

广发美国房地产指数证券投资基金

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家 (地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产 净值比例(%)
1	SMOEN PRCP: ERTY GROUP INC	-	SPG US	纽约证 券交易 所	美国	18,860.00	17,496,503.17	9.30
	PUBLIC:			纽约证				

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家 (地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产 净值比例(%)
1	SMOEN PRCP: ERTY GROUP INC	-	SPG US	纽约证 券交易 所	美国	18,860.00	17,496,503.17	9.30
	PUBLIC:			纽约证				

2	STORAGE	PSA US	泰交所	美国	8,882.00	8,151,059.26	4.33	
3	PROLOGIS INC	PLD US	纽约证交所	美国	29,768.00	6,706,148.58	3.56	
4	EQUITY RESTRUCTURAL	公物物业权益信托	EQR US	纽约证交所	美国	20,813.00	6,582,032.22	3.50
5	VENUSTIAN	Ventus 公	VTR US	纽约证交所	美国	17,737.00	6,194,300.17	3.29

	INC			南				
6	HCP INC	HCP公司	HCP US	纽约证 券交易 所	美国	27,629.00	6,118,149.40	3.25
7	BOSTO N PRIME ENTERES INC	波士顿地 产公司	BXP US	纽约证 券交易 所	美国	9,254.00	5,662,946.92	3.01
	HEALT H CARE INC	Health		纽约证				

8	REIT INC.	REIT公司	HCN US	泰易斯	美国	17,117.00	5,590,599.34	2.97
9	VOR-NAED-REALTY TRUST	沃那多房地产信托	VNCO US	纽约逆泰易斯	美国	10,193.00	5,517,916.85	2.93
10	AVL-CONB-OMAY	AvlandRay 平托雷公司	AVR US	纽约逆泰易斯	美国	7,470.00	5,384,648.56	2.86

注：本基金投资于上述资产类别采用当前市场代码。					
8.5.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例 (%)	
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	SPG US	28,667,582.51	15.24	

2	PUBLIC STORAGE	PSA US	14,233,160.19	7.57
3	HCP INC	HCP US	11,477,151.15	6.30
4	VENTAS INC	VLD US	11,181,065.05	5.94
5	PROLOGIS INC	PLD US	11,092,459.27	5.90
6	EQUITY RESIDENTIAL	EQR US	11,091,182.26	5.90
7	HEALTH CARE REIT INC	HCN US	10,653,531.88	5.66
8	AVANALIMY COMMUNITIES INC	AVB US	9,643,522.31	5.13
9	BOSTON PROPERTIES	BXP US	9,621,727.45	5.11

	INC	VNO US	7,809,344.97	4.57
10	VORNADO REALTY TRUST	VNO US	8,599,344.97	4.57
11	HST HOTELS & RESORTS INC	HST US	7,820,777.51	4.16
12	GENERAL GROWTH PROPERTIES	GGP US	5,776,248.82	3.07
13	KIMCO REALTY CORP*	KIM US	5,280,940.62	2.81
14	SILVERGREEN REALTY CORP*	SLG US	4,982,515.96	2.63

15	MACY COS CO/THE REALITY INCOME CORP	MAC US	4,933,716.95	2.62
16	REALITY INCOME CORP	O US	4,910,945.41	2.61
17	DIGITAL REALTY TRUST INC	DRLR US	4,191,287.14	2.23
18	FEDERAL REALTY INVS TRUST	FRT US	4,063,612.78	2.16
19	UDR INC	UDR US	3,596,698.31	1.91
20	ESSEX PROPERTY TRUST INC	ESS US	3,510,200.12	1.87

注：本表格为根据美国上市公司披露信息，按市值从高到低的排序，每股收盘价、持仓股数、持仓市值及持仓收益率的数据仅供参考，不作为任何投资建议。

在 2019 年 12 月 31 日，基金资产净值 1,000,000,000.00 元，其中：基金份额持有人持有的基金份额为 1,000,000,000.00 份，基金份额净值为 1.0000 元。基金资产净值中，归属于基金份额持有人的金额为 1,000,000,000.00 元，归属于基金管理人、基金托管人及其他服务机构的金额为 0.00 元。基金资产净值中，归属于基金份额持有人的金额为 1,000,000,000.00 元，归属于基金管理人、基金托管人及其他服务机构的金额为 0.00 元。

