

摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金(QDII)

2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 月 30 日

基金管理人：摩根基金管理（中国）有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年十月二十五日

§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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	摩根富时发达市场 REITs 指数(QDII)
基金主代码	005613
交易代码	005613
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 4 月 26 日
报告期末基金份额总额	275,026,433.65 份
投资目标	本基金采用被动式指数化投资策略，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力求实现对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差的最小化。本基金力争控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于 0.5%，基金净值增长率与业绩比较基准之间的年跟踪误差不超过 5%。
投资策略	本基金采用抽样复制策略进行被动式指数化投资，

在富时发达市场 REITs 指数（英文为 FTSE EPRA/NAREIT Developed REITs Index）成分股、备选成分股中，优选流动性好、基本面稳健的 REITs 构建 REITs 组合，以较小的交易成本实现较低的跟踪误差。但因特殊情况导致基金无法有效跟踪标的指数时，本基金将运用其他方法建立实际组合，力求实现跟踪误差最小化。

1、资产配置策略

为了实现追踪误差最小化，本基金将不低于 90% 的非现金基金资产投资于富时发达市场 REITs 指数的成份股、备选成份股及以富时发达市场 REITs 指数为投资标的的指数基金（包括 ETF）。

2、股票投资策略

（1）投资组合构建

本基金采用抽样复制指数的方法，综合考虑个股的市值规模、流动性、国别/行业代表性、价格波动率以及与标的指数相关度等因素，优选个股构建投资组合，力求在最小化跟踪误差的同时，将交易成本控制在合理的范围内。

在初始建仓期或者为申购资金建仓时，本基金将依据市场流动性逐步买入投资组合并采取相应的交易策略降低建仓成本。在投资运作过程中，本基金将对标的指数成分的权重变化进行跟踪，并根据其权重的变动进行动态调整。

（2）投资组合调整

1) 定期调整

本基金所构建的投资组合将定期根据所跟踪标的指数成份股的调整进行相应的跟踪调整。富时发达市场 REITs 指数的成分股每半年调整一次，指数调

	<p>整方案公布后，本基金将及时对现有组合的构成进行相应的调整，若成分股的集中调整短期内会对跟踪误差产生较大影响，将采用逐步调整的方式。</p> <p>2) 不定期调整</p> <p>①根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时，本基金将根据标的指数权重比例的变化，进行相应调整。</p> <p>②当标的指数成份股因停牌、流动性不足等因素导致基金无法按照指数权重进行配置，基金管理人将综合考虑跟踪误差和投资者利益，选择相关 REITs 进行适当的替代。</p> <p>③本基金将根据申购和赎回情况对 REITs 组合进行调整，保证基金正常运行，从而有效跟踪标的指数。</p> <p>3) REITs 替代</p> <p>通常情况下，本基金根据标的指数成份股在指数中的权重确定成份 REITs 的买卖数量。但在如标的指数成份股流动性严重不足或停牌、标的指数成份股因法律法规的相关规定而为本基金限制投资的标的等特殊情况下，本基金可以选择其他 REITs 或 REITs 组合对标的指数中的成份股进行替换。</p> <p>在选择替代 REITs 时，为尽可能的降低跟踪误差，本基金将采用定性与定量相结合的方法，在对替代 REITs 与被替代 REITs 的基本面、股价技术面等指标进行相关性分析的基础上，优先从标的指数成份股及备选成份股中选择基本面良好，流动性充裕的 REITs 进行替代投资。</p> <p>3、债券投资策略</p>
--	---

