

# 诺安全球收益不动产证券投资基金

## 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人：诺安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 08 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 29 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

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
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	境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5	信息披露方式	6
2.6	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	7
§ 4	管理人报告	8
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	11
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5	托管人报告	12
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	13
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1	资产负债表	13
6.2	利润表	14
6.3	净资产变动表	15
6.4	报表附注	16
§ 7	投资组合报告	33
7.1	期末基金资产组合情况	33
7.2	期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	34
7.3	期末按行业分类的权益投资组合	34
7.4	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	34
7.5	报告期内权益投资组合的重大变动	36
7.6	期末按债券信用等级分类的债券投资组合	37
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	37
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	37
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	37
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	37

7.11	投资组合报告附注 .....	38
§ 8	基金份额持有人信息 .....	38
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	38
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	39
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 .....	39
§ 9	开放式基金份额变动 .....	39
§ 10	重大事件揭示 .....	39
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	39
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 .....	39
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	39
10.4	基金投资策略的改变 .....	40
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	40
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 .....	40
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	40
10.8	其他重大事件 .....	41
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	42
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	42
11.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	42
§ 12	备查文件目录 .....	42
12.1	备查文件目录 .....	42
12.2	存放地点 .....	43
12.3	查阅方式 .....	43

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	诺安全球收益不动产证券投资基金
基金简称	诺安全球收益不动产 (QDII)
基金主代码	320017
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 09 月 23 日
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	17,631,935.91 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范围内的 REITs，通过积极的资产配置和精选投资，在严格控制投资风险的前提下，追求基金资产超越业绩比较基准的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金实施“自下而上”与“自上而下”相结合的主动投资策略。首先，本基金会根据流动性、市值规模等指标建立 REITs 备选库，并且根据不同业态以及不同类型，对备选库中的 REITs 进行有效分类，从而进一步实施资产配置策略。</p> <p>其次，在大类资产配置方面，本基金的大类资产主要为 REITs 以及货币市场工具，本基金将根据海外市场环境的变化，在保持长期资产配置稳定的前提下，积极进行短期的灵活配置；在国家资产配置方面，本基金将会根据不同国家 REITs 市场的发展情况、宏观经济、货币走势、地缘政治、税收政策等因素决定基金资产在不同国家的配置比例；在周期/弱周期类资产配置方面，本基金还会根据标的 REITs 所在国的经济周期决定在周期类和弱周期类 REITs 间的配置比例。</p> <p>再次，本基金将主要采取定性与定量相结合的方式对 REITs 的遴选。定性层面，本基金主要从标的业态、租约状况、资产质量、管理能力、分红能力等五个维度对标的 REITs 进行研判；定量层面，本基金主要从估值水平以及第三方评级等方面对标的 REITs 进行分析。</p> <p>最后，本基金将综合考量 REITs 的区域、业态集中度等特征，对组合在国家及业态层面进行再平衡，最终构建投资组合。</p>
业绩比较基准	FTSE EPRA/NAREIT Developed REITs Total Return Index
风险收益特征	本基金为股票型基金，主要投资于全球范围内证券交易所上市的 REITs。一般来说，其在证券投资基金中属于较高风险和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		诺安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李学君	郭明
	联系电话	0755-83026688	010-66105799
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-8998	95588
传真		0755-83026677	010-66105798
注册地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		李强	廖林

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	Brown Brothers Harriman & Co.
	中文	-	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		-	140 Broadway New York, NY 1005
办公地址		-	140 Broadway New York, NY 1005
邮政编码		-	NY 1005

## 2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.lionfund.com.cn
基金中期报告备置地点	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层诺安基金管理有限公司

## 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	诺安基金管理有限公司	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 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 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日）
本期已实现收益	1,269,536.98
本期利润	-932,766.50
加权平均基金份额本期利润	-0.0529
本期加权平均净值利润率	-3.84%

本期基金份额净值增长率	-3.43%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末（2024 年 06 月 30 日）</b>
期末可供分配利润	6,681,420.49
期末可供分配基金份额利润	0.3789
期末基金资产净值	24,313,356.40
期末基金份额净值	1.379
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末（2024 年 06 月 30 日）</b>
基金份额累计净值增长率	46.60%

注：1、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。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用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。

