52	1.96
13	Life Storage Inc	LSI UN	455,030.81	1.90

14	Taubman Centers Inc	TCO UN	442,060.77	1.84
15	Healthcare Trust of America Inc	HTA UN	438,052.72	1.83
16	Simon Property Group Inc	SPG UN	437,948.37	1.83
17	American Campus Communities Inc	ACC UN	366,221.11	1.53
18	Vicinity Centres	VCX AT	362,872.40	1.51
19	Regency Centers Corp	REG UN	355,231.33	1.48
20	Retail Properties of America Inc	RPAI UN	354,394.31	1.48

### 7.5.2 累计卖出金额前 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	1,413,838.66	5.90
2	Times China Holdings Ltd	1233 HK	941,290.16	3.93
3	Vonovia SE	VNA GY	890,194.52	3.71
4	Grand City Properties SA	GYC GY	823,815.23	3.44
5	Zhenro Properties Group Ltd	6158 HK	821,561.88	3.43
6	InterXion Holding NV	INXN UN	670,441.51	2.80
7	American Tower Corp	AMT UN	589,585.03	2.46
8	ADO Properties SA	ADJ GR	508,058.65	2.12
9	QTS Realty Trust Inc	QTS UN	344,133.74	1.44
10	Logan Property Holdings Co Ltd	3380 HK	337,567.36	1.41
11	Yuzhou Properties Co Ltd	1628 HK	330,025.53	1.38
12	CIFI Holdings Group Co Ltd	884 HK	309,501.58	1.29
13	Lexington Realty Trust	LXP UN	263,523.67	1.10
14	China SCE Group Holdings Ltd	1966 HK	259,104.55	1.08
15	Crown Castle International Corp	CCI UN	254,799.41	1.06

16	Merlin Properties Socimi SA	MRL SQ	244,239.31	1.02
17	Shimao Property Holdings Ltd	813 HK	220,705.29	0.92
18	Tier REIT Inc	TIER UN	211,883.31	0.88
19	China Jinmao Holdings Group Ltd	817 HK	197,338.50	0.82
20	Digital Realty Trust Inc	DLR UN	184,377.78	0.77

### 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	20,544,355.61
卖出收入（成交）总额	11,693,710.35

注：7.5.1项“买入金额”、7.5.2项“卖出金额”及7.5.3项“买入成本”、“卖出收入”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

报告期末，本基金未持有债券。

### 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

报告期末，本基金未持有债券。

### 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

报告期末，本基金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

报告期末，本基金未持有金融衍生品。

### 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	Vanguard Real Estate ETF	ETF 基金	交易型开放式	Vanguard Group Inc	588,831.80	1.51
2	Vanguard Australian Property Se	ETF 基金	交易型开放式	Vanguard Investments Austral	323,507.96	0.83

	curities In dex ETF			ia Ltd		
--	------------------------	--	--	--------	--	--

注:报告期末,本基金仅持有上述2只基金。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

### 7.11.2

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	207,982.95
4	应收利息	437.04
5	应收申购款	221,913.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	430,333.86

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金前十名权益性投资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

持有人户数 (户)	人均持有的 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 (%)
7,859	4,060.06	-	-	31,908,047.57	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	1,808.30	0.01

## 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、基金投资和研发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	23,146,711.32
本报告期基金总申购份额	27,000,861.34
减：本报告期基金总赎回份额	18,239,525.09
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	31,908,047.57

注：报告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

2019年2月2日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，自2019年2月2日起邵健先生不再担任公司副总经理，专注于专户产品的投资管理工作。

2019年6月6日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，李松林先生因工作变动不再担任公司副总经理职务。

2019年6月12日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告》，公司法定代表人变更为经雷先生。

#### (2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

2019年1月,中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

2019年4月,中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

### 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

报告期内,本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
瑞银集团 Union Bank of Switzerland	-	29,916,573.71	94.09%	30,362.48	87.45%	
瑞穗证券亚洲有限公司 Mizuho Securities Asia Limited	-	885,851.18	2.79%	1,771.58	5.10%	
摩根士丹利有限公司	-	280,630.98	0.88%	1,403.15	4.04%	
法国巴黎证券(亚	-	264,835.37	0.83%	529.67	1.53%	

