

# 南方道琼斯美国精选 REIT 指数证券投资基金(QDII-LOF) 2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本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 2022 年 8 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 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	5
2.5 信息披露方式.....	5
2.6 其他相关资料.....	5
§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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	9
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	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.....	12
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 中期财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	45
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	46
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	46
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细.....	46
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	58
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	60
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.....	60
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	60
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.....	61

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.....	61
7.11 投资组合报告附注.....	61
§8 基金份额持有人信息.....	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	62
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	63
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	63
§9 开放式基金份额变动.....	63
§10 重大事件揭示.....	64
10.1 基金份额持有人大会决议.....	64
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.....	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	64
10.4 基金投资策略的改变.....	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
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.....	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64
10.8 其他重大事件.....	66
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	67
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.....	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	67
§12 备查文件目录.....	67
12.1 备查文件目录.....	67
12.2 存放地点.....	67
12.3 查阅方式.....	68

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方道琼斯美国精选 REIT 指数证券投资基金(QDII-LOF)	
基金简称	南方道琼斯美国精选 REIT 指数 (QDII-LOF)	
场内简称	美国 REIT (美国 REIT 精选 LOF)	
基金主代码	160140	
交易代码	160140	
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)	
基金合同生效日	2017 年 10 月 26 日	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	123,710,068.79 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2017 年 11 月 24 日	
下属分级基金的基金简称	南方道琼斯美国精选 REIT 指数 (QDII-LOF) A	南方道琼斯美国精选 REIT 指数 (QDII-LOF) C
下属分级基金的场内简称	美国 REIT (美国 REIT 精选 LOF)	
下属分级基金的交易代码	160140	160141
报告期末下属分级基金的份额总额	80,904,235.93 份	42,805,832.86 份

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	常克川	郭明
	联系电话	0755-82763888	010-66105799
	电子邮箱	manager@southernfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-889-8899	95588
传真		0755-82763889	010-66105798
注册地址		深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518017	100140
法定代表人		周易	陈四清

## 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	中文	-	布朗兄弟哈里曼银行
	英文	-	Brown Brothers Harriman & Co.
注册地址		-	140 Broadway New York, NY 10005
办公地址		-	140 Broadway New York, NY 10005
邮政编码		-	10005

## 2.5 信息披露方式

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	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址、基金上市交易的证券交易所（如有）

## 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司（A 级） 南方基金管理股份有限公司（C 级）	北京市西城区太平桥大街 17 号 深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

##### 1、南方道琼斯美国精选 REIT 指数（QDII-LOF）A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日 - 2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,439,435.69
本期利润	-17,498,497.55
加权平均基金份额本期利润	-0.2312
本期加权平均净值利润率	-19.08%
本期基金份额净值增长率	-16.54%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	6,719,764.45
期末可供分配基金份额利润	0.0831
期末基金资产净值	89,382,725.63
期末基金份额净值	1.1048
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	12.38%

##### 2、南方道琼斯美国精选 REIT 指数（QDII-LOF）C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日 - 2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	582,504.76
本期利润	-8,435,459.96
加权平均基金份额本期利润	-0.2329
本期加权平均净值利润率	-19.57%
本期基金份额净值增长率	-16.71%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	2,651,052.69
期末可供分配基金份额利润	0.0619
期末基金资产净值	46,448,711.00
期末基金份额净值	1.0851
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	10.39%

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

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用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、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方道琼斯美国精选 REIT 指数 (QDII-LOF) A

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	-6.79%	1.83%	-7.23%	1.84%	0.44%	-0.01%
过去三个月	-13.00%	1.72%	-11.31%	1.73%	-1.69%	-0.01%
过去六个月	-16.54%	1.49%	-15.37%	1.50%	-1.17%	-0.01%
过去一年	-3.96%	1.25%	-2.96%	1.25%	-1.00%	0.00%
过去三年	0.09%	1.81%	-1.83%	1.82%	1.92%	-0.01%
自基金合 同生效起 至今	12.38%	1.54%	10.51%	1.55%	1.87%	-0.01%

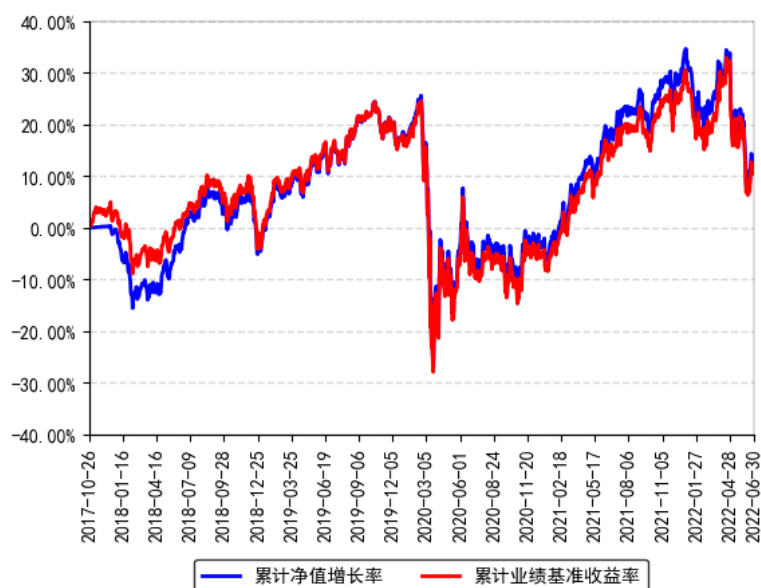
南方道琼斯美国精选 REIT 指数 (QDII-LOF) C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	-6.82%	1.83%	-7.23%	1.84%	0.41%	-0.01%
过去三个月	-13.09%	1.72%	-11.31%	1.73%	-1.78%	-0.01%
过去六个月	-16.71%	1.49%	-15.37%	1.50%	-1.34%	-0.01%
过去一年	-4.29%	1.25%	-2.96%	1.25%	-1.33%	0.00%
过去三年	-0.98%	1.81%	-1.83%	1.82%	0.85%	-0.01%
自基金合 同生效起 至今	10.39%	1.54%	10.51%	1.55%	-0.12%	-0.01%

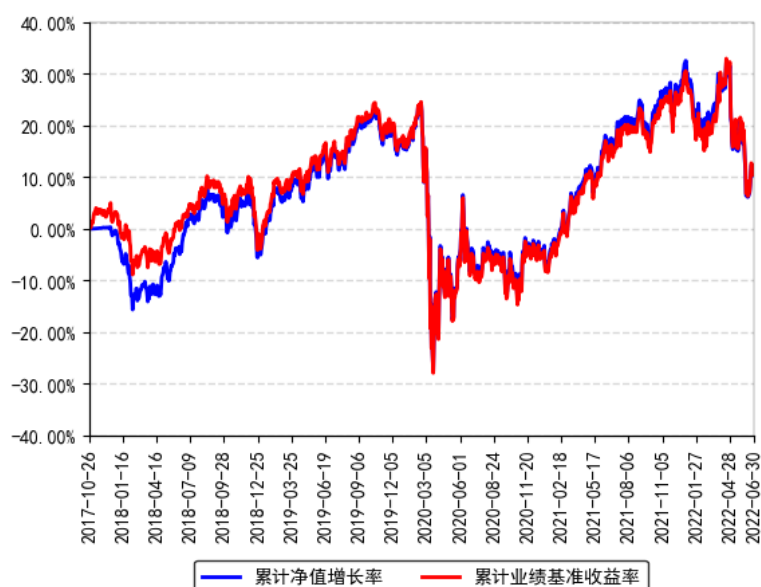
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