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	1.10%	0.49%	1.48%	0.57%	-0.38%	-0.08%
过去三个月	-1.43%	0.90%	-0.82%	0.96%	-0.61%	-0.06%
过去六个月	-3.43%	0.85%	-2.21%	0.87%	-1.22%	-0.02%
过去一年	2.59%	1.03%	3.49%	0.98%	-0.90%	0.05%
过去三年	-10.61%	1.19%	1.50%	1.11%	-12.11%	0.08%
自基金合同生效起至今	46.60%	1.09%	158.27%	1.12%	-111.67%	-0.03%

注：本基金的业绩比较基准为：FTSE EPRA/NAREIT Developed REITs Total Return Index。

#### 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



## § 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

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理六十一只开放式基金：诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安先锋混合型证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长混合型证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长混合型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证 100 指数证券投资基金、诺安中小盘精选混合型证券投资基金、诺安主题精选混合型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、诺安沪深 300 指数增强型证券投资基金、诺安行业轮动混合型证券投资基金、诺安多策略混合型证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金 (LOF)、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安创业板指数增强型证券投资基金 (LOF)、诺安策略精选股票型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、诺安研究精选股票型证券投资基金、诺安鸿鑫混合型证券投资基金、诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金、诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、诺安理财宝货币市场基金、诺安聚鑫宝货币市场基金、诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安聚利债券型证券投资基金、诺安新经济股票型证券投资基金、诺安低碳经济股票型证券投资基金、诺安中证 500 指数增



强型证券投资基金、诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、诺安先进制造股票型证券投资基金、诺安利鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安景鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安益鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安安鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安高端制造股票型证券投资基金、诺安改革趋势灵活配置混合型证券投资基金、诺安瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安圆鼎定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安鑫享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安联创顺鑫债券型证券投资基金、诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极配置混合型证券投资基金、诺安优化配置混合型证券投资基金、诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安精选价值混合型证券投资基金、诺安鼎利混合型证券投资基金、诺安恒鑫混合型证券投资基金、诺安新兴产业混合型证券投资基金、诺安研究优选混合型证券投资基金、诺安均衡优选一年持有期混合型证券投资基金等。

#### 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		
宋青	本基金基金经理	2020年04月 24日	-	15年	学士学位, 具有基金从业资格。曾先后任职于香港富海企业有限公司、中国银行广西分行、中国银行伦敦分行、深圳航空集团公司、道富环球投资管理亚洲有限公司上海代表处, 从事外汇交易、证券投资、固定收益及贵金属商品交易等投资工作。2010年10月加入诺安基金管理有限公司, 任国际业务部总经理。2019年2月至2024年6月任诺安精选价值混合型证券投资基金基金经理。2011年11月起任诺安全球黄金证券投资基金基金经理, 2012年7

					月起任诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）基金经理，2020年4月起任诺安全球收益不动产证券投资基金基金经理。2024年5月起兼任投资经理。
--	--	--	--	--	---

注：①此处基金经理的任职日期指根据公司决定确定的聘任日期；

②证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

报告期内，宋青先生暂未兼任具体私募资产管理计划的投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期间，本基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规，遵守了基金合同的规定，遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行为。

#### 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

根据中国证监会 2011 年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司更新并完善了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时涵盖投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

投资研究方面，公司设立全公司所有投资组合适用的证券备选库，在此基础上，不同投资组合根据其投资目标、投资风格和投资范围的不同，建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库；公司拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序；公司建立了统一的研究管理平台，所有内外部研究报告均通过该研究管理平台发布，并保障该平台对所有研究员和投资组合经理开放。

交易执行方面，对于场内交易，基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易功能，交易中心按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令，如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令，并且市价在指令限价以内，投资交易系统自动将该证券的每笔交易报单都自动

按比例分拆到各投资组合；对于债券一级市场申购、非公开发行业股票申购等非集中竞价交易的交易分配，在参与申购之前，各投资组合经理独立地确定申购价格和数量，并将申购指令下达给交易中心。公司在获配额度确定后，按照价格优先的原则进行分配，如果申购价格相同，则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配；对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易，投资组合经理以该投资组合的名义向交易中心下达投资指令，交易中心向银行间市场或交易对手询价、成交确认，并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好，未发现违反公平交易制度的情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度，富时发达市场 REITs 指数表现为震荡并下修幅度，主要受美元降息预期的变化，由乐观预期美元大幅降息到美国经济数据韧性很强，甚至有再通胀的危险。不能排除由于利率高企，成本传导至商业地产而导致中小不动产信托出现再融资风险甚至暴雷的事件发生。由于此类资产对于利率的变化更为敏感，后续还要看美国货币政策的变化。