	<p>本基金将在控制市场风险与流动性风险的前提下，根据对财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪，结合不同债券品种的到期收益率、流动性、市场规模等情况，灵活运用久期策略、期限结构配置策略、信用债策略、可转债策略等多种投资策略，实施积极主动的组合管理，并根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预测，对债券组合进行动态调整。</p> <p>4、金融衍生品投资策略</p> <p>本基金可本着谨慎和风险可控的原则，适度投资于经中国证监会允许的各类金融衍生产品，如期货、期权、权证、远期合约、掉期以及其他衍生工具。本基金投资于金融衍生品主要是为了避险和增值、管理汇率风险，以便更好地实现基金的投资目标。本基金投资于各类金融衍生品的全部敞口不高于基金资产净值的 100%。</p>		
业绩比较基准	95%×富时发达市场 REITs 指数收益率+ 5%×税后银行活期存款收益率		
风险收益特征	本基金为指数型基金，主要采用抽样复制法跟踪标的指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的投资市场相似的风险收益特征，风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。		
基金管理人	摩根基金管理（中国）有限公司		
基金托管人	招商银行股份有限公司		
境外资产托管人英文名称	The Hong Kong and Shanghai Banking Corporation Limited		
境外资产托管人中文名称	香港上海汇丰银行有限公司		
下属分级基金的基金简称	<table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 50%; padding: 2px;">摩根富时发达市场 REITs 指数(QDII)人民币 A</td> <td style="width: 50%; padding: 2px;">摩根富时发达市场 REITs 指数(QDII)人民币 C</td> </tr> </table>	摩根富时发达市场 REITs 指数(QDII)人民币 A	摩根富时发达市场 REITs 指数(QDII)人民币 C
摩根富时发达市场 REITs 指数(QDII)人民币 A	摩根富时发达市场 REITs 指数(QDII)人民币 C		

下属分级基金的交易代码	005613	019495
报告期末下属分级基金的份额总额	275,018,247.35 份	8,186.30 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日)	
	摩根富时发达市场 REITs 指数(QDII)人 民币 A	摩根富时发达市场 REITs 指数(QDII)人 民币 C
1.本期已实现收益	2,959,911.76	17.17
2.本期利润	-25,552,256.38	1.42
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0915	0.0008
4.期末基金资产净值	311,239,563.40	9,265.06
5.期末基金份额净值	1.1317	1.1318

注：1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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.本基金自2023年9月15日起，增设 C 类基金份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

1、摩根富时发达市场 REITs 指数(QDII)人民币 A：

阶段	净值增长	净值增长	业绩比较	业绩比较	①—③	②—④
----	------	------	------	------	-----	-----

	率①	率标准差 ②	基准收益 率③	基准收益 率标准差 ④		
过去三个月	-7.50%	0.77%	-7.85%	0.77%	0.35%	0.00%
过去六个月	-1.79%	0.80%	-3.52%	0.79%	1.73%	0.01%
过去一年	1.75%	1.14%	-0.89%	1.12%	2.64%	0.02%
过去三年	13.82%	1.07%	3.58%	1.06%	10.24%	0.01%
过去五年	0.30%	1.38%	-11.59%	1.36%	11.89%	0.02%
自基金合同生效起至今	13.17%	1.33%	1.71%	1.31%	11.46%	0.02%

2、摩根富时发达市场 REITs 指数(QDII)人民币 C:

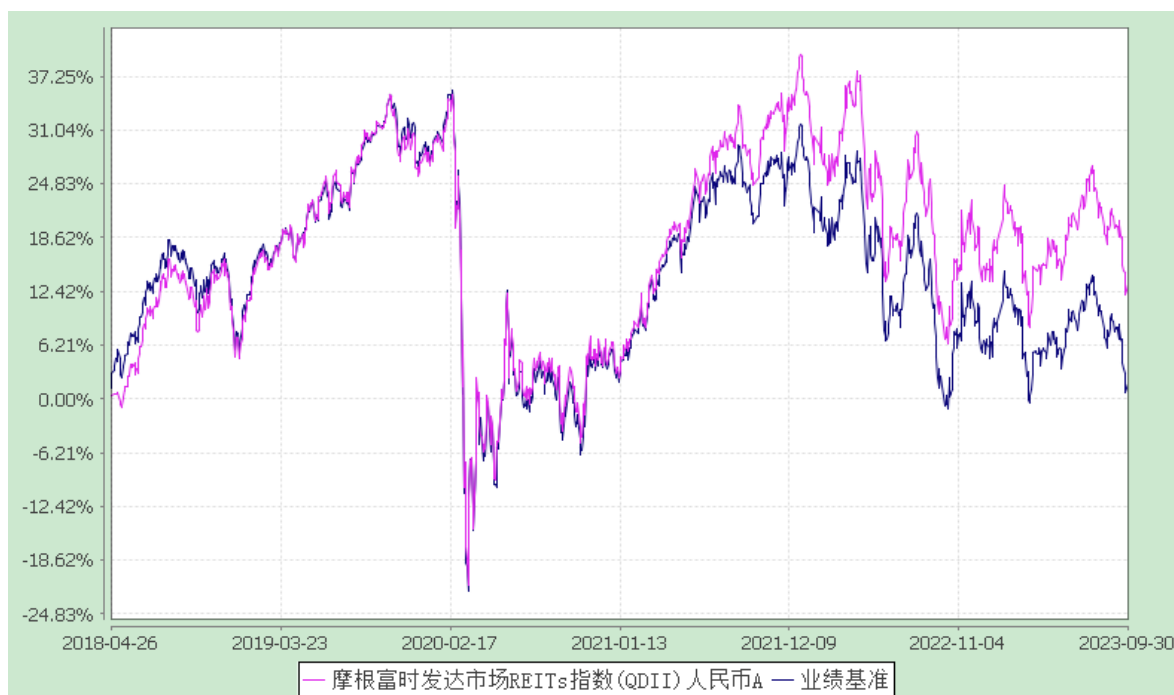
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-	-	-	-	-	-
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-5.74%	1.02%	-5.85%	0.98%	0.11%	0.04%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金(QDII)
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018 年 4 月 26 日至 2023 年 9 月 30 日)

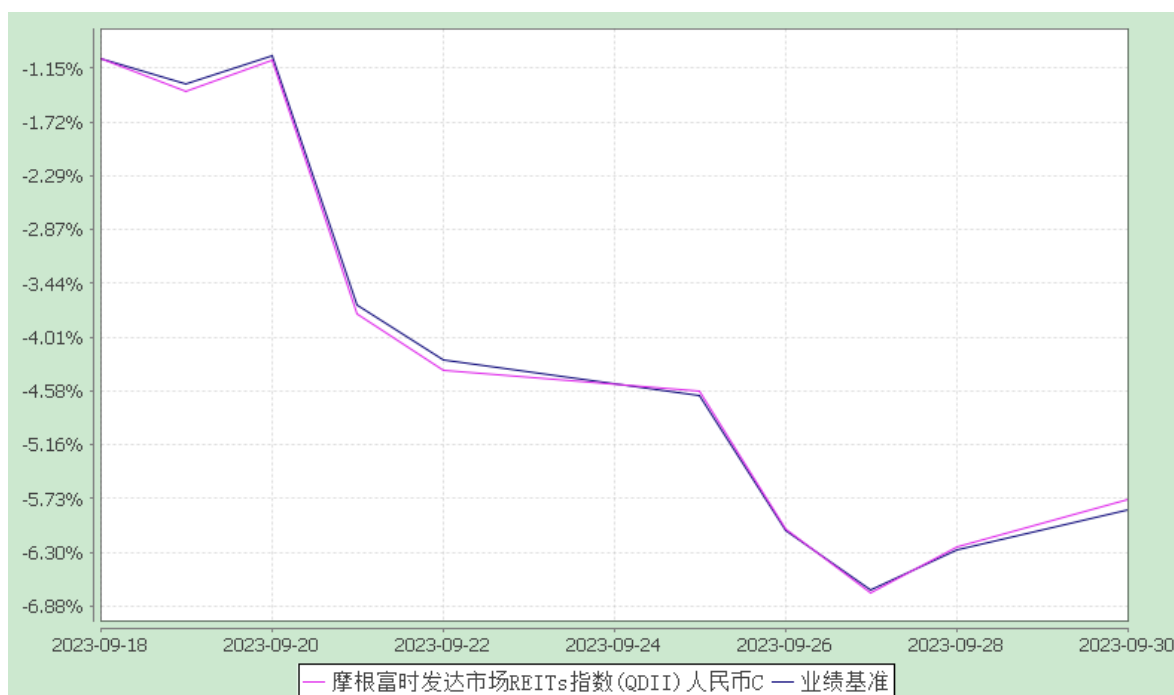
1. 摩根富时发达市场 REITs 指数(QDII)人民币 A:



注：本基金合同生效日为 2018 年 4 月 26 日，图示的时间段为合同生效日至本报告期末。

本基金建仓期为本基金合同生效日起 6 个月，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

2. 摩根富时发达市场 REITs 指数(QDII)人民币 C:



注：本基金自 2023 年 9 月 15 日起增加 C 类份额，相关数据按实际存续期

计算。

本基金建仓期为本基金合同生效日起 6 个月，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经 理期限		证券从业 年限	说明
		任职日 期	离任日 期		
张军	本基金基金经 理	2021-01- 07	-	19 年（金融 领域从业经 验 30 年）	张军先生曾任上海国际信托有限公司国际业务部经理、交易部经理。2004 年 6 月起加入摩根基金管理（中国）有限公司（原上投摩根基金管理有限公司），先后担任交易部总监、基金经理、投资绩效评估总监、国际投资部总监、组合基金投资部总监，现任高级基金经理。
胡迪	本基金基金经 理、指数及量 化投资部总监	2021-11- 19	-	16 年	胡迪女士曾任纽约美林证券全球资产管理部高级经理，纽约标准普尔量化投资主管，中国国际金融股份有限公司资产管理部执行总经理。2020 年 5 月加入摩根基金管理（中国）有限公司（原上投摩根基金管理有限公司），现任指数及量化投资部总监兼基金经理。

注：1.任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规

定。

4.1.1 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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
张军	公募基金	9	4,936,387,157.89	2008-03-08
	私募资产管理计划	1	38,150,271.61	2021-07-09
	其他组合	-	-	-
	合计	10	4,974,537,429.50	-

4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、本基金基金合同的规定。基金经理对个股和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制，基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司继续贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规和公司内部公平交易流程的各项要求，严格规范境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活动，通过系统和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析，以确保本公司管理的不同投资组合在授权、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环节均得到公平对待。

对于交易所市场投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量；对于银行间市场投资活动，本公司通过对手库控制和交易室询价机制，严格防范对手风险并检查价格公允性；对于申购投资行为，本公司遵循价格优先、比例分配的原则，根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差监控分析，未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，通过对交易价格、交易时间、交易方向等的分析，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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%的情形：无。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，全球 REITs 指数表现随全球股指下跌，通胀的顽固和经济的韧性超出原先的预期。美联储的利率政策偏鹰派，保留再次加息的可能性，被市场解读为更长时间的更高利率（higher for longer）。美 10 年期国债收益率上涨超过 4.6%，预示着市场在尝试新的定价水平。各类 REITs 都有不同程度下跌，相对而言，数据中心板块跌幅较小，基础设施和办公板块跌幅较大。

本基金采取被动复制策略跟踪指数的表现。

展望后市，虽然房地产投资信托基金可能无法幸免于当前的抵押贷款市场动荡，但股票 REITs 维持长期，结构良好的资产负债表，杠杆率低，负债以无担保债务和固定利率为主融资，并且还能从股票市场进行融资同比来看，房地产投资信托基金还继续从运营（FFO）和净营业收入（NOI）收益中获取较多的资金。凭借其强劲的资产负债表和稳健的经营业绩，股票房地产投资信托基金已做好充分准备，以应对这段经济和资本市场不确定的时期。

随着更高的利率、更严格的承销标准和不断变化的房地产估值，许多私人房地产投资者无法面对当前的融资环境。这加剧了人们对房地产债务持有量以及个别商业抵押地产违约升级的可能性的担忧。这也增加了整个行业的感知风险。但平均而言，房地产投资信托基金通过保持与核心投资策略一致的杠杆比率并专注于无担保、固定利率和长期债务，限制了对这些挑战的敞口。进入无担保债务市场为美国公共股权房地产投资信托基金提供了优于许多私人房地产市场同行的竞争优势。