南方道琼斯美国精选REIT指数（QDII-LOF）A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



南方道琼斯美国精选REIT指数（QDII-LOF）C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

2018年1月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。2019年7月，根据南方基金管理股份有限公司股东大会决议，并经中国证监会核准，本公司原股东及新增股东共

同认购了本公司新增的注册资本，认购完成后注册资本为 36172 万元人民币。目前股权结构为：华泰证券股份有限公司 41.16%、深圳市投资控股有限公司 27.44%、厦门国际信托有限公司 13.72%、兴业证券股份有限公司 9.15%、厦门合泽吉企业管理合伙企业（有限合伙）1.72%、厦门合泽祥企业管理合伙企业（有限合伙）2.24%、厦门合泽益企业管理合伙企业（有限合伙）2.25%、厦门合泽盈企业管理合伙企业（有限合伙）2.32%。目前，公司总部设在深圳，在北京、上海、深圳、南京、成都、合肥等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至本报告期末，南方基金管理股份有限公司（不含子公司）管理资产规模超过 1.69 万亿元，旗下管理 296 只公募基金，多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户组合。

#### 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		
张其思	本基金基金经理	2021 年 3 月 26 日	-	8 年	波士顿大学数理金融硕士，特许金融分析师（CFA）、金融风险管理师（FRM），具有基金从业资格。曾就职于美国 Charles River Development、Citizens Financial Group，历任固定收益部分析员、资本管理部量化分析师。2017 年 4 月加入南方基金，历任数量化投资部研究员、指数投资部研究员、国际业务部研究员。2020 年 6 月 2 日至 2021 年 3 月 26 日，任南方原油基金经理助理；2021 年 3 月 26 日至今，任美国 REIT、南方原油基金经理。

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

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《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》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

#### 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

#### 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金无境外投资顾问。

#### 4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

#### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.4.1 公平交易制度的执行情况

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

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

##### 4.4.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 2 次，是由于投资组合的投资策略需要以及接受投资者申赎后被动增减仓位所致。

#### 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金的投资目标是通过指数化投资策略，力争获得与业绩比较基准相似的回报。在基金的管理中我们采用了全复制法跟踪标的指数，基金投资组合中的证券以贴近指数成分股的配比进行配置。

2022 年上半年，道琼斯美国精选 REIT 指数下跌 22.40%，经汇率调整后基金业绩基准下跌 15.37%；同期基金净值下跌 16.54%，业绩表现良好保持了对业绩基准的跟踪，并小幅优于业绩基准。

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

##### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金 A 份额净值为 1.1048 元,报告期内,份额净值增长率为-16.54%,同期业绩基准增长率为-15.37%;本基金 C 份额净值为 1.0851 元,报告期内,份额净值增长率为-16.71%,同期业绩基准增长率为-15.37%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美国经济当前已经从疫情期间采取的宽松政策撤出,进入了货币紧缩周期。美联储目前已经开始收回疫情以来实施的超量宽松货币政策,3 月份已经停止新增购债并开启了加息,6 月份启动了资产负债表的收缩。为了应对通胀,美国本轮紧缩力度预计将大于上一轮周期,利率上行的速度和幅度都将高于 2015 年至 2019 年的上一轮紧缩。未来市场面临的大环境将是货币政策逐步趋紧、无风险收益率上行趋势的局面。在极度宽松转向逐步正常化的背景下,企业融资能力和融资成本将逐渐不像宽松时期那么有利,实体经济的复苏速度预计会出现边际放缓。

美国经济方面,复苏基本见顶,此后由于经济政策的转向,势必全方位影响经济的增长。美国制造业 PMI 的中枢已经从 2021 年的 60 附近跌至二季度末的 53。美国整体就业恢复也基本见顶,在美联储通过紧缩政策抑制经济的情况下,预计薪资增速会放缓,对于居民消费也会起到影响。美国通胀韧性超预期,美联储关注的通胀指标 PCE 年率达到 6.3%,为近 30 年最高的水平附近。当前美国陷入不得不采取激进货币政策抑制通胀,但又难以避免伤及经济的境地,面临双向风险,如果货币政策过紧,经济容易出现硬着陆;而如果货币政策不够紧,通胀可能持续维持高位,最终仍将导致衰退。

2022 年上半年内,十年期美债利率在货币政策退出宽松的预期下迅速走高,上半年最高冲到 3.5%附近,引领美国房贷利率出现快速回升,从 2021 年年底的 3.11%上行至上半年末的 5.70%,为 2008 年次贷危机以来最高水平。

美国房地产市场方面,房价延续高增速,20 大中城市房价指数同比达到依然维持 20%的水平附近,为本世纪以来最高区间。二手房屋销售折年数回落至 500 余万套,降至疫情前水平,居民住房交投出现降温。

美元计价的道琼斯美国精选 REIT 全收益指数在 2022 年上半年震荡下行,其中一季度下跌后反弹,二季度在 4 月底至 5 月初、6 月上旬出现了两次下台阶,此后 6 月下半月出现一些反弹,上半年整体由 2021 年末的 14886.39 点跌至上半年末的 11739.20 点,下跌 22.40%。

展望后市,我们认为美国住房价格仍有惯性,但 REIT 价格难免受到美国货币政策收紧影响,跟随美股整体走势震荡。在美国快速加息的预期下,REIT 估值水平可能受到流动性收缩的冲击。在未来政策收紧节奏趋于平稳后,REIT 价格预计将重获支撑。整体我们对美国 REIT 表现短期内相对谨慎,中长期仍然保持乐观。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规的规定和基金合同的约定,以及本基金的实际运作情况,本基金报告期末未进行利润分配。在符合分红条件的前提下,本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分,将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

#### 4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

## § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内,南方道琼斯美国精选 REIT 指数证券投资基金(QDII)的管理人——南方基金管理股份有限公司在南方道琼斯美国精选 REIT 指数证券投资基金(QDII)的投资运作、

基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

### 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

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的南方道琼斯美国精选 REIT 指数证券投资基金（QDII）2022 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 中期财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

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

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	8,896,641.78	8,552,549.33
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	128,417,361.27	128,680,316.57
其中：股票投资		121,378,898.64	121,771,868.18
基金投资		7,038,462.63	6,908,448.39
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	-	-
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		97,674.29	-
应收股利		375,762.28	333,822.73