全球发达市场的不动产信托市场在二季度经历了一个震荡的态势。4-5 月，业绩指数走了一个深 V 形态，主要受对利率预期的变化引起以及数家 REIT 公司公布业绩低于预期；养老院板块在本年度表现好于其他板块；公寓板块净收入增长率慢于去年，增幅约 2.9%；零售购物中心板块表现出现分化，部分表现较好，出租率基本回到疫情前水平；部分净收入增长低于过往的平均水平；办公板块继续承压，出租率仅 88%，低于其他板块 96% 的平均水平；工业类的成交量仍然低迷；物流板块加快资产周转速度；公寓类的成交量增加，融资利率基本稳定，暗示价格可能稳定；办公室板块有可能接近底部，REIT 价格比实物地产价格跌幅更大，暗示已经把最坏预期反映在价格里。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末基金份额净值为 1.379 元，本报告期内基金份额净值增长率为-3.43%，同期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

REIT 资产对于利率的预期更加敏感，我们倾向于中性偏宽松的看法。往后看美联储货币政策对

海外 REIT 市场的影响有望逐步减弱，美联储已基本宣布本轮加息周期结束，短期市场对利率周期变化交易将使得 REIT 指数弹性增加。尽管美联储真正启动降息的时点或与市场预期存在偏差，但当前美国利率下行周期基本确定。REIT 在利率上行周期期间调整明显，主要受其债券属性和股票属性共同影响，使得 REIT 表现远落后于股票资产表现。未来随着利率下行周期开启，将同时利好 REIT 资产的股票属性和债券属性，利率下行将使得 REIT 有望获得比股票资产更大的上行弹性。

#### 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，本基金管理人严格按照企业会计准则、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，负责研究、指导基金估值业务，制定和适时修订基金的估值政策和程序。估值委员会由督察长、投资、研究、风险管理、法律合规和基金运营等部门负责人及指定人员组成，估值委员会成员具有多年证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按约定提供相关参考数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 20%。若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本基金本报告期内未进行过利润分配。该处理符合相关法律法规及《基金合同》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

截至 2024 年 06 月 30 日，本基金存在连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。基金管理人积极与基金托管人协商解决方案，包括但不限于持续营销、转换运作方式、与其他基金合并等，并适时根据法律法规及基金合同约定的程序进行。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——诺安基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

## 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

本托管人依法对诺安基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

# § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：诺安全球收益不动产证券投资基金

报告截止日：2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	6,920,707.89	3,018,292.53
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	17,316,432.52	20,799,666.56
其中：股票投资		17,316,432.52	20,799,666.56
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		92,071.37	122,983.85
应收申购款		79,457.06	895,772.00

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		24,408,668.84	24,836,714.94
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年06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		42,278.76	367,060.79
应付管理人报酬		29,626.24	30,713.02
应付托管费		6,912.79	7,166.36
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	6.4.7.6	16,494.65	32,041.99
负债合计		95,312.44	436,982.16
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.7	17,631,935.91	17,090,643.99
未分配利润	6.4.7.8	6,681,420.49	7,309,088.79
净资产合计		24,313,356.40	24,399,732.78
负债和净资产总计		24,408,668.84	24,836,714.94

注：1. 报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.379 元，基金份额总额 17,631,935.91 份。

2. 本表中“交易性金融资产-股票投资”和“应收股利”为投资“房地产信托凭证”（简称 REITs）及其产生的收益。

## 6.2 利润表

会计主体：诺安全球收益不动产证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024年01月01 日至2024年06月 30日	上年度可比期间 2023年01月01日 至2023年06月30 日
<b>一、营业总收入</b>		-691,455.60	500,412.83
1. 利息收入		68,542.11	41,083.68
其中：存款利息收入	6.4.7.9	68,542.11	41,083.68
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）		1,401,990.11	774,346.77
其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,079,429.41	426,277.80
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	322,560.70	348,068.97
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-2,202,303.48	-324,655.74
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		10,305.44	7,622.97
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	30,010.22	2,015.15
<b>减：二、营业总支出</b>		241,310.90	227,970.89
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	180,793.90	170,369.80
2. 托管费	6.4.10.2.2	42,185.25	39,752.90
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	6.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		1,868.63	1,429.98
8. 其他费用	6.4.7.17	16,463.12	16,418.21
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-932,766.50	272,441.94
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-932,766.50	272,441.94
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-932,766.50	272,441.94