2023 年将继续带来经济不确定性，因为美联储继续提高短期利率以降低通胀。尽管较高的利率环境通常会给房地产带来困难的经营环境，但房地产投资信托基金已将其资产负债表定位为在 2023 年具有弹性。自全球金融危机（GFC）结束以来，房地产投资信托基金通过降低杠杆和利息支出，使用固定利率债务以及增加其持有的债务期限来降低其对更高利率的风险敞口。

一、房地产投资信托基金的杠杆率处于历史低位。以债务与市场资产衡量的杠杆率自

2011 年以来一直保持在 40%以下，自 2016 年以来一直稳定在 30%的中低范围内。截至 2023 年第三季度，杠杆率为 34.5%，加权平均到期期限为 83.5 个月，或超过 7 年。

二、房地产投资信托基金拥有期限良好、结构良好的债务。房地产投资信托基金在高利率环境下管理杠杆还有很长的路要走，因为它们使用固定利率债务来长期锁定低利率。

三、自全球金融危机结束以来，房地产投资信托基金通过降低杠杆和利息支出，使用固定利率债务以及增加其持有的债务期限来降低其对更高利率的风险敞口。REITs 因其强劲的资产负债表而为 2023 年的经济不确定性做好了准备。2023 年，更高的利率环境将转化为可变债务和新债务的更高利率，从而导致更高的利息支出和更大的偿债负担。但 REITs 处于较有利地位，可以承受更高的利率，并与杠杆率更高的市场参与者竞争房地产购买。平均而言，REITs 在过去六次经济衰退期间和之后的表现优于私人房地产和更广泛的股票市场。REITs 正以强劲的经营业绩进入经济增长放缓的时期，并为 2023 年的经济不确定性做好了准备。比如 2005 年的债务期限刚刚超过 59 个月（近五年），并在 2021 年升至 89 个月（近七年半）的峰值。2022 年债务期限略有缩短，因为新债券发行量远低于历史水平，但仍接近历史高位。自 2005 年以来固定利率占总债务的比例以及未偿债务总额的加权平均利率。固定利率债务的比例从 2005 年的 73%增加到 2021 年和 2022 年的 85%以上。在房地产投资信托基金转向固定利率债务的同时，其债务的平均利率已经下降。房地产投资信托基金的加权平均利率已从 2005 年的 5.9%降至 2023 年第三季度的 3.6%。由于可变利率债务的风险敞口较少，到期的平均期限较长，房地产投资信托基金以低利率锁定债务，限制了其在 2023 年对更高利率的风险敞口。

四、利息支出，因为 NOI 的份额较低。过去几年，该行业杠杆率降低的一个结果是利息支出占 NOI 的比例降低。2009 年，利息支出占 NOI 的比例为 37%。从那时起，由于房地产投资信托基金降低了杠杆率并以低利率债务融资，它经历了急剧下降。截至 2023 年第三季度，这一比例为 18.9%。如上所述，房地产投资信托基金的大部分债务也以固定利率计算，总债务的 87.2%为固定利率。与 2005 年的水平相比，所有部门的利息支出占 NOI 的比例都有所下降。值得注意的是，即使是今天利息支出与 NOI 比率最高的行业，其水平也低于 2005 年 35.4%的行业平均水平。

展望四季度，更高的利率环境将转化为可变债务和新债务的更高利率，从而导致更高的利息支出和更大的偿债负担。房地产投资信托基金处于有利地位，可以承受更高的利率，并与杠杆率更高的市场参与者竞争房地产购买，因为它们有效地管理了资产负债表。

往后看，我们预计有更多机构投资者可能会考虑将房地产投资信托基金作为投资组合完

成策略的一部分，以获得地域多元化或行业多元化，或增强其投资组合的 ESG 属性。房地产投资信托基金通过让投资者更好地进入现代经济的房地产行业（如手机信号塔、数据中心、自助存储、医疗保健、工业和物流）来提供行业多元化。房地产投资信托基金提供地域多元化；截至 9 月末，共有 865 个上市的房地产投资信托基金，遍布 40 多个国家和地区，股票市场价值合计达 2.5 万亿美元。房地产投资信托基金增强了投资组合的 ESG 属性，因为它们提供了在环境管理，社会责任和良好治理方面表现较好的途径。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金 A 份额净值增长率为：-7.50%，同期业绩比较基准收益率为：-7.85%。