应收申购款		654,544.79	2,622,109.19
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	71,326.34	386.54
资产总计		138,513,310.75	140,189,184.36
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负债：			
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		-	415,716.04
应付赎回款		2,457,447.01	2,805,909.62
应付管理人报酬		89,751.51	88,612.34
应付托管费		28,047.35	27,691.36
应付销售服务费		15,138.83	14,088.03
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	91,489.42	200,934.72
负债合计		2,681,874.12	3,552,952.11
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	123,710,068.79	103,737,666.79
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	12,121,367.84	32,898,565.46
净资产合计		135,831,436.63	136,636,232.25
负债和净资产总计		138,513,310.75	140,189,184.36

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，南方道琼斯美国精选 REIT 指数（QDII-LOF）A 份额净值 1.1048 元，基金份额总额 80,904,235.93 份；南方道琼斯美国精选 REIT 指数（QDII-LOF）C 份额净值 1.0851 元，基金份额总额 42,805,832.86 份；总份额合计 123,710,068.79 份。

## 6.2 利润表

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

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
----	-----	---------------------------------------	-----------------------------------------------

一、营业总收入		-24,948,492.60	20,055,288.43
1.利息收入		8,401.38	5,777.13
其中：存款利息收入	6.4.7.13	8,224.00	5,403.40
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		-	-
其他利息收入		177.38	373.73
证券出借利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,614,218.01	2,669,258.34
其中：股票投资收益	6.4.7.14	1,207,434.94	-196,352.30
基金投资收益	6.4.7.15	-387,843.88	1,423,867.17
债券投资收益	6.4.7.16	-	-
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	1,794,626.95	1,441,743.47
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
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	-27,955,897.96	17,332,451.70
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		274,187.85	-71,186.51
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	110,598.12	118,987.77
减：二、营业总支出		985,464.91	918,140.30
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	536,101.25	441,135.12
2.托管费	6.4.10.2.2	167,531.69	137,854.76
3.销售服务费	6.4.10.2.3	85,748.42	74,482.18
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		1,062.00	5,125.92
8.其他费用	6.4.7.24	195,021.55	259,542.32
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-25,933,957.51	19,137,148.13



减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-25,933,957.51	19,137,148.13
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-25,933,957.51	19,137,148.13

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

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

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 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（基金净值）	103,737,666.79	-	32,898,565.46	136,636,232.25
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	103,737,666.79	-	32,898,565.46	136,636,232.25
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	19,972,402.00	-	-20,777,197.62	-804,795.62
（一）、综合收益总额	-	-	-25,933,957.51	-25,933,957.51
（二）、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）	19,972,402.00	-	5,156,759.89	25,129,161.89
其中：1.基金申购款	89,759,200.16	-	19,345,427.88	109,104,628.04
2.基金赎回款	-69,786,798.16	-	-14,188,667.99	-83,975,466.15
（三）、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）	-	-	-	-

(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	123,710,068.79	-	12,121,367.84	135,831,436.63
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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(基金净值)	80,087,484.14	-	-3,286,514.41	76,800,969.73
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	80,087,484.14	-	-3,286,514.41	76,800,969.73
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	41,051,386.40	-	20,785,264.99	61,836,651.39
（一）、综合收益总额	-	-	19,137,148.13	19,137,148.13
（二）、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）	41,051,386.40	-	1,648,116.86	42,699,503.26
其中：1.基金申购款	128,020,321.98	-	7,328,757.86	135,349,079.84
2.基金赎回款	-86,968,935.58	-	-5,680,641.00	-92,649,576.58
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	121,138,870.54	-	17,498,750.58	138,637,621.12

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_ 杨小松 \_\_\_\_

基金管理人负责人

\_\_\_\_ 徐超 \_\_\_\_

主管会计工作负责人

\_\_\_\_ 徐超 \_\_\_\_

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

### 6.4.2 会计报表的编制基础

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

### 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

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。除下述会计政策外，本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.4.1 会计年度

#### 6.4.4.2 记账本位币

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的

现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资、资产支持证券投资和基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### 新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3)该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

#### **6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则**

#### **6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

#### **6.4.4.7 实收基金**

#### **6.4.4.8 损益平准金**

#### **6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)

或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **6.4.4.10 费用的确认和计量**

#### **6.4.4.11 基金的收益分配政策**

#### **6.4.4.12 外币交易**



#### 6.4.4.13 分部报告

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

### 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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”), 财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》, 公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外, 中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》, 本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表, 对本基金财务报表的影响列示如下:

##### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定, 本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额, 2021 年度可比期间的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日, 本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日, 本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、应收利息、应收股利和应收申购款, 金额分别为 8,552,549.33 元、386.54 元、333,822.73 元和 2,622,109.19 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、其他资产-应收利息、应收股利和应收申购款, 金额分别为 8,552,935.87 元、0.00 元、333,822.73 元和 2,622,109.19 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产, 金额为 128,680,316.57 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产, 金额为 128,680,316.57 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债-其他应付款, 金额分别为 415,716.04

元、2,805,909.62 元、88,612.34 元、27,691.36 元、14,088.03 元和 4,873.56 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债-其他应付款，金额分别为 415,716.04 元、2,805,909.62 元、88,612.34 元、27,691.36 元、14,088.03 元和 4,873.56 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，本基金无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%

的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

## 6.4.7 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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	8,896,641.78
等于：本金	8,896,162.89
加：应计利息	478.89
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	8,896,641.78

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		129,076,219.95	-	121,378,898.64	-7,697,321.31
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		7,853,313.40	-	7,038,462.63	-814,850.77
其他		-	-	-	-
合计		136,929,533.35	-	128,417,361.27	-8,512,172.08

### 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

本基金本报告期末无衍生金融工具。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

### 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

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无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

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

### 6.4.7.6 其他债权投资

#### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

#### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

### 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

#### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

### 6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	71,326.34
合计	71,326.34

**6.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4,708.97
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	86,780.45
其他	-
合计	91,489.42

**6.4.7.10 实收基金**

金额单位：人民币元

南方道琼斯美国精选 REIT 指数（QDII-LOF）A		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	70,963,424.90	70,963,424.90
本期申购	43,394,136.46	43,394,136.46
本期赎回（以“-”号填列）	-33,453,325.43	-33,453,325.43
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	80,904,235.93	80,904,235.93

南方道琼斯美国精选 REIT 指数（QDII-LOF）C		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	32,774,241.89	32,774,241.89
本期申购	46,365,063.70	46,365,063.70
本期赎回（以“-”号填列）	-36,333,472.73	-36,333,472.73
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-

本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	42,805,832.86	42,805,832.86

#### 6.4.7.11 其他综合收益

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

南方道琼斯美国精选 REIT 指数（QDII-LOF）A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	4,478,575.05	18,496,808.45	22,975,383.50
本期利润	1,439,435.69	-18,937,933.24	-17,498,497.55
本期基金份额交易产生的变动数	801,753.71	2,199,850.04	3,001,603.75
其中：基金申购款	3,341,669.78	6,837,618.70	10,179,288.48
基金赎回款	-2,539,916.07	-4,637,768.66	-7,177,684.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,719,764.45	1,758,725.25	8,478,489.70