注：本表中“股票投资收益”和“股利收益”为投资 REITs 产生的投资收益。

### 6.3 净资产变动表

会计主体：诺安全球收益不动产证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配 利润	净资产合计
一、上期期末净资产	17,090,643.99	7,309,088.79	24,399,732.78
二、本期期初净资产	17,090,643.99	7,309,088.79	24,399,732.78
三、本期增减变动额（减少以“-”号	541,291.92	-627,668.30	-86,376.38

填列)			
(一)、综合收益总额	-	-932,766.50	-932,766.50
(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)	541,291.92	305,098.20	846,390.12
其中: 1. 基金申购款	7,783,801.79	3,041,728.05	10,825,529.84
2. 基金赎回款	-7,242,509.87	-2,736,629.85	-9,979,139.72
(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)	-	-	-
四、本期期末净资产	17,631,935.91	6,681,420.49	24,313,356.40
项目	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	16,743,635.25	6,927,395.59	23,671,030.84
二、本期期初净资产	16,743,635.25	6,927,395.59	23,671,030.84
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-251,199.53	150,382.39	-100,817.14
(一)、综合收益总额	-	272,441.94	272,441.94
(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)	-251,199.53	-122,059.55	-373,259.08
其中: 1. 基金申购款	1,414,167.31	512,084.78	1,926,252.09
2. 基金赎回款	-1,665,366.84	-634,144.33	-2,299,511.17
(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)	-	-	-
四、本期期末净资产	16,492,435.72	7,077,777.98	23,570,213.70

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:

齐斌

田冲

何柳姿

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

诺安全球收益不动产证券投资基金(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(2011)1260号《关于核准诺安全球收益不动产证券投资基金募集的批复》核准,由诺安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺安全球收益不动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681,403,638.20元。经向中国证监会备案,《诺安全球收益不动产证券投资基金基金合同》于2011年9月23日生效。基金合同生效日的基金份额总额为681,696,159.23



份基金份额，其中认购资金利息折合 292,521.03 份基金份额。本基金的基金管理人为诺安基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司，境外资产托管人为布朗兄弟哈里曼银行(Brown Brothers Harriman & Co.)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺安全球收益不动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房地产信托凭证(可简称“REITs”)、货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。此外，本基金为对冲本外币的汇率风险，还可以投资于外汇远期合约、外汇互换协议、期权等金融工具。本基金不直接购买不动产，也不投资于以抵押贷款利息收入为主要收入来源的抵押类 REITs(Mortgage REITs)。本基金的投资组合比例为：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、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：FTSE EPRA/NAREIT Developed REITs Total Return Index。

#### 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》、《诺安全球收益不动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 06 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

本基金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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税〔2002〕128号《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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区

税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

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

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育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06月30日	
	活期存款	6,920,707.89
等于：本金	6,920,367.96	
加：应计利息	339.93	
定期存款	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
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	-	
合计	6,920,707.89	

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	19,650,780.57	-	17,316,432.52	-2,334,348.05
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	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	19,650,780.57	-	17,316,432.52	-2,334,348.05

注：股票均为房地产信托凭证（简称 REITs）。

### 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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 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 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	85.53
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	16,409.12
合计	16,494.65

### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	17,090,643.99	17,090,643.99

本期申购	7,783,801.79	7,783,801.79
本期赎回（以“-”号填列）	-7,242,509.87	-7,242,509.87
本期末	17,631,935.91	17,631,935.91

#### 6.4.7.8 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	12,231,875.66	-4,922,786.87	7,309,088.79
本期期初	12,231,875.66	-4,922,786.87	7,309,088.79
本期利润	1,269,536.98	-2,202,303.48	-932,766.50
本期基金份额交易产生的变动数	392,947.84	-87,849.64	305,098.20
其中：基金申购款	5,887,815.47	-2,846,087.42	3,041,728.05
基金赎回款	-5,494,867.63	2,758,237.78	-2,736,629.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,894,360.48	-7,212,939.99	6,681,420.49

