

# 南方标普 500 交易型开放式指数证券 投资基金（QDII）2023 年中期报告

2023 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2023 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 年 3 月 23 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

## 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	6
§4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
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	9
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	10
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	12
§6 中期财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	15
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	39
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	39
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细	40
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	82
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	84
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	84

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.....	84
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.....	84
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.....	84
7.11 投资组合报告附注.....	85
§8 基金份额持有人信息.....	85
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	85
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	86
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	86
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.....	86
§9 开放式基金份额变动.....	86
§10 重大事件揭示.....	87
10.1 基金份额持有人大会决议.....	87
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.....	87
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	87
10.4 基金投资策略的改变.....	87
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	87
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.....	87
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	87
10.8 其他重大事件.....	89
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	90
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.....	90
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	91
§12 备查文件目录.....	91
12.1 备查文件目录.....	91
12.2 存放地点.....	91
12.3 查阅方式.....	91

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）
基金简称	南方标普 500ETF（QDII）
场内简称	标普 ETF；标普 500ETF 基金
基金主代码	513650
交易代码	513650
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 3 月 23 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	350,734,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2023 年 4 月 4 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采用复制策略、替代策略及其他适当的策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。主要投资策略包括：复制策略、替代策略、金融衍生品投资策略、债券投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、存托凭证投资策略、境外市场基金投资策略、境外回购交易及证券借贷交易策略等以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为经汇率调整后的标的指数收益率。本基金标的指数为标普 500 指数，及其未来可能发生的变更。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，一般而言，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的市场相似的风险收益特征。 本基金可投资于境外证券，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

### 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	招商银行股份有限公司

	公司	
信息披露负责人	姓名	常克川
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	95555
传真	0755-82763889	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	518017	518040
法定代表人	周易	缪建民

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目	境外资产托管人
名称	中文
	英文
注册地址	701 East 60th Street North, Sioux Falls, SD57104, USA
办公地址	40th Floor Champion Tower, Three Garden Road, Central, Hong Kong
邮政编码	-

## 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	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 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(2023 年 3 月 23 日 - 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	6,522,721.78
本期利润	51,529,616.44
加权平均基金份额本期利润	0.1587
本期加权平均净值利润率	15.05%
本期基金份额净值增长率	16.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	6,771,627.32
期末可供分配基金份额利润	0.0193
期末基金资产净值	407,892,723.44
期末基金份额净值	1.1630
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	16.30%

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；

4、本基金合同生效日为 2023 年 3 月 23 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满半年。