南方道琼斯美国精选 REIT 指数（QDII-LOF）C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	1,464,454.73	8,458,727.23	9,923,181.96
本期利润	582,504.76	-9,017,964.72	-8,435,459.96
本期基金份额交易产生的变动数	604,093.20	1,551,062.94	2,155,156.14
其中：基金申购款	2,669,930.43	6,496,208.97	9,166,139.40
基金赎回款	-2,065,837.23	-4,945,146.03	-7,010,983.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,651,052.69	991,825.45	3,642,878.14

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	8,224.00
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	8,224.00

#### 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,207,434.94
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	1,207,434.94

#### 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	16,140,173.65
减：卖出股票成本总额	14,920,054.90
减：交易费用	12,683.81
买卖股票差价收入	1,207,434.94

#### 6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无股票赎回差价收入。

#### 6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

#### 6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无证券出借差价收入。

#### 6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	10,666,066.36
减：卖出/赎回基金成本总额	11,049,461.67
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	4,448.57
基金投资收益	-387,843.88

注：上述交易费用（如有）包含基金买卖或申赎产生的交易费用。

#### 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

本基金本报告期内无债券投资收益。

##### 6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无买卖债券差价收入。

#### 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****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**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入****6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入****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****6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入****6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入****6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入****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**

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

**6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

**6.4.7.20 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,709,100.02
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	85,526.93
合计	1,794,626.95

**6.4.7.21 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-27,955,897.96
——股票投资	-26,336,948.05
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-1,618,949.91
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-



——期货投资	-
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	-27,955,897.96

#### 6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	109,610.57
其他	987.55
合计	110,598.12

注：本基金 A 类基金份额的场内基金、A 类基金份额的场外基金份额和 C 类基金份额的赎回费率按持有期间递减，A 类基金份额不低于赎回费总额的 25% 部分归入基金财产；C 类基金份额不低于赎回费总额的 75% 部分归入基金财产。

#### 6.4.7.23 信用减值损失

#### 6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	106,062.65
银行费用	189.00
其他	1,989.45
合计	195,021.55

指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提，逐日累计，按年支付。标的指数许可使用费的收取下限为每年美元 30,000 元，计费期间不足一年的，根据实际天数按比例计算。

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰香港	44,222,358.25	77.58%	13,360,008.46	25.41%

##### 6.4.10.1.2 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期基金成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华泰香港	14,255,399.11	60.73%	15,956,687.59	44.94%

##### 6.4.10.1.3 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。

##### 6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰香港	9,996.06	59.43%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

华泰香港	20,375.89	43.63%	-	-
------	-----------	--------	---	---

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

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

#### 6.4.10.2 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	536,101.25	441,135.12
其中：支付销售机构的客户维护费	193,041.58	151,440.52

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.80% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	167,531.69	137,854.76

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方道琼斯美国精选 REIT 指数 (QDII-LOF) A	南方道琼斯美国精选 REIT 指数 (QDII-LOF) C	合计
工商银行	-	1,500.23	1,500.23
华泰证券	-	393.54	393.54
南方基金	-	1,470.85	1,470.85
兴业证券	-	0.20	0.20
合计	-	3,364.82	3,364.82

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方道琼斯美国精选 REIT 指数 (QDII-LOF) A	南方道琼斯美国精选 REIT 指数 (QDII-LOF) C	合计
工商银行	-	-	-
华泰证券	-	432.11	432.11
南方基金	-	1,619.37	1,619.37
兴业证券	-	124.08	124.08
合计	-	2,175.56	2,175.56

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给南方基金，再由南方基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.40% / 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

本基金本报告期内及上年度可比期间无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

本基金本报告期内及上年度可比期间无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。

##### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间无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。

#### 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固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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
布朗兄弟哈里曼银行	3,022,372.21	636.44	5,387,765.52	-
中国工商银行	5,874,269.57	7,587.56	4,314,575.31	5,403.40

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司和境外托管人布朗兄弟哈里曼银行保管，按银行约定利率计息。

#### 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无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2022 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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 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因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

###### 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

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

本基金为指数型基金，主要投资于道琼斯美国精选 REIT 指数的成份券、备选成份券、以道琼斯美国精选 REIT 指数为投资标的的指数基金(包括 ETF)等，在证券投资基金中属于较高预期风险和预期收益的基金品种。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，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四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，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；在管理层层面设立风险控制委员会，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和风险管理部负责，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，督察长负责组织指导监察稽核工作。

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同责任，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及境外资产托管人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。本基金在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算；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。

于 2022 年 06 月 30 日，本基金无债券投资(2021 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 2022 年 06 月 30 日,本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

本基金本报告期末及上年度末无金融资产和金融负债的到期期限分析。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间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“期末本基金持有的流通受限证券”。此外,如根据基金合同的规定,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 2022 年 06 月 30 日,本基金无流动性受限资产。

同时,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逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,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未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2022 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	5,874,269.57	-	-	3,022,372.21	8,896,641.78
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	128,417,361.27	128,417,361.27
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	97,674.29	97,674.29
应收股利	-	-	-	375,762.28	375,762.28
应收申购款	18,535.03	-	-	636,009.76	654,544.79
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	71,326.34	71,326.34
资产总计	5,892,804.60	-	-	132,620,506.15	138,513,310.75
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	-	-	-	2,457,447.01	2,457,447.01
应付管理人报酬	-	-	-	89,751.51	89,751.51
应付托管费	-	-	-	28,047.35	28,047.35
应付销售服务费	-	-	-	15,138.83	15,138.83
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	-	-	-	91,489.42	91,489.42
负债总计	-	-	-	2,681,874.12	2,681,874.12
利率敏感度缺口	5,892,804.60	-	-	129,938,632.03	135,831,436.63
上年度末 2021 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	2,241,870.57	-	-	6,310,678.76	8,552,549.33
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	128,680,316.57	128,680,316.57
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	333,822.73	333,822.73
应收申购款	22,209.00	-	-	2,599,900.19	2,622,109.19
递延所得税	-	-	-	-	-

资产					
其他资产	-	-	-	386.54	386.54
资产总计	2,264,079.57	-	-	137,925,104.79	140,189,184.36
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	-	-	-	415,716.04	415,716.04
应付赎回款	-	-	-	2,805,909.62	2,805,909.62
应付管理人报酬	-	-	-	88,612.34	88,612.34
应付托管费	-	-	-	27,691.36	27,691.36
应付销售服务费	-	-	-	14,088.03	14,088.03
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	-	-	-	200,934.72	200,934.72
负债总计	-	-	-	3,552,952.11	3,552,952.11
利率敏感度缺口	2,264,079.57	-	-	134,372,152.68	136,636,232.25

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金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 2022 年 6 月 30 日
----	---------------------

	美元折合 人民币	港币折合 人民币	欧元折合 人民币	日元折合 人民币	其他币种 折合人民 币	合计
以外币计 价的资产						
银行存款	3,022,372.2 1	-	-	-	-	3,022,372.2 1
交易性金 融资产	128,417,36 1.27	-	-	-	-	128,417,36 1.27
应收股利	375,762.28	-	-	-	-	375,762.28
其他资产	71,326.34	-	-	-	-	71,326.34
应收证券 清算款	97,674.29	-	-	-	-	97,674.29
资产合计	131,984,49 6.39	-	-	-	-	131,984,49 6.39
以外币计 价的负债						
负债合计	-	-	-	-	-	-
资产负债 表外汇风 险敞口净 额	131,984,49 6.39	-	-	-	-	131,984,49 6.39