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	68,542.11
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	68,542.11

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 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01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	5,944,637.73
减：卖出股票成本总额	4,855,264.08
减：交易费用	9,944.24
买卖股票差价收入	1,079,429.41

注：本表“卖出股票成交总额”、“卖出股票成本总额”、“卖出股票差价收入”均为投资“房地产信托凭证”（简称 REITs）的投资情况。

##### 6.4.7.11 债券投资收益

#### 6.4.7.11.1 债券投资收益—买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

#### 6.4.7.12 衍生工具收益

##### 6.4.7.12.1 衍生工具收益—买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	322,560.70
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	322,560.70

注：“股票投资产生的股利收益”为投资房地产信托凭证（简称 REITs）产生的收益。

#### 6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
1. 交易性金融资产	-2,202,303.48
--股票投资	-2,202,303.48
--债券投资	-
--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	-2,202,303.48

#### 6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	30,010.22
合计	30,010.22

#### 6.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
审计费用	16,409.12
信息披露费	-
证券出借违约金	-
汇划手续费	54.00
合计	16,463.12

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期不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。

##### 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
诺安基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
Brown Brothers Harriman & Co.（布朗兄弟哈里曼银行）	基金境外托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

#### 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01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	180,793.90	170,369.80
其中：应支付销售机构的客户维护费	66,146.33	67,344.77
应支付基金管理人的净管理费	114,647.57	103,025.03

注：本基金的管理费率为年费率 1.50%。

基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	42,185.25	39,752.90

注：本基金的托管费率为年费率 0.35%。

基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内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 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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

##### 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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

#### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无基金管理人运用自有资金投资本基金的情况。

##### 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

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.6 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01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司-活期存款	3,446,263.01	6,819.32	2,100,299.17	2,459.59
Brown Brothers Harriman & Co. (布朗兄弟哈里曼银行)-活期存款	3,474,444.88	61,722.79	2,023,107.25	38,594.21

注：本基金的上述银行存款分别由基金托管人中国工商银行股份有限公司和境外托管人 Brown Brothers Harriman & Co. (布朗兄弟哈里曼银行) 保管，按适用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

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末 2024 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末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

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 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 QDII 股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。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房地产信托凭证。本基金在日常投资管理中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以合规审查与风险控制委员会、督察长、合规风控委员会、监察稽核部、风险控制部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规审查与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；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；在管理层层面设立合规风控委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部、风险控制部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

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，将风险控制可在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行股份有限公司和布朗兄弟哈里曼银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业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。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金无债券投资(2023 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2024 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)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。

本基金投资于同一机构(政府、国际金融组织除外)发行的证券(不包括境外基金)市值不得超过基金净值的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

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。于 2024 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动

性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的生息资产主要为货币资金。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年06月30日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	6,920,707.89	-	-	-	-	6,920,707.89
交易性金融资产	-	-	-	-	17,316,432.52	17,316,432.52
应收股利	-	-	-	-	92,071.37	92,071.37
应收申购款	-	-	-	-	79,457.06	79,457.06
资产总计	6,920,707.89	-	-	-	17,487,960.95	24,408,668.84
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	42,278.76	42,278.76
应付管理人报酬	-	-	-	-	29,626.24	29,626.24
应付托管费	-	-	-	-	6,912.79	6,912.79
其他负债	-	-	-	-	16,494.65	16,494.65
负债总计	-	-	-	-	95,312.44	95,312.44
利率敏感度缺口	6,920,707.89	-	-	-	-17,392,648.51	24,313,356.40
上年度末 2023年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计

日						
资产						
货币资金	3,018,292.53	-	-	-	-	3,018,292.53
交易性金融资产	-	-	-	-	20,799,666.56	20,799,666.56
应收股利	-	-	-	-	122,983.85	122,983.85
应收申购款	-	-	-	-	895,772.00	895,772.00
资产总计	3,018,292.53	-	-	-	21,818,422.41	24,836,714.94
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	367,060.79	367,060.79
应付管理人报酬	-	-	-	-	30,713.02	30,713.02
应付托管费	-	-	-	-	7,166.36	7,166.36
其他负债	-	-	-	-	32,041.99	32,041.99
负债总计	-	-	-	-	436,982.16	436,982.16
利率敏感度缺口	3,018,292.53	-	-	-	21,381,440.25	24,399,732.78