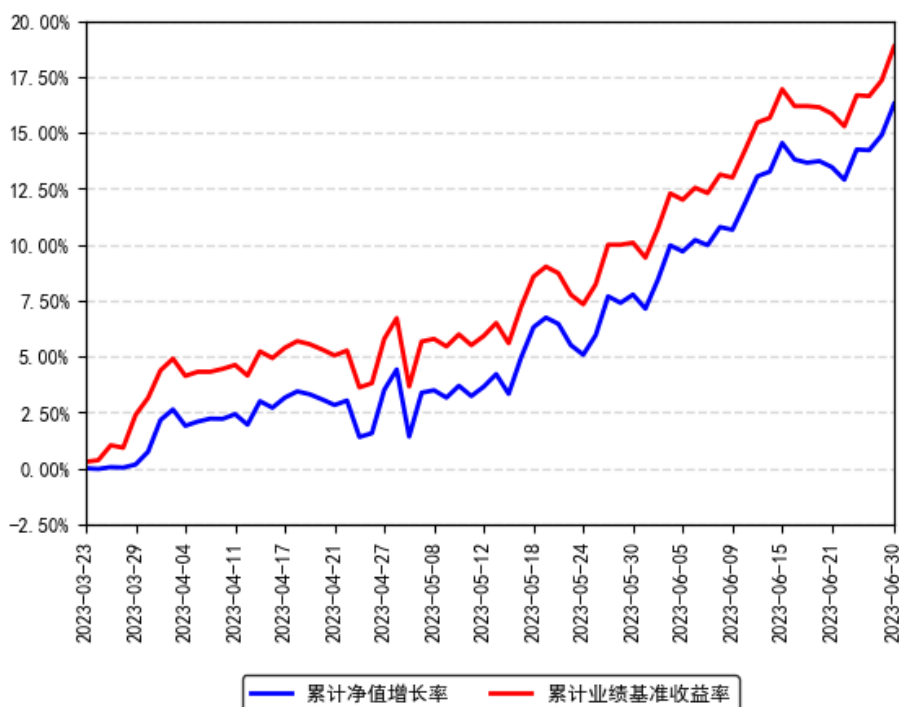
## 3.2 基金净值表现

### 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	8.55%	0.67%	8.63%	0.67%	-0.08%	0.00%
过去三个月	13.84%	0.85%	13.88%	0.84%	-0.04%	0.01%
自基金合同生效起至今	16.30%	0.82%	18.87%	0.83%	-2.57%	-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

南方标普500ETF (QDII) 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注: 本基金合同于 2023 年 3 月 23 日生效, 截至本报告期末基金成立未满一年; 自基金成立日起 6 个月内为建仓期, 截至报告期末建仓期尚未结束。

## § 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, 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。

南方基金管理股份有限公司旗下管理公募基金、全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户组合, 已发展成为产品种类丰富、业务领域全面、经营业绩优秀、资产管理规模位居前列的基金管理公司之一。

#### 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		
李佳亮	本基金 基金经 理	2023 年 3 月 23 日	-	10 年	美国南加州大学金融工程硕士，特许金融分析师 (CFA)，具有基金从业资格。2012 年 8 月加入南方基金，任量化投资部研究员；2015 年 5 月 28 日至 2016 年 8 月 5 日，任投资经理助理；2017 年 4 月 13 日至 2018 年 9 月 4 日，任南方荣优基金经理；2016 年 8 月 5 日至 2019 年 1 月 18 日，任南方消费基金经理；2017 年 11 月 9 日至 2019 年 6 月 28 日，任大数据 100、大数据 300 基金经理；2016 年 11 月 23 日至 2021 年 11 月 12 日，任南方中证 500 增强基金经理；2017 年 11 月 9 日至 2021 年 11 月 12 日，任南方量化成长基金经理；2020 年 4 月 23 日至 2021 年 11 月 12 日，任南方上证 50 增强基金经理；2016 年 12 月 30 日至今，任南方绝对收益基金经理；2021 年 10 月 29 日至今，任南方 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF 基金经理；2022 年 1 月 10 日至今，任南方 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF 联接基金经理；2022 年 11 月 21 日至今，兼任投资经理；2022 年 12 月 16 日至今，任南方基金南方东英银河联昌富时亚太低碳精选 ETF (QDII) 基金经理；2022 年 12 月 23 日至今，任南方北证 50 成份指数发起基金经理；2023 年 3 月 3 日至今，任南方中证主要消费 ETF 基金经理；2023 年 3 月 23 日至今，任南方标普 500ETF (QDII) 基金经理；2023 年 4 月 13 日至今，任南方沪深 300ESG 基准 ETF 基金经理；2023 年 6 月 21 日至今，任南方中证国新央企科技引领 ETF 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

姓名	产品类型	产品数量 (只)	资产净值(元)	任职时间
----	------	----------	---------	------

李佳亮	公募基金	9	4,891,577,474.33	2016 年 08 月 05 日
	私募资产管理计划	-	-	-
	其他组合	-	-	-
	合计	9	4,891,577,474.33	-

## 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 13 次，是由于指数投资组合的投资策略导致。

## 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

基金成立至半年末, 标普 500 指数上涨 13.04%。期间我们通过自建的“指数化交易系统”、“日内择时交易模型”、“跟踪误差归因分析系统”、“ETF 现金流精算系统”等, 将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平, 并通过严格的风险管理流程, 确保了本 ETF 基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下:

(1) 接受申购赎回所带来的仓位偏离, 对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化;

(2) 股指期货和现货之间的偏离带来的本基金与基准的偏离;