项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日					
	美元折合 人民币	港币折合 人民币	欧元折合 人民币	日元折合 人民币	其他币种 折合人民 币	合计
以外币计 价的资产						
银行存款	6,310,698.4 0	-	-	-	-	6,310,698.4 0
交易性金 融资产	128,680,31 6.57	-	-	-	-	128,680,31 6.57
应收股利	333,822.73	-	-	-	-	333,822.73
资产合计	135,324,83 7.70	-	-	-	-	135,324,83 7.70
以外币计 价的负债						
其他负债	38,306.16	-	-	-	-	38,306.16
应付证券 清算款	415,716.04	-	-	-	-	415,716.04
负债合计	454,022.20	-	-	-	-	454,022.20
资产负债	134,870,81	-	-	-	-	134,870,81

表外汇风险敞口净额	5.50					5.50
-----------	------	--	--	--	--	------

#### 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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	6,599,224.82	6,743,540.78
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-6,599,224.82	-6,743,540.78

#### 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的基金及股票，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。本基金投资于道琼斯美国精选 REIT 指数成份券、备选成份券及以道琼斯美国精选 REIT 指数为投资标的的指数基金（包括 ETF）的投资比例不低于基金资产的 90%。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

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	121,378,898.64	89.36	121,771,868.18	89.12
交易性金融资产-	7,038,462.63	5.18	6,908,448.39	5.06

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	128,417,361.27	94.54	128,680,316.57	94.18

#### 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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	1.组合自身基准上升 5%	6,467,399.28	6,452,000.23
	2.组合自身基准下降 5%	-6,467,399.28	-6,452,000.23

#### 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

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日
第一层次	128,417,361.27
第二层次	0.00
第三层次	0.00
合计	128,417,361.27

###### 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，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 2022 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。

**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**

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

**§ 7 投资组合报告****7.1 期末基金资产组合情况**

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	121,378,898.64	87.63
	其中：普通股	-	-
	房地产信托凭证	121,378,898.64	87.63
2	基金投资	7,038,462.63	5.08
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	8,896,641.78	6.42
8	其他资产	1,199,307.70	0.87
9	合计	138,513,310.75	100.00

**7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布**

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
美国	121,378,898.64	89.36

合计	121,378,898.64	89.36
----	----------------	-------

### 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

#### 7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
保健 REIT	13,366,634.83	9.84
酒店 REIT	4,208,836.59	3.10
住宅 REIT	26,430,213.87	19.46
工业 REIT	19,749,789.27	14.54
多种资产类别 REIT	3,508,503.27	2.58
办公楼 REIT	10,242,041.84	7.54
停车场 REIT	-	-
零售 REIT	19,228,404.42	14.16
自助仓库 REIT	11,877,136.86	8.74
数据中心 REIT	12,336,464.20	9.08
特种 REIT	430,873.49	0.32
特殊与其他 REIT	-	-
合计	121,378,898.64	89.36

注：比例由于单项和汇总原因，有可能存在尾差。本基金对以上行业分类采用彭博行业分类标准。

#### 7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的权益投资。

### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

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

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

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	Prologis Inc	安博	PLD UN	纽约证券交易所	美国	13,956	11,019,604.71	8.11
2	Equinix Inc	Equinix 有限公司	EQIX US	美国证券交易所	美国	1,716	7,566,743.23	5.57
3	Public Storage	公共存储公司	PSA UN	纽约证券交易所	美国	2,901	6,087,613.42	4.48

				所				
4	Realty Income Corp	Realty Income 公司	O UN	纽约证券交易所	美国	11,256	5,156,600.57	3.80
5	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	5,474	4,769,720.97	3.51
6	Welltower Inc	Welltower 股份有限公司	WELL UN	纽约证券交易所	美国	8,494	4,694,496.11	3.46
7	Simon Property Group Inc	西蒙房地产集团公司	SPG UN	纽约证券交易所	美国	6,144	3,914,011.16	2.88
8	Avalon Bay Communities Inc	Avalon Bay 社区股份有限公司	AVB UN	纽约证券交易所	美国	2,616	3,410,451.60	2.51
9	Equity Residential	公寓物业权益信托	EQR UN	纽约证券交易所	美国	6,403	3,103,516.86	2.28
10	Extra Space Storage Inc	额外空间仓储公司	EXR UN	纽约证券交易所	美国	2,513	2,869,201.08	2.11
11	Invitation Homes Inc	邀请家园公司	INVH UN	纽约证券交易所	美国	11,862	2,832,546.10	2.09
12	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	2,893	2,815,914.11	2.07
13	Duke Realty Corp	杜克房地产公司	DRE UN	纽约证券交易所	美国	7,193	2,652,716.76	1.95
14	Ventas Inc	Ventas 公司	VTR UN	纽约证券交易所	美国	7,479	2,581,506.25	1.90
15	Sun	Sun	SUI UN	纽约证	美国	2,408	2,575,4	1.90



	Communities Inc	Communities 公司		券交易所			25.12	
16	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	2,160	2,532,125.31	1.86
17	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	1,299	2,279,872.58	1.68
18	WP Carey Inc	WP Carey 股份有限公司	WPC UN	纽约证券交易所	美国	3,743	2,081,507.02	1.53
19	Camden Property Trust	Camden 房地产信托公司	CPT UN	纽约证券交易所	美国	2,122	1,915,209.13	1.41
20	UDR Inc	UDR 公司	UDR UN	纽约证券交易所	美国	5,944	1,836,653.54	1.35
21	Healthpeak Properties Inc	Healthpeak 物业股份有限公司	PEAK UN	纽约证券交易所	美国	10,095	1,755,443.52	1.29
22	Boston Properties Inc	波士顿地产公司	BXP UN	纽约证券交易所	美国	2,795	1,669,119.14	1.23
23	Kimco Realty Corp	Kimco 房地产公司	KIM UN	纽约证券交易所	美国	11,889	1,577,484.57	1.16
24	Equity Lifestyle Properties Inc	Equity Lifestyle 房地产公司	ELS UN	纽约证券交易所	美国	3,328	1,573,985.45	1.16
25	Host Hotels	Host 酒店及度	HST UW	纳斯达克证券	美国	14,193	1,493,596.84	1.10