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的利率重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2023 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2023 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 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	3,470,722.67	4,568.69	0.47	3,475,291.83
交易性金融资产	17,209,216.08	99,719.42	7,497.02	17,316,432.52
应收股利	87,715.59	4,355.78	-	92,071.37
资产合计	20,767,654.34	108,643.89	7,497.49	20,883,795.72
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	20,767,654.34	108,643.89	7,497.49	20,883,795.72

项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			2
	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	112,557.27	561,300.79	0.21	673,858.27
交易性金融资产	20,648,647.46	143,055.89	7,963.21	20,799,666.56
应收股利	122,983.85	-	-	122,983.85
资产合计	20,884,188.58	704,356.68	7,963.42	21,596,508.68
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	20,884,188.58	704,356.68	7,963.42	21,596,508.68

#### 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 06 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%	1,044,189.79	1,079,825.43
	所有外币相对人民币贬值 5%	-1,044,189.79	-1,079,825.43

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为：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不低于基金资产净值的 5%。此

外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 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	17,316,432.52	71.22	20,799,666.56	85.25
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	17,316,432.52	71.22	20,799,666.56	85.25

#### 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		
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 06 月 30 日)	上年度末(2023 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准上升 5%	1,130,677.26	1,273,488.90
	业绩比较基准下降 5%	-1,130,677.26	-1,273,488.90

### 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 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	17,316,432.52	20,799,666.56
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	17,316,432.52	20,799,666.56

#### 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证券，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，本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证券的公允价值列入第一层次；本基金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，确定相关证券的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 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2023 年 12 月 31 日：同)。

#### 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。

#### 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	17,316,432.52	70.94
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	房地产信托凭证	17,316,432.52	70.94
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-

	其中：债券		
	资产支持证券		
4	金融衍生品投资		
	其中：远期		
	期货		
	期权		
	权证		
5	买入返售金融资产		
	其中：买断式回购的买入返售金融资产		
6	货币市场工具		
7	银行存款和结算备付金合计	6,920,707.89	28.35
8	其他各项资产	171,528.43	0.70
9	合计	24,408,668.84	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	17,209,216.08	70.78
中国（香港）	99,719.42	0.41
新加坡	7,497.02	0.03
合计	17,316,432.52	71.22

注：本表所列项目为房地产信托凭证（简称 REITs）。

## 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（%）
工业房地产投资信托	2,803,407.45	11.53
酒店及娱乐地产投资信托	569,638.00	2.34
办公房地产投资信托	2,470,112.32	10.16
住宅房地产投资信托	1,061,850.44	4.37
零售业房地产投资信托	2,939,587.78	12.09
特种房地产投资信托	7,471,836.53	30.73
合计	17,316,432.52	71.22

注：1、本表所列项目为房地产信托凭证（简称 REITs）。

2、本基金持有的股票及存托凭证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	公司名称	证券	所在证券	所属国家	数量	公允	占基金资产
----	------	------	----	------	------	----	----	-------