(3) 申购赎回过程中的美元汇率变动, 实际换汇汇率与结算汇率的差异。

(4) 根据指数成份股调整进行的基金调仓, 事前我们制定了详细的调仓方案, 在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生, 将跟踪误差控制在理想范围内。

#### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末, 本基金份额净值为 1.1630 元, 报告期内, 份额净值增长率为 16.30%, 同期业绩基准增长率为 18.87%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年上半年, 美股市场整体表现较好。展望 2023 年下半年, 目前美国服务业消费依旧较强, 但美国 6 月温和的通胀数据增加了美联储将结束紧缩周期可能性。下半年若美国加息停止, 美股在美国经济衰退之前仍有望震荡上涨。2023 年下半年, 美国经济或将逐步放缓, 但距离衰退仍有一段距离。美国信贷收缩下经济或将进一步放缓, 但美国居民仍有充足的超额储蓄, 美国居民消费仍有一定韧性, 将会延缓衰退到来。

#### 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、现金及债券指数投资部总经理、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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 中期财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	35,810,133.01
结算备付金		3,147,146.61
存出保证金		2,225,546.40
交易性金融资产	6.4.7.2	376,331,638.47
其中：股票投资		376,331,638.47
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	-
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		-
应收股利		186,849.01
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	46,461,894.00
资产总计		464,163,207.50
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 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		50,609,820.36
应付赎回款		-
应付管理人报酬		160,398.30
应付托管费		40,099.59
应付销售服务费		-
应付投资顾问费		-
应交税费		24,990.89
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	5,435,174.92
负债合计		56,270,484.06
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	350,734,000.00
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	57,158,723.44
净资产合计		407,892,723.44
负债和净资产总计		464,163,207.50

注：1. 报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1630 元，基金份额总额 350,734,000.00 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2023 年 03 月 23 日(基金合同生效日)至 2023 年 06 月 30 日止期间。

## 6.2 利润表

会计主体：南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)

本报告期：2023 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		52,249,085.94
1.利息收入		97,383.31
其中：存款利息收入	6.4.7.13	97,383.31
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		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以“-”填列)		6,266,828.11

其中：股票投资收益	6.4.7.14	4,296,232.41
基金投资收益	6.4.7.15	-
债券投资收益	6.4.7.16	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.17	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-
衍生工具收益	6.4.7.19	742,144.41
股利收益	6.4.7.20	1,228,451.29
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	45,006,894.66
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		822,369.02
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	55,610.84
减：二、营业总支出		719,469.50
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	556,861.23
2.托管费	6.4.10.2.2	139,215.27
3.销售服务费	6.4.10.2.3	-
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		2,677.60
8.其他费用	6.4.7.24	20,715.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		51,529,616.44
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		51,529,616.44
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		51,529,616.44

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)

本报告期：2023 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 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)				
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)	420,734,000.00	-	-	420,734,000.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-70,000,000.00	-	57,158,723.44	-12,841,276.56
(一)、综合收益总额	-	-	51,529,616.44	51,529,616.44
(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)	-70,000,000.00	-	5,629,107.00	-64,370,893.00
其中: 1.基金申购款	80,000,000.00	-	10,315,027.91	90,315,027.91
2.基金赎回款	-150,000,000.00	-	-4,685,920.91	-154,685,920.91
(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)	350,734,000.00	-	57,158,723.44	407,892,723.44

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 \_\_\_\_\_ 徐超 \_\_\_\_\_ 徐超 \_\_\_\_\_  
 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



南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(QDII) (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[2022]1698 号《关于准予南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)注册的批复》注册,由南方基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 420,734,000.00 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第 0190 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》于 2023 年 3 月 23 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 420,734,000.00 份基金份额,无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司,境外资产托管人为美国花旗银行有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2023]60 号审核同意,本基金 420,734,000.00 份基金份额于 2023 年 4 月 4 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标普 500 指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股(包括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普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证等),与标的指数相关的公募基金、上市交易型基金(含 ETF)、中国证监会允许投资的结构性及金融衍生产品等。此外,为更好地实现投资目标,本基金可参与其他境外市场投资工具和境内市场投资工具投资。境内市场投资工具包括少量非成份股(包含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册发行的股票以及存托凭证)、衍生工具(股指期货、股票期权等)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、政府机构债券、地方政府债券、次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。境外市场投资工具包括在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监管机构登记注册的公募基金(含 ETF);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普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证;政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券;银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具;远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品;与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性及投资产品;以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定。本基金可以进行境