洲)有限公司 BNP PARIBAS Securities (Asia) Limited						
建银国际证券有限公司 CCB International Securities Limited	-	191,807.92	0.60%	191.81	0.55%	新增
极讯欧洲有限公司 Instinet Europe Limited	-	84,211.33	0.26%	168.42	0.49%	
中泰国际证券有限公司 ZHONGTAI INTERNATIONAL SECURITIES LIMITED	-	75,630.07	0.24%	113.45	0.33%	新增
中银国际证券有限公司 BOCI Securities Limited	-	41,458.18	0.13%	49.75	0.14%	新增
里昂证券有限公司 CLSA Limited	-	37,996.99	0.12%	95.03	0.27%	
瑞士信贷(香港)有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	17,926.94	0.06%	35.85	0.10%	
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	-	-	-	-	-	-
金贝塔证券有限公司 iGoldenbeta Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-
中国国际金融香港证券有限公司 China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	-	-	-	-	-	-
盛博香港有限公司 Sanford C. Bernstein (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-
野村国际(香港)有限公司 Nomura International (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-
星展唯高达(香港)有限公司	-	-	-	-	-	-

DBS Vickers (H ong Kong) Li mited						
中国银河证券股份 有限公司 China Galaxy I nternational Financials Hold ings	-	-	-	-	-	-
联昌证券有限公司 CIMB Securities Limited	-	-	-	-	-	-
德意志银行股份有 限公司 Deutsche Bank	-	-	-	-	-	-
花旗环球金融亚洲 有限公司 Citigroup Globa l Markets Asia Limited	-	-	-	-	-	-
中信建投(国际) 证券有限公司 China Securitie s (Internationa l) Brokerage C ompany Limited	-	-	-	-	-	-
大和资本市场香港 有限公司 Daiwa Capital Markets Hong K	-	-	-	-	-	-

ong 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, 在近一年内无重大违规行为;
- (2) 公司财务状况良好;
- (3) 有良好的内控制度, 在业内有良好的声誉;
- (4) 有较强的研究能力, 能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告, 并能根据基金投资的特殊要求, 提供专门的研究报告;
- (5) 建立了广泛的信息网络, 能及时提供准确地信息资讯服务。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	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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
瑞银集团 Union Bank of Switzerland and	-	-	-	-	-	-	5,789,229.78	100.00%

## 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	关于增加大连网金为嘉实旗下基金代销机构并开展定投、转换业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2019年1月4日
2	嘉实全球房地产2018年第一次收益分配公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2019年1月14日
3	嘉实基金管理有限公司关于嘉实全球房地产(QDII)2019年1月21日暂停申购、赎回及定投业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2019年1月17日
4	嘉实基金管理有限公司关于嘉实全球房地产(QDII)2019年1月28日暂停申购、赎回及定投业务公告	上海证券报、管理人网站	2019年1月24日
5	关于增加奕丰基金为嘉实旗下基金代	上海证券报、管理人网	2019年1月28日

	销机构并开展定投、转换业务及参加费率优惠的公告	站	
6	嘉实基金管理有限公司关于嘉实全球房地产(QDII)2019年2月18日暂停申购、赎回及定投业务公告	上海证券报、管理人网站	2019年2月14日
7	关于增加唐鼎耀华为嘉实旗下基金代销机构并开展定投、转换业务及参加费率优惠的公告	上海证券报、管理人网站	2019年2月28日
8	关于嘉实基金管理有限公司旗下基金参与嘉实财富定投业务的公告	上海证券报、管理人网站	2019年3月8日
9	嘉实全球房地产证券投资基金2019年第一次收益分配公告	上海证券报、管理人网站	2019年4月12日
10	关于嘉实全球房地产(QDII)2019年4月19日至4月22日暂停申购、赎回及定投业务公告	上海证券报、管理人网站	2019年4月17日
11	嘉实基金管理有限公司关于嘉实全球房地产(QDII)2019年4月25日暂停申购、赎回及定投业务公告	上海证券报、管理人网站	2019年4月23日
12	关于嘉实全球房地产(QDII)2019年5月13日暂停申购、赎回及定投业务公告	上海证券报、管理人网站	2019年5月9日
13	关于嘉实全球房地产(QDII)2019年5月20日暂停申购、赎回及定投业务公告	上海证券报、管理人网站	2019年5月16日
14	关于嘉实全球房地产(QDII)2019年5月27日暂停申购、赎回及定投业务公告	上海证券报、管理人网站	2019年5月23日
15	关于嘉实全球房地产(QDII)2019年6月10日暂停申购、赎回及定投业务公告	上海证券报、管理人网站	2019年6月5日
16	关于嘉实全球房地产(QDII)2019年7月1日暂停申购、赎回及定投业务公告	上海证券报、管理人网站	2019年6月27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

北京市建国门北大街8号华润大厦8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

2019年08月29日