	(英文)	(中文)	代码	市场	(地区)	(股)	价值	净值比例 (%)
1	PROLOGIS INC	普洛斯公司	PLD US	纽约交易所	美国	1,684	1,347,891.97	5.54
2	EQUINIX INC	Equinix 有限公司	EQIX US	纳斯达克	美国	246	1,326,465.67	5.46
3	REALTY INCOME CORP	Realty Income 公司	O US	纽约交易所	美国	3,000	1,129,312.73	4.64
4	EXTRA SPACE STORAGE	Extra Space 仓储公司	EXR US	纽约交易所	美国	1,000	1,107,575.99	4.56
5	DIGITAL REALTY TRUST INC	数字房地产信托有限公司	DLR US	纽约交易所	美国	1,009	1,093,382.61	4.50
6	DOUGLAS EMMETT INC	Douglas Emmett 股份有限公司	DEI US	纽约交易所	美国	11,498	1,090,673.93	4.49
7	BOSTON PROPERTIES INC	波士顿地产公司	BXP US	纽约交易所	美国	2,354	1,032,760.55	4.25
8	PUBLIC STORAGE	公共仓储公司	PSA US	纽约交易所	美国	498	1,020,911.96	4.20
9	SAFEHOLD INC	Safehold 股份有限公司	SAFE US	纽约交易所	美国	7,400	1,017,322.19	4.18
10	FEDERAL REALTY INVESTMENTS	联邦房地产投资信托公司	FRT US	纽约交易所	美国	1,400	1,007,430.19	4.14
11	ESSEX PROPERTY TRUST INC	埃塞克斯信托公司	ESS US	纽约交易所	美国	420	814,764.28	3.35
12	First Industrial Realty Trust, Inc.	第一工业地产公司	FR US	纽约交易所	美国	2,400	812,626.24	3.34
13	AMERICAN TOWER CORP	美国发射塔公司	AMT US	纽约交易所	美国	550	761,919.06	3.13
14	SIMON PROPERTY GROUP INC	西蒙房地产集团公司	SPG US	纽约交易所	美国	643	695,628.42	2.86
15	VICI PROPERTIES INC	VICI Properties 股份有限公司	VICI US	纽约交易所	美国	3,300	673,568.12	2.77
16	AMERICOLD REALTY	Americold Realty 信托	COLD US	纽约交易所	美国	3,532	642,889.24	2.64
17	RLJ LODGING	RLJ 住房信	RLJ US	纽约交易	美国	8,300	569,638.0	2.34

	G TRUST	托基金		所			0	
18	CROWN CASTLE INC	冠城国际公司	CCI US	纽约交易所	美国	676	470,690.93	1.94
19	ALEXANDRIA REAL ESTATE	亚历山大房地产股份有限公司	ARE US	纽约交易所	美国	400	333,448.72	1.37
20	EQUITY RESIDENTIAL	公寓物业权益信托	EQR US	纽约交易所	美国	500	247,086.16	1.02
21	LINK REIT	领展房产	823 HK	香港证券交易所	中国（香港）	3,600	99,719.42	0.41
22	Orin Office REIT Inc	Orin Office 房地产股份有限公司	ONL US	纽约交易所	美国	300	7,675.56	0.03
23	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	凯德商用新加坡信托	CICT SP	新加坡交易所	新加坡	720	7,497.02	0.03
24	KILROY REALTY CORP	吉劳埃地产公司	KRC US	纽约交易所	美国	25	5,553.56	0.02

注：1、本表所列项目为房地产信托凭证（简称 REITs）。

2、本表所列证券代码采用当地市场代码。

## 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	PUBLIC STORAGE	PSA US	1,033,325.93	4.23
2	WELLTOWER INC	WELL US	931,411.76	3.82
3	VICI PROPERTIES INC	VICI US	698,123.22	2.86
4	DIGITAL REALTY TRUST INC	DLR US	355,094.74	1.46
5	ALEXANDRIA REAL ESTATE	ARE US	331,969.35	1.36
6	EQUITY RESIDENTIAL	EQR US	224,408.52	0.92

注：1、本表所列项目为房地产信托凭证（简称 REITs）。

2、本表所列证券代码采用当地市场代码。

3、买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	SPG US	1,300,989.24	5.33
2	DIGITAL REALTY TRUST INC	DLR US	1,070,931.48	4.39
3	WELLTOWER INC	WELL US	1,045,820.61	4.29
4	JBG SMITH Properties	JBGS US	705,834.17	2.89
5	EQUINIX INC	EQIX US	632,251.44	2.59
6	HOST HOTELS & RESORTS INC	HST US	625,372.65	2.56
7	KILROY REALTY CORP	KRC US	312,378.68	1.28
8	DOUGLAS EMMETT INC	DEI US	251,059.46	1.03

注：1、本表所列项目为房地产信托凭证（简称 REITs）。

2、本表所列证券代码采用当地市场代码。

3、卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	3,574,333.52
卖出收入（成交）总额	5,944,637.73

注：买入权益成本、卖出权益收入均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本项主要列示按国际权威评级机构（标普、穆迪）的债券信用评级情况。本基金本报告期末未持有此类债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

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

本基金本报告期末未持有基金。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 基金投资前十名证券的发行主体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、处罚说明

本基金投资的前十名证券的发行主体，本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形，也没有出现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备选库之外的股票。