外证券借贷交易、境外正回购交易、逆回购交易。有关证券借贷交易的内容以专门签署的三方或多方协议约定为准。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，本基金年化跟踪误差不超过 4%。本基金的业绩比较基准为经汇率调整后的标普 500 指数收益率。

#### 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》、本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。

本财务报表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

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2023 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日止期间。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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。

### 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

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。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、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。

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。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该

限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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。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。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。

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。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算, 实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1% 以上时, 可进行收益分配。本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。收益分配不须以弥补浮动亏损为前提, 收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目, 于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币, 所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目, 于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币, 所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部, 以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分: (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用; (2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果, 以决定向其配置资源、评价其业绩; (3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征, 并且满足一定条件的, 则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作, 不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 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[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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	35,810,133.01
等于：本金	35,809,369.46
加：应计利息	763.55
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	35,810,133.01

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	331,590,833.90	-	376,331,638.47	44,740,804.57
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	331,590,833.90	-	376,331,638.47	44,740,804.57

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	32,012,309.71	-	-	-
一指期货	32,012,309.71	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	32,012,309.71	-	-	-



**6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况**

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值	公允价值变动
ES2309	ES2309	20.00	32,278,399.80	266,090.09
合计				266,090.09
减: 可抵销期货暂收款				266,090.09
净额				-

衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资, 净额为 0。在当日无负债结算制度下, 结算准备金已包括所持股指期货产生的持仓损益, 则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

**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**

无。

**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**

无。

**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 2023 年 6 月 30 日
应收利息	-

其他应收款	46,461,894.00
待摊费用	-
可收退补款	-
应收退补款	-
合计	46,461,894.00

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
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	-
应退退补款	5,415,808.92
预提费用	19,366.00
应付指数使用费	-
可退替代款	-
其他	-
合计	5,435,174.92

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	420,734,000.00	420,734,000.00
本期申购	80,000,000.00	80,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-150,000,000.00	-150,000,000.00
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	350,734,000.00	350,734,000.00

注：本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 6.4.7.12 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	6,522,721.78	45,006,894.66	51,529,616.44
本期基金份额交易产生的变动数	248,905.54	5,380,201.46	5,629,107.00
其中：基金申购款	1,338,883.34	8,976,144.57	10,315,027.91
基金赎回款	-1,089,977.80	-3,595,943.11	-4,685,920.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,771,627.32	50,387,096.12	57,158,723.44

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	36,425.95
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	60,957.36
合计	97,383.31

#### 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 2023 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	4,296,232.41
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	4,296,232.41

##### 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 2023 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	139,855,758.40
减：卖出股票成本总额	135,416,780.34
减：交易费用	142,745.65
买卖股票差价收入	4,296,232.41

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	154,685,920.91
减：现金支付赎回款总额	154,685,920.91
减：赎回股票成本总额	-
减：交易费用	-
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**

本基金本报告期内无证券出借差价收入。

**6.4.7.15 基金投资收益**

本基金本报告期内无基金投资收益。

**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**

无。

**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****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**

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2023 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
股指期货-投资收益	742,144.41

**6.4.7.20 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,228,451.29
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	1,228,451.29

**6.4.7.21 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	44,740,804.57
——股票投资	44,740,804.57
——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	266,090.09
——权证投资	-
——期货投资	266,090.09
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	45,006,894.66

**6.4.7.22 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	55,610.84

合计	55,610.84
----	-----------

#### 6.4.7.23 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	19,366.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	1,349.40
合计	20,715.40

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 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
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人
美国花旗银行有限公司	境外资产托管人

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

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

#### 6.4.10.1.4 基金交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的基金交易。

#### 6.4.10.1.5 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内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 2023 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	556,861.23
其中：支付销售机构的客户维护费	865.10

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的 0.60% 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 × 0.60% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	139,215.27

注：支付基金托管人招商银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 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 × 0.15% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