本报告期本基金 C 份额净值增长率为：-5.74%，同期业绩比较基准收益率为：-5.85%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	292,750,513.05	92.73
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	292,750,513.05	92.73
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	21,477,096.70	6.80
8	其他资产	1,472,145.19	0.47
9	合计	315,699,754.94	100.00

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例（%）
美国	229,001,307.30	73.57
日本	16,662,976.47	5.35
澳大利亚	12,617,766.81	4.05
英国	11,713,809.78	3.76
新加坡	9,553,552.15	3.07
法国	6,865,975.42	2.21
中国香港	4,788,707.21	1.54
比利时	1,546,417.91	0.50
合计	292,750,513.05	94.06

注：国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定，ADR、GDR按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

5.3.1 报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
房地产	292,750,513.05	94.06
合计	292,750,513.05	94.06

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.3.2 期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

5.4.1 指数投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代 码	所在证券 市场	所属国家 (地区)	数量 (股)	公允价 值	占基金资产 净值比例 (%)
1	PROLOGIS INC	安博	PLD	纽约证券 交易所	美国	35,224	28,378,0 52.09	9.12
2	EQUINIX INC	Equinix 有限公司	EQIX	纳斯达克 交易所	美国	4,965	25,889,5 03.69	8.32
3	PUBLIC STORAGE	Public Storage	PSA	纽约证券 交易所	美国	8,388	15,870,2 71.28	5.10
4	WELLTOWER INC	Welltowe r Inc	WELL	纽约证券 交易所	美国	25,611	15,063,6 01.79	4.84
5	DIGITAL REALTY TRUST INC	数字房地 产信托有 限公司	DLR	纽约证券 交易所	美国	15,823	13,748,5 95.14	4.42
6	SIMON PROPERTY GROUP INC	西蒙房地 产集团公 司	SPG	纽约证券 交易所	美国	17,425	13,515,4 18.86	4.34
7	REALTY INCOME CORP	Realty Income 公司	0	纽约证券 交易所	美国	35,751	12,818,8 50.39	4.12
8	VICI PROPERTIES INC	VICI Properti es 股份 有限公司	VICI	纽约证券 交易所	美国	53,812	11,243,0 58.47	3.61
9	EXTRA SPACE STORAGE INC	Extra Space Storage 有限公司	EXR	纽约证券 交易所	美国	11,148	9,731,31 3.10	3.13
10	AVALONBAY COMMUNITIE S INC	AvalonBa y 社区股 份有限公 司	AVB	纽约证券 交易所	美国	7,547	9,305,89 5.16	2.99

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

5.4.2 积极投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.5 报告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。

5.6 报告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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产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支持证券。

5.8 报告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。

5.9 报告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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 报告期内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。

5.10.2 报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,080,512.61

4	应收利息	-
5	应收申购款	391,632.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,472,145.19

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	摩根富时发达市场 REITs指数(QDII)人 民币A	摩根富时发达市场 REITs指数(QDII)人 民币C
本报告期期初基金份额总额	285,684,530.42	-
报告期期间基金总申购份额	25,562,320.56	8,186.30
减：报告期期间基金总赎回份额	36,228,603.63	-
报告期期间基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	275,018,247.35	8,186.30
-------------	----------------	----------

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予本基金募集注册的文件；
2. 《摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金（QDII）基金合同》；
3. 《摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金（QDII）托管协议》；
4. 《摩根基金管理（中国）有限公司开放式基金业务规则》；
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照；
6. 基金托管人业务资格批件和营业执照。

8.2 存放地点

基金管理人或基金托管人住所。

8.3 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。

摩根基金管理（中国）有限公司

二〇二三年十月二十五日