	& Resorts Inc	假股份 有限公 司		交易所				
26	America n Homes 4 Rent	America n Homes 4 Rent	AMH UN	纽约证 券交易 所	美国	5,652	1,344,3 39.59	0.99
27	CubeSm art	CubeSm art	CUBE UN	纽约证 券交易 所	美国	4,303	1,233,7 17.47	0.91
28	Regenc y Centers Corp	Regenc y Centers 公司	REG UN	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,026	1,204,5 08.78	0.89
29	Rexford Industri al Realty Inc	Rexford Industri al Realty 股份有 限公司	REXR UN	纽约证 券交易 所	美国	3,083	1,191,6 08.87	0.88
30	America n Campus Communi ties Inc	美国校 园社区 公司	ACC UN	纽约证 券交易 所	美国	2,737	1,184,2 55.99	0.87
31	Life Storage Inc	Life 仓 储公司	LSI UN	纽约证 券交易 所	美国	1,578	1,182,5 45.19	0.87
32	Medical Properti es Trust Inc	Medical Properti es Trust 股份有 限公司	MPW UN	纽约证 券交易 所	美国	11,499	1,178,4 52.91	0.87
33	Americ old Realty Trust	Americ old Realty Trust	COLD UN	美国证 券交易 所	美国	5,541	1,117,1 23.54	0.82
34	National Retail Properti es Inc	National 零售地 产股份 有限公 司	NNN UN	纽约证 券交易 所	美国	3,449	995,347 .60	0.73
35	Federal	联邦房	FRT2	纽约证	美国	1,345	864,228	0.64

	Realty Investm ent Trust	地产投资信托公司	UN	券交易所			.99	
36	EastGro up Properti es Inc	EastGro up 房地 产公司	EGP UN	纽约证 券交易 所	美国	800	828,616 .29	0.61
37	First Industri al Realty Trust Inc	第一工 业地产 信托公 司	FR UN	纽约证 券交易 所	美国	2,562	816,399 .93	0.60
38	Omega Healthc are Investor s Inc	Omega Healthc are Investor s 有限 公司	OHI UN	纽约证 券交易 所	美国	4,284	810,508 .66	0.60
39	Apartm ent Income REIT Corp	Apartm ent Income REIT Corp	AIRC UN	纽约证 券交易 所	美国	2,884	805,196 .19	0.59
40	Healthc are 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	4,249	795,902 .17	0.59
41	STORE Capital Corp	STORE 资本公 司	STOR UN	纽约证 券交易 所	美国	4,490	785,899 .57	0.58
42	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	5,731	777,337 .91	0.57
43	Kilroy Realty Corp	Kilroy 房地 产公司	KRC UN	纽约证 券交易 所	美国	2,057	722,433 .96	0.53
44	Agree Realty Corp	艾格里 不动产 公司	ADC UN	纽约证 券交易 所	美国	1,451	702,419 .35	0.52

45	STAG Industrial Inc	STAG 实业公司	STAG UN	纽约证券交易所	美国	3,093	641,018.16	0.47
46	Spirit Realty Capital Inc	Spirit 房地产资本股份有限公司	SRC UN	纽约证券交易所	美国	2,318	587,744.41	0.43
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	2,719	533,397.71	0.39
48	Terreno Realty Corp	Terreno 房地产公司	TRNO UN	纽约证券交易所	美国	1,424	532,613.48	0.39
49	Vornado Realty Trust	沃那多房地产信托	VNO UN	纽约证券交易所	美国	2,755	528,626.44	0.39
50	Independence Realty Trust Inc	独立房地产信托有限公司	IRT UN	纽约证券交易所	美国	3,792	527,570.81	0.39
51	National Storage Affiliates Trust	美国全国仓储联营信托	NSA UN	纽约证券交易所	美国	1,500	504,059.70	0.37
52	Ryman Hospitality Properties Inc	Ryman 酒店房地产股份有限公司	RHP UN	纽约证券交易所	美国	973	496,490.51	0.37
53	Healthcare Realty Trust Inc	医疗保健房地产信托公司	HR UN	纽约证券交易所	美国	2,649	483,575.16	0.36
54	Kite Realty Group Trust	凯特地产信托	KRG UN	纽约证券交易所	美国	4,053	470,310.55	0.35
55	Douglas Emmett Inc	Douglas Emmett 股份有	DEI UN	纽约证券交易所	美国	3,085	463,370.49	0.34

		限公司						
56	Highw ods Properti es Inc	海伍兹 房地产 公司	HIW UN	纽约证 券交易 所	美国	1,946	446,534 .54	0.33
57	EPR Properti es	EPR Properti es	EPR UN	纽约证 券交易 所	美国	1,368	430,873 .49	0.32
58	PS Busines s Parks Inc	PS 商业 园股份 有限公司	PSB UN	纽约证 券交易 所	美国	341	428,309 .13	0.32
59	Equity Commo nwealth	Commo nWealth 房地产 投资信 托	EQC UN	纽约证 券交易 所	美国	2,249	415,536 .13	0.31
60	Broadst one Net Lease Inc	Broadst one Net Lease Inc	BNL UN	纽约证 券交易 所	美国	2,900	399,187 .36	0.29
61	Park Hotels & Resorts Inc	派克酒 店及度 假酒店 公司	PK UN	纽约证 券交易 所	美国	4,371	398,083 .13	0.29
62	SL Green Realty Corp	SL Green 房地产 公司	SLG3 UN	纽约证 券交易 所	美国	1,182	366,102 .17	0.27
63	LXP Industri al Trust	LXP 工 业信托	LXP UN	纽约证 券交易 所	美国	5,077	365,952 .37	0.27
64	Corpora te Office Properti es Trust	Corpora te 办公 物业信 托公司	OFC UN	纽约证 券交易 所	美国	2,066	363,144 .06	0.27
65	Apple Hospital ity REIT Inc	Apple Hospital ity 房地 产投资 信托基 金	APPLE UN	纽约证 券交易 所	美国	3,552	349,716 .56	0.26

66	Innovative Industrial Properties Inc	Innovative 工业地产股份有限公司	IIPR UN	纽约证券交易所	美国	459	338,458.12	0.25
67	National Health Investors Inc	National Health Investors 股份有限公司	NHI UN	纽约证券交易所	美国	830	337,625.70	0.25
68	Essential Properties Realty Trust Inc	Essential Properties Realty Trust Inc	EPRT UN	纽约证券交易所	美国	2,200	317,301.57	0.23
69	JBG SMITH Properties	JBG SMITH 房地产	JBGS UN	纽约证券交易所	美国	1,947	308,906.14	0.23
70	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	2,823	281,162.83	0.21
71	SITE Centers Corp	SITE Centers 公司	SITC UN	纽约证券交易所	美国	3,069	277,445.45	0.20
72	Pebblebrook Hotel Trust	Pebblebrook 酒店信托公司	PEB UN	纽约证券交易所	美国	2,420	269,123.11	0.20
73	Sunstone Hotel Investors Inc	Sunstone 酒店投资者公司	SHO UN	纽约证券交易所	美国	3,969	264,244.46	0.19
74	Four Corners Property Trust Inc	Four Corners 房地产信托股份有限公司	FCPT UN	纽约证券交易所	美国	1,400	249,838.58	0.18