无。

### 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 2023 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
美国花旗银行	5,717,362.16	2,037.41
招商银行	30,092,770.85	34,388.54

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行股份有限公司和境外托管人美国花旗银行有限公司保管，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

无。

#### 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（2023 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

本基金是指数型基金，紧密跟踪标普 500 指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、境外市场风险、市场制度以及交易规则不同等境外证券市场投资所面临的特有风险。本基金采用完全复制法，跟踪标普 500 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

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境内托管人及境外资产托管人,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通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算,违约风险发生的可能性很小;在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主,外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险,以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外,本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级,通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制,通过分散化投资以分散信用风险。

#### 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来自调整基金投资组合时,由于部分成份股流动性差,导致本基金难以及时完成组合调整,或承受较大市场冲击成本,从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的投资股指期货,以对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等,主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

于本期末,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。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式,流动性风险相对较低。

##### 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

制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%。

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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2023 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	35,810,133.01	-	-	-	35,810,133.01
结算备付金	3,147,146.61	-	-	-	3,147,146.61
存出保证金	-	-	-	2,225,546.40	2,225,546.40

交易性金融资产	-	-	-	376,331,638.47	376,331,638.47
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	-	-	-	186,849.01	186,849.01
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	46,461,894.00	46,461,894.00
资产总计	38,957,279.62	-	-	425,205,927.88	464,163,207.50
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	-	-	-	50,609,820.36	50,609,820.36
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	160,398.30	160,398.30
应付托管费	-	-	-	40,099.59	40,099.59
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	24,990.89	24,990.89
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	5,435,174.92	5,435,174.92

负债总计	-	-	-	56,270,484.06	56,270,484.06
利率敏感度缺口	38,957,279.62	-	-	368,935,443.82	407,892,723.44

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

假设	除市场利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(2023年6月30日)
	1. 市场利率平行上升 25 个基点	0.00
	2. 市场利率平行下降 25 个基点	0.00

#### 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 2023 年 6 月 30 日					合计
	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	
以外币计价的资产						
银行存款	5,708,906.02	-	-	-	-	5,708,906.02
结算备付金	3,147,146.61	-	-	-	-	3,147,146.61
存出保证金	2,225,546.40	-	-	-	-	2,225,546.40
交易性金融资产	376,331,638.47	-	-	-	-	376,331,638.47
应收股利	186,849.01	-	-	-	-	186,849.01
其他应收款	46,461,894.00	-	-	-	-	46,461,894.00
资产合计	434,061,980.51	-	-	-	-	434,061,980.51
以外币计						

价的负债						
应付清算款	50,506,065.58	-	-	-	-	50,506,065.58
负债合计	50,506,065.58	-	-	-	-	50,506,065.58
资产负债表外汇风险敞口净额	383,555,914.93	-	-	-	-	383,555,914.93

#### 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 (2023 年 6 月 30 日)
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	19,177,795.75
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-19,177,795.75

#### 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交易的股票, 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。

本基金采用完全复制法, 跟踪标普 500 指数, 以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则, 通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中, 标普 500 指数成份股和备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%, 且不低于非现金基金资产的 80%。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, 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 2023 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	376,331,638.47	92.26
交易性金融资产-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	376,331,638.47	92.26
----	----------------	-------

#### 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( 2023 年 6 月 30 日 )
	1.组合自身基准上升 5%	19,215,784.58
2.组合自身基准下降 5%	-19,215,784.58	

#### 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 2023 年 6 月 30 日
第一层次	376,331,638.47
第二层次	-
第三层次	-
合计	376,331,638.47

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 06 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

###### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 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	376,331,638.47	81.08
	其中: 普通股	367,558,017.40	79.19
	房地产信托	8,773,621.07	1.89
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	38,957,279.62	8.39
8	其他资产	48,874,289.41	10.53
9	合计	464,163,207.50	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	376,331,638.47	92.26
合计	376,331,638.47	92.26

## 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 (%)
能源	16,056,687.19	3.94
材料	9,413,330.59	2.31
工业	30,353,243.62	7.44
非必需消费品	39,265,172.99	9.63
必需消费品	25,107,452.06	6.16
医疗保健	50,530,416.94	12.39
金融	34,564,976.95	8.47
科技	119,456,050.65	29.29
通讯	32,854,367.64	8.05
公用事业	9,702,046.05	2.38



房地产	9,027,893.79	2.21
政府	-	-
合计	376,331,638.47	92.26

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	Apple Inc	苹果公司	AAPL UW	纳斯达克证券交易所	美国	20,731	29,056,329.66	7.12
2	Microsoft Corp	微软公司	MSFT UW	纳斯达克证券交易所	美国	10,426	25,654,986.42	6.29
3	Alphabet Inc	Alphabet 公司	GOOG UW	纳斯达克证券交易所	美国	7,165	6,262,962.51	1.54
			GOOG L UW	纳斯达克证券交易所	美国	8,330	7,204,852.41	1.77
4	Amazon.com Inc	亚马逊公司	AMZN UW	纳斯达克证券交易所	美国	12,516	11,789,512.38	2.89
5	NVIDIA Corp	英伟达	NVDA UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,468	10,600,489.65	2.60
6	Tesla Inc	特斯拉公司	TSLA UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,777	7,144,186.68	1.75
7	Meta Platforms Inc	Meta 平台股份有限公司	META UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,102	6,432,493.58	1.58
8	Berkshir	伯克希	BRK/B	纽约证	美国	2,500	6,159,9	1.51

	e Hathaway Inc	尔哈撒 韦公司	UN	券交易 所			94.50	
9	UnitedHealth Group Inc	联合健 康集团	UNH UN	纽约证 券交易 所	美国	1,305	4,532,2 76.11	1.11
10	Exxon Mobil Corp	埃克森 美孚石 油公司	XOM UN	纽约证 券交易 所	美国	5,669	4,393,2 88.21	1.08
11	Johnson & Johnson	强生	JNJ UN	纽约证 券交易 所	美国	3,644	4,358,2 76.53	1.07
12	JPMorgan Chase & Co	摩根大 通	JPM UN	纽约证 券交易 所	美国	4,097	4,305,6 20.68	1.06
13	Visa Inc	维萨公 司	V UN	纽约证 券交易 所	美国	2,269	3,893,5 65.39	0.95
14	Eli Lilly & Co	礼来	LLY UN	纽约证 券交易 所	美国	1,105	3,744,5 75.03	0.92
15	Broadcom Inc	博通股 份有限 公司	AVGO UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	585	3,666,7 07.28	0.90
16	Procter & Gamble Co/The	宝洁	PG UN	纽约证 券交易 所	美国	3,305	3,623,7 43.76	0.89
17	Mastercard Inc	万事达 股份有 限公司	MA UN	纽约证 券交易 所	美国	1,173	3,333,5 57.08	0.82
18	Home Depot Inc/The	家得宝	HD UN	纽约证 券交易 所	美国	1,420	3,187,3 63.97	0.78
19	Merck & Co Inc	默克	MRK UN	纽约证 券交易 所	美国	3,558	2,966,6 07.25	0.73
20	Chevron Corp	雪佛龙	CVX UN	纽约证 券交易 所	美国	2,443	2,777,6 41.24	0.68
21	PepsiCo Inc	百事可 乐	PEP UW	纳斯达 克证券	美国	1,932	2,585,7 16.69	0.63