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额 (人民币元)	占期末基金 资产净值比例 (%)
1	SIMON PROPERTY GROUP INC.	SPG US	11,821,771.29	6.28
2	PUBLIC STORAGE	PSA US	5,958,132.98	3.17
3	PROLOGIS INC.	PLD US	4,842,475.71	2.57
4	HCP INC	HCP US	4,594,894.70	2.44

5	VENTAS INC	VTR US	4,585,908.67	2.44
6	EQUITY INVESTMENT	EQR US	4,526,137.69	2.42
7	HEALTH CARE REIT INC	HCCN US	3,633,197.96	2.04
8	BOSTON PROPERTIES INC	BXP US	3,932,720.67	2.09
9	AVALONBAY COMMUNITIES INC	AVB US	3,892,687.09	2.07
10	VORNADO REALTY TRUST	VNO US	3,652,264.58	1.94
11	HOST HOTELS & RESORTS INC	HST US	3,294,066.38	1.80
12	GENERAL GROWTH PROPERTIES	GGP US	2,459,292.52	1.31
13	SL GREEN REALTY CORP	SLG US	2,100,156.77	1.12
14	KIMCO REALTY CORP	KIM US	2,094,822.29	1.11

15	MACIERICH CO/RTHE	MAC US	1,975,929.24	1.05
16	REALITY INCOME CORP	C US	1,961,240.40	1.04
17	DIGITAL REALTY TRUST INC	DIR US	1,673,474.00	0.89
18	FEDERAL REALTY INVS TRST	FRT US	1,670,360.74	0.89
19	COLE REAL ESTATE INVESTMENT	COLE US	1,533,179.15	0.82
20	UDR INC	UDR US	1,512,435.19	0.80
REITs收取的投资收入成本总额及卖出收入总额				单位:人民币千元
买入成本(成本)总额				306,025,932.23
卖出收入(成本)总额				128,113,926.25
ROIC中收取的投资收入成本总额及净资本投资总额				

本基金本报告期末未持有资产。
 本基金本报告期末持有资产公允价值为 1,000,000,000.00 元,净值比例大小排名的前十名债券投资明细
 本基金本报告期末未持有资产。
 本基金本报告期末持有资产公允价值为 1,000,000,000.00 元,净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
 本基金本报告期末未持有资产。
 本基金本报告期末持有资产公允价值为 1,000,000,000.00 元,净值比例大小排名的前十名金融衍生品投资明细
 本基金本报告期末未持有资产。
 本基金本报告期末持有资产公允价值为 1,000,000,000.00 元,净值比例大小排名的前十名基金投资明细
 本基金本报告期末未持有资产。
 本基金本报告期末持有资产公允价值为 1,000,000,000.00 元,净值比例大小排名的前十名贵金属投资明细
 本基金本报告期末未持有资产。
 本基金本报告期末持有资产公允价值为 1,000,000,000.00 元,净值比例大小排名的前十名其他资产投资明细

8.11 报告期末前十名股票公允价值变动情况
 8.11.1 基金本报告期末前十名证券的发行主体在本报告期内没有受到监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到
 公开谴责、处罚。
 8.11.2 报告期末本基金持有的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。
 8.11.3 报告期末各资产公允价值如下:

序号	股票名称	数量	金额	单位:人民币元
1	中国工商银行	100,000,000	1,000,000,000.00	

1	存出保证金	—
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	886,288.11
4	应收利息	1,456.71
5	应收申购款	89,654.91
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	977,399.73
8	资产减值准备	—
9	资产减值准备	—
10	资产减值准备	—
11	资产减值准备	—
12	资产减值准备	—
13	资产减值准备	—
14	资产减值准备	—
15	资产减值准备	—
16	资产减值准备	—
17	资产减值准备	—
18	资产减值准备	—
19	资产减值准备	—
20	资产减值准备	—
21	资产减值准备	—
22	资产减值准备	—
23	资产减值准备	—
24	资产减值准备	—
25	资产减值准备	—
26	资产减值准备	—
27	资产减值准备	—
28	资产减值准备	—
29	资产减值准备	—
30	资产减值准备	—
31	资产减值准备	—
32	资产减值准备	—
33	资产减值准备	—
34	资产减值准备	—
35	资产减值准备	—
36	资产减值准备	—
37	资产减值准备	—
38	资产减值准备	—
39	资产减值准备	—
40	资产减值准备	—
41	资产减值准备	—
42	资产减值准备	—
43	资产减值准备	—
44	资产减值准备	—
45	资产减值准备	—
46	资产减值准备	—
47	资产减值准备	—
48	资产减值准备	—
49	资产减值准备	—
50	资产减值准备	—
51	资产减值准备	—
52	资产减值准备	—
53	资产减值准备	—
54	资产减值准备	—
55	资产减值准备	—
56	资产减值准备	—
57	资产减值准备	—
58	资产减值准备	—
59	资产减值准备	—
60	资产减值准备	—
61	资产减值准备	—
62	资产减值准备	—
63	资产减值准备	—
64	资产减值准备	—
65	资产减值准备	—
66	资产减值准备	—
67	资产减值准备	—
68	资产减值准备	—
69	资产减值准备	—
70	资产减值准备	—
71	资产减值准备	—
72	资产减值准备	—
73	资产减值准备	—
74	资产减值准备	—
75	资产减值准备	—
76	资产减值准备	—
77	资产减值准备	—
78	资产减值准备	—
79	资产减值准备	—
80	资产减值准备	—
81	资产减值准备	—
82	资产减值准备	—
83	资产减值准备	—
84	资产减值准备	—
85	资产减值准备	—
86	资产减值准备	—
87	资产减值准备	—
88	资产减值准备	—
89	资产减值准备	—
90	资产减值准备	—
91	资产减值准备	—
92	资产减值准备	—
93	资产减值准备	—
94	资产减值准备	—
95	资产减值准备	—
96	资产减值准备	—
97	资产减值准备	—
98	资产减值准备	—
99	资产减值准备	—
100	资产减值准备	—

本基金本报告期末无未兑付及于转换期即将到期的转债情况。

8.1.1 基金份额持有人名称和持有份额变动情况说明

本基金本报告期末前十名股东中不存在流通受限的情况。

9.1 期末基金总份额持有人户数及其持有结构

	单位：份					
			份额构成：份			
	持有人数	持有人的机构投资者	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	占比
0. 期末基 金总份 额	2,886	65,997.47	25,703,944.34	13.90%	164,764,765.99	86.50%

基金管理人持有本基金基金份额	1,820,027.00	占基金总份额比例	0.0147%
注：本基金除管理人、基金托管人和持有本基金份额的关联方持有本基金份额外，不存在其他关联方持有本基金份额的情况。截至2013年8月31日，本基金除管理人、基金托管人和持有本基金份额的关联方持有本基金份额外，不存在其他关联方持有本基金份额的情况。			
基金合同生效以来基金投资组合资产净值情况			单位：元
基金合同生效以来(2013年8月9日至基金合同生效日)	800,008,542.96		
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	22,290,084.61		
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	331,007,077.61		
基金合同生效日起至报告期期末基金净申购份额	-2,498,534.65		
本报告期末基金资产净值	1,968,468.70		
注：本基金于本报告期投资运作，基金合同生效日为2013年8月9日。			

[illegible]

券商名称	交易单元数量	股票交易		柜台证券融资融券		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总额的比例	
		人民币		人民币		
Morgan Stanley		38,029,169.88	8.84%	13,548.81	6.66%	新增
Citigroup		276,997,223.62	64.18%	83,300.82	40.93%	新增
HKC Institutional						

[illegible]

11.6 基金管理人选用的交易所证券经纪商签署交易单元租用协议,并通知基金托管人。
11.7 基金管理人定期对经纪商的商务进行评估,可根据评估结果调整交易分配比例以及更换经纪商。
11.8 处理交易包含股票、存托凭证及其他证券交易,佣金基金通过单一券商进行股票、基金等交易而合计支付该券商的费用占:
11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况
本基金未租用证券公司交易单元进行其他证券投资。
二〇一四年三月三十一日
广发基金管理有限公司