75	Retail Opportunity Investments Corp	Retail Opportunity 投资公司	ROIC UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,182	231,086.66	0.17
76	RLJ Lodging Trust	RLJ Lodging 信托	RLJ UN	纽约证券交易所	美国	3,020	223,560.76	0.16
77	Urban Edge Properties	Urban Edge 房地产	UE UN	纽约证券交易所	美国	2,182	222,739.42	0.16
78	Washington Real Estate Investment Trust	华盛顿房地产投资信托	WRE UN	纽约证券交易所	美国	1,556	222,539.02	0.16
79	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	2,255	219,900.03	0.16
80	CareTrust REIT Inc	CareTrust REIT 有限公司	CTRE UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,770	219,052.04	0.16
81	Macerich Co/The	Macerich 公司	MAC UN	纽约证券交易所	美国	3,599	210,384.20	0.15
82	Piedmont Office Realty Trust Inc	皮德蒙特办公地产信托有限公司	PDM UN	纽约证券交易所	美国	2,283	201,026.30	0.15
83	DiamondRock Hospitality Co	DiamondRock Hospital ity 公司	DRH UN	纽约证券交易所	美国	3,626	199,794.75	0.15
84	Brandy	Brandy	BDN	纽约证	美国	3,081	199,334	0.15

	wine Realty Trust	wine 房 地产信 托	UN	券交易 所			.22	
85	Tanger Factory Outlet Centers Inc	坦格尔 工厂直 销中心	SKT UN	纽约证 券交易 所	美国	2,024	193,162 .68	0.14
86	Easterly Govern ment Properti es Inc	Easterly 政府物 业股份 有限公 司	DEA UN	纽约证 券交易 所	美国	1,495	191,038 .66	0.14
87	Acadia Realty Trust	阿卡迪 亚不动 产信托	AKR UN	纽约证 券交易 所	美国	1,776	186,181 .75	0.14
88	LTC Properti es Inc	LTC 房 地产公 司	LTC UN	纽约证 券交易 所	美国	720	185,508 .47	0.14
89	NexPoi nt Residen tial Trust Inc	NexPoi nt 住宅 信托股 份有限 公司	NXRT UN	纽约证 券交易 所	美国	440	184,593 .03	0.14
90	America n Assets Trust Inc	美国资 产信托 公司	AAT UN	纽约证 券交易 所	美国	920	183,382 .29	0.14
91	Global Net Lease Inc	Global Net 租 赁股份 有限公 司	GNL UN	纽约证 券交易 所	美国	1,670	158,705 .82	0.12
92	Paramo unt Group Inc	百乐门 集团有 限公司	PGRE UN	纽约证 券交易 所	美国	3,060	148,481 .67	0.11
93	Veris Residen tial Inc	Veris 住 宅股份 有限公 司	VRE UN	纽约证 券交易 所	美国	1,664	147,861 .27	0.11
94	Empire State	Empire State 房	ESRT UN	纽约证 券交易	美国	3,100	146,261 .54	0.11



	Realty Trust Inc	地产信托公司		所				
95	Office Properties Income Trust	政府资产收益信托	OPI UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,050	140,587.05	0.10
96	Centerspace	Centerspace	CSR UN	纽约证券交易所	美国	250	136,828.67	0.10
97	Getty Realty Corp	Getty 房地产公司	GTU UN	纽约证券交易所	美国	680	120,939.43	0.09
98	Industrial Logistics Properties Trust	Industrial Logistics Properties Trust	ILPT UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,200	113,395.81	0.08
99	Community Healthcare Trust Inc	社区保健信托股份有限公司	CHCT UN	纽约证券交易所	美国	443	107,657.77	0.08
100	Service Properties Trust	Service Properties Trust 公司	SVC UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,033	106,460.19	0.08
101	RPT Realty	Ramco-Gershenson 房地产信托	RPT UN	纽约证券交易所	美国	1,500	98,959.59	0.07
102	Necessity Retail REIT Inc/The	Necessity Retail REIT Inc/The	RTL UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,990	97,229.39	0.07
103	Apartment Investment and Manage	公寓投资与管理	AIV UN	美国证券交易所	美国	2,208	94,840.14	0.07

	ment Co							
104	UMH Properties Inc	UMH 房地产股份有限公司	UMH US	美国证券交易所	美国	783	92,803.76	0.07
105	Universal Health Realty Income Trust	Universal Health 不动产投资信托	UHT UN	纽约证券交易所	美国	247	88,207.06	0.06
106	NETST REIT Corp	NETST REIT Corp	NTST UN	纽约证券交易所	美国	667	84,471.63	0.06
107	Global Medical REIT Inc	环球医疗 REIT 股份有限公司	GMRE UN	纽约证券交易所	美国	1,100	82,905.92	0.06
108	Summit Hotel Properties Inc	Summit 酒店物业公司	INN UN	纽约证券交易所	美国	1,643	80,165.06	0.06
109	Plymouth Industrial REIT Inc	Plymouth Industrial REIT Inc	PLYM US	美国证券交易所	美国	594	69,924.47	0.05
110	Orion Office REIT Inc	Orion Office REIT Inc	ONL UN	纽约证券交易所	美国	859	63,185.41	0.05
111	Chatham Lodging Trust	Chatham Lodging 信托	CLDT UN	纽约证券交易所	美国	870	61,016.69	0.04
112	City Office REIT Inc	City Office REIT 股份有限公司	CIO UN	纽约证券交易所	美国	630	54,754.96	0.04
113	Diversified Healthcare	多元化医疗保健信托公司	DHC UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,749	45,793.09	0.03

	Trust							
114	Franklin Street Properties Corp	Franklin Street 物业公司	FSP UA	纽约证券交易所	美国	1,260	35,263.04	0.03
115	Hersha Hospital ity Trust	Hersha 酒店信托	HT UN	纽约证券交易所	美国	450	29,627.48	0.02
116	Ashford Hospital ity Trust Inc	Ashford 酒店信托公司	AHT UN	纽约证券交易所	美国	425	17,057.02	0.01

本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

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

本基金本报告期末未持有积极投资的权益投资。

### 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

#### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	Equinix Inc	EQIX US	7,634,811.99	5.59
2	Prologis Inc	PLD UN	6,223,751.76	4.55
3	Public Storage	PSA UN	2,829,145.70	2.07
4	Simon Property Group Inc	SPG UN	1,920,820.25	1.41
5	Welltower Inc	WELL UN	1,787,924.25	1.31
6	Digital Realty Trust Inc	DLR UN	1,764,314.49	1.29
7	Realty Income Corp	O UN	1,710,204.22	1.25
8	AvalonBay Communities Inc	AVB UN	1,484,560.24	1.09
9	Equity Residential	EQR UN	1,379,441.14	1.01
10	Extra Space Storage Inc	EXR UN	1,284,653.86	0.94
11	Alexandria Real Estate Equities Inc	ARE UN	1,168,222.91	0.85
12	Mid-America	MAA UN	853,739.05	0.62

	Apartment Communities Inc			
13	Invitation Homes Inc	INVH UN	821,019.28	0.60
14	Essex Property Trust Inc	ESS UN	696,671.02	0.51
15	Ventas Inc	VTR UN	672,324.25	0.49
16	Duke Realty Corp	DRE UN	566,716.97	0.41
17	Sun Communities Inc	SUI UN	558,093.96	0.41
18	Healthpeak Properties Inc	PEAK UN	553,298.08	0.40
19	Camden Property Trust	CPT UN	528,371.58	0.39
20	UDR Inc	UDR UN	494,681.68	0.36

1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2、买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，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

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	Prologis Inc	PLD UN	4,114,713.44	3.01
2	Public Storage	PSA UN	1,786,203.03	1.31
3	Simon Property Group Inc	SPG UN	1,250,160.25	0.91
4	Digital Realty Trust Inc	DLR UN	1,005,776.61	0.74
5	Welltower Inc	WELL UN	998,408.79	0.73
6	AvalonBay Communities Inc	AVB UN	937,804.57	0.69
7	Equity Residential	EQR UN	924,148.39	0.68
8	Realty Income Corp	O UN	844,351.58	0.62
9	Extra Space Storage Inc	EXR UN	820,221.06	0.60
10	Mid-America Apartment Communities Inc	MAA UN	480,425.52	0.35
11	Alexandria Real Estate Equities	ARE UN	470,495.40	0.34

	Inc			
12	Duke Realty Corp	DRE UN	435,060.54	0.32
13	Ventas Inc	VTR UN	399,552.73	0.29
14	Invitation Homes Inc	INVH UN	287,341.58	0.21
15	Healthpeak Properties Inc	PEAK UN	277,898.14	0.20
16	Sun Communities Inc	SUI UN	215,630.59	0.16
17	Essex Property Trust Inc	ESS UN	210,498.79	0.15
18	Boston Properties Inc	BXP UN	185,829.17	0.14
19	Camden Property Trust	CPT UN	158,094.50	0.12
20	UDR Inc	UDR UN	107,478.30	0.08

1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2、卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	41,094,950.95
卖出收入（成交）总额	16,140,173.65

买入成本和卖出收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

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

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值 (元)	占基金资产 净值比例(%)
1	SPDR Dow Jones REIT ETF	ETF	交易型开放式	State Street Global Advisors Inc	7,038,462.63	5.18

## 7.11 投资组合报告附注

**7.11.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明**

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

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

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

## 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收清算款	97,674.29
3	应收股利	375,762.28
4	应收利息	-
5	应收申购款	654,544.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	71,326.34
8	其他	-
9	合计	1,199,307.70

## 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
南方道琼斯美国精选 REIT 指数（QDII-LOF）A	13,273	6,095.40	3,273,662.85	4.05%	77,630,573.08	95.95%
南方道琼斯美国精选 REIT 指数（QDII-LOF）C	8,985	4,764.14	24,048.41	0.06%	42,781,784.45	99.94%
合计	22,258	5,558.00	3,297,711.26	2.67%	120,412,357.53	97.33%

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

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	王文波	613,890.00	6.27%
2	邵常红	469,649.00	4.80%
3	汪银银	226,700.00	2.32%
4	王健峰	183,102.00	1.87%

5	鲁曼	180,000.00	1.84%
6	魏萍	168,059.00	1.72%
7	高轩	168,000.00	1.72%
8	柯泽伟	160,000.00	1.63%
9	张宁	157,219.00	1.61%
10	王鑫	155,500.00	1.59%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	南方道琼斯美国精选 REIT 指数（QDII-LOF）A	261,679.16	0.3234%
	南方道琼斯美国精选 REIT 指数（QDII-LOF）C	-	-
	合计	261,679.16	0.2115%

注：分级基金管理人的从业人员持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方道琼斯美国精选 REIT 指数（QDII-LOF）A	南方道琼斯美国精选 REIT 指数（QDII-LOF）C
基金合同生效日(2017 年 10 月 26 日)基金份额总额	86,001,416.95	185,025,043.39
本报告期期初基金份额总额	70,963,424.90	32,774,241.89
本报告期基金总申购份额	43,394,136.46	46,365,063.70
减：报告期基金总赎回份额	33,453,325.43	36,333,472.73
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	80,904,235.93	42,805,832.86



注:报告截止日 2022 年 6 月 30 日,南方道琼斯美国精选 REIT 指数证券投资基金份额总额 123,710,068.79 份,其中 A 类基金份额为 80,904,235.93 份,C 类基金份额为 42,805,832.86 份。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末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

2022 年 5 月 27 日,周易先生任南方基金管理股份有限公司董事长(法定代表人)。

本报告期内,基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内,无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内,无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内,基金管理人收到中国证券监督管理委员会深圳监管局对公司的监管措施。基金管理人已及时按要求改正并报告。

本报告期内,基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	----	------	-----------	----

	单元 数量	成交金额	占当期股 票成交总 额的比例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
Huatai Financial Holdings (Hong Kong) Limited	-	44,222,358.25	77.58%	9,996.06	59.43%	-
China Internation al Capital Corporatio n Hong Kong Securities Limited	-	12,781,848.85	22.42%	6,823.35	40.57%	-

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

A：选择标准

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

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

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

C：报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

新增交易单元：

无

退租交易单元：

无

## 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
Huatai Financial Holdings (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	14,255,399.11	60.73%
China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	-	-	-	-	-	-	9,217,943.10	39.27%

## 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	关于南方道琼斯美国精选 REIT 指数证券投资基金（QDII-LOF）2022 年境外主要市场节假日申购赎回安排的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-05
2	关于南方道琼斯美国精选 REIT 指数证券投资基金（QDII-LOF）2022 年 1 月 17 日暂停申购、赎回和定投业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-12
3	南方基金关于调整中国银行各交易渠道基金申购费率优惠标准的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-18
4	关于南方道琼斯美国精选 REIT 指数证券投资基金（QDII-LOF）2022 年 2 月 21 日暂停申购、赎回和定投业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-02-16
5	关于南方道琼斯美国精选 REIT 指数证券投资基金（QDII-LOF）2022 年 4 月 15 日暂停申购、赎回和定投业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-12
6	南方基金管理股份有限公司关于旗下部分公开	中国证券报、基金管	2022-05-17

	募集证券投资基金增加侧袋机制并相应修订基金合同有关条款的公告	理人网站、中国证监会基金电子披露网站	
7	关于南方道琼斯美国精选 REIT 指数证券投资基金(QDII-LOF)2022 年 5 月 30 日暂停申购、赎回和定投业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-25
8	关于南方道琼斯美国精选 REIT 指数证券投资基金(QDII-LOF)2022 年 6 月 20 日暂停申购、赎回和定投业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-06-15
9	关于南方道琼斯美国精选 REIT 指数证券投资基金(QDII-LOF)2022 年 7 月 4 日暂停申购、赎回和定投业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-06-29

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方道琼斯美国精选 REIT 指数证券投资基金(QDII-LOF)的文件;
- 2、《南方道琼斯美国精选 REIT 指数证券投资基金(QDII-LOF)基金合同》;
- 3、《南方道琼斯美国精选 REIT 指数证券投资基金(QDII-LOF)托管协议》;
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照;
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告;
- 6、《南方道琼斯美国精选 REIT 指数证券投资基金(QDII-LOF)2022 年中期报告》原文。

### 12.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

### 12.3 查阅方式

网站: <http://www.nffund.com>