				交易所				
22	Costco Wholesale Corp	开市客	COST UN	纳斯达克证券交易所	美国	622	2,419,720.70	0.59
23	AbbVie Inc	艾伯维公司	ABBV UN	纽约证券交易所	美国	2,474	2,408,518.25	0.59
24	Coca-Cola Co/The	可口可乐	KO UN	纽约证券交易所	美国	5,457	2,374,546.30	0.58
25	Adobe Inc	奥多比	ADBE UN	纳斯达克证券交易所	美国	643	2,271,940.15	0.56
26	Walmart Inc	沃尔玛股份有限公司	WMT UN	纽约证券交易所	美国	1,967	2,234,022.70	0.55
27	McDonald's Corp	麦当劳	MCD UN	纽约证券交易所	美国	1,024	2,208,001.00	0.54
28	Cisco Systems Inc	思科系统股份有限公司	CSCO UN	纳斯达克证券交易所	美国	5,743	2,147,094.59	0.53
29	Pfizer Inc	辉瑞制药	PFE UN	纽约证券交易所	美国	7,915	2,097,810.15	0.51
30	Salesforce Inc	Salesforce 股份有限公司	CRM UN	纽约证券交易所	美国	1,373	2,095,915.40	0.51
31	Thermo Fisher Scientific Inc	Thermo Fisher Scientific 公司	TMO UN	纽约证券交易所	美国	541	2,039,603.08	0.50
32	Bank of America Corp	美国银行公司	BAC UN	纽约证券交易所	美国	9,721	2,015,243.03	0.49
33	Netflix Inc	奈飞公司	NFLX UN	纳斯达克证券交易所	美国	623	1,982,942.12	0.49
34	Accenture PLC	埃森哲公司	ACN UN	纽约证券交易所	美国	885	1,973,317.57	0.48
35	Abbott	雅培制	ABT	纽约证	美国	2,438	1,920,5	0.47

	Laboratories	药	UN	券交易所			50.87	
36	Linde PLC	Linde PLC	LIN UN	纽约证券交易所	美国	686	1,888,974.99	0.46
37	Advanced Micro Devices Inc	AMD 公司	AMD UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,258	1,858,539.20	0.46
38	Oracle Corp	甲骨文	ORCL UN	纽约证券交易所	美国	2,158	1,857,003.29	0.46
39	Comcast Corp	康卡斯特公司	CMCS A UW	纳斯达克证券交易所	美国	5,832	1,750,952.97	0.43
40	Texas Instruments Inc	德州仪器	TXN UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,273	1,655,903.78	0.41
41	Walt Disney Co/The	华特迪士尼公司	DIS UN	纽约证券交易所	美国	2,562	1,652,795.96	0.41
42	Wells Fargo & Co	富国银行	WFC UN	纽约证券交易所	美国	5,261	1,622,477.37	0.40
43	Danaher Corp	丹纳赫	DHR UN	纽约证券交易所	美国	931	1,614,532.75	0.40
44	Verizon Communications Inc	Verizon 通信股份有限公司	VZ UN	纽约证券交易所	美国	5,895	1,584,148.62	0.39
45	Philip Morris International Inc	菲利普莫里斯国际集团公司	PM UN	纽约证券交易所	美国	2,176	1,534,912.53	0.38
46	NextEra Energy Inc	新纪元能源公司	NEE UN	纽约证券交易所	美国	2,837	1,521,069.92	0.37
47	Raytheon Technologies Corp	雷神技术公司	RTX UN	纽约证券交易所	美国	2,049	1,450,362.87	0.36

48	Intel Corp	英特尔	INTC UW	纳斯达克 证券交易 所	美国	5,848	1,413,0 56.64	0.35
49	Honeywell International Inc	霍尼韦尔	HON UW	纳斯达克 证券交易 所	美国	933	1,398,8 96.82	0.34
50	NIKE Inc	耐克公司	NKE UN	纽约证 券交易 所	美国	1,728	1,378,0 99.95	0.34
51	Lowe's Cos Inc	劳氏	LOW UN	纽约证 券交易 所	美国	836	1,363,4 01.52	0.33
52	Bristol-Myers Squibb Co	百时美施贵宝公司	BMY UN	纽约证 券交易 所	美国	2,946	1,361,3 16.87	0.33
53	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM UW	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,562	1,343,5 68.72	0.33
54	S&P Global Inc	标普全球	SPGI UN	纽约证 券交易 所	美国	460	1,332,5 05.44	0.33
55	United Parcel Service Inc	联合包裹服务股份有限公司	UPS UN	纽约证 券交易 所	美国	1,016	1,315,9 48.24	0.32
56	Intuit Inc	Intuit 股份有限公司	INTU UW	纳斯达克 证券交易 所	美国	393	1,301,1 40.20	0.32
57	Caterpillar Inc	卡特彼勒	CAT UN	纽