### 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	应收清算款	-
3	应收股利	92,071.37
4	应收利息	-
5	应收申购款	79,457.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	171,528.43

注：本表所列“应收股利”为投资“房地产信托凭证”（简称 REITs）产生的收益。

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	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
2,535	6,955.40	13,829.67	0.08%	17,618,106.24	99.92%

### 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	108,252.08	0.6140%

### 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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年09月23日）基金份额总额	681,696,159.23
本报告期期初基金份额总额	17,090,643.99
本报告期基金总申购份额	7,783,801.79
减：本报告期基金总赎回份额	7,242,509.87
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	17,631,935.91

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会，没有基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人基金管理业务、本基金基金财产、本基金托管业务的诉讼事

项。

#### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金的投资策略没有重大改变。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金聘请的会计师事务所没有发生变更。

#### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

##### 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，本基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

##### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

#### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
BOCI Securities Limited	1	3,561,068.21	37.41%	7,140.53	72.20%	-
China Galaxy International Securities	1	756,859.02	7.95%	1,513.78	15.31%	-
高盛	1	5,201,044.02	54.64%	1,235.31	12.49%	-
广发证券（香港）经纪有限公司	1	-	-	-	-	-

注：1、本表所列“股票”为“房地产信托凭证”（简称 REITs）投资及其佣金支付情况。

2、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：无

3、券商选择标准和程序

获取优秀券商进行境外投资，主要标准有以下几个方面：

(1) 全球眼光。具备优秀的全球投资经验，拥有丰富的地区市场知识和国际运作能力。



(2) 良好的交易执行能力。对投资交易指令能够有效执行以及取得较高质量的成交结果。

(3) 高水平的研究能力。能够为客户提供高水平的综合资本市场研究方案，掌握宏观市场的发展趋势，深入的行业分析，有效地实施方案。

(4) 杰出的服务意识。投资交易中出现问题能够认真对待，尽可能保证交易的及时性、保证成交价格的确切性以及防范市场风险。

公司国际业务部以及投研部门会定期评价券商的业务水平，并及时与券商沟通，由此确定对券商进行选择以及成交量的分配，最大程度保证投资交易的执行。

### 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

本基金租用的证券公司交易单元本报告期末未进行其他证券投资交易。

### 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	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加广发银行费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024年01月08日
2	诺安基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024年01月22日
3	诺安全球收益不动产证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2024年01月22日
4	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加玄元保险为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024年02月02日
5	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加排排网基金为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024年02月29日
6	诺安基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024年03月29日
7	诺安全球收益不动产证券投资基金 2023 年年度报告	基金管理人网站	2024年03月29日
8	诺安全球收益不动产证券投资基金限制大额申购（含定投）业务的公告	《中国证券报》	2024年04月02日
9	诺安基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024年04月22日

10	诺安全球收益不动产证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2024年04月22日
11	诺安基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在直销渠道的申购起点金额、最小追加申购金额及最低赎回份额的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024年05月24日
12	诺安基金管理有限公司关于终止北京懒猫基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024年06月07日
13	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金基金产品资料概要（更新）的提示性公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024年06月14日
14	诺安全球收益不动产证券投资基金基金产品资料概要更新	基金管理人网站	2024年06月14日

注：前述所有公告事项均同时在基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站进行披露。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本报告期内，本基金未出现单一投资者持有本基金份额比例达到或超过 20%的情形，敬请投资者留意。							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2024 年 7 月 31 日披露了《诺安基金管理有限公司关于诺安全球收益不动产证券投资基金变更业绩比较基准及修改基金合同的公告》，自 2024 年 8 月 1 日，本基金的业绩比较基准变更为：STOXX® Global 1800 REITs Index。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- ①中国证券监督管理委员会批准诺安全球收益不动产证券投资基金募集的文件。
- ②《诺安全球收益不动产证券投资基金基金合同》。
- ③《诺安全球收益不动产证券投资基金托管协议》。
- ④基金管理人业务资格批件、营业执照。
- ⑤报告期内诺安全球收益不动产证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告。

## 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

## 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可致电本基金管理人全国统一客户服务电话：400-888-8998，亦可至基金管理人网站 [www.lionfund.com.cn](http://www.lionfund.com.cn) 查阅详情。

诺安基金管理有限公司  
2024 年 08 月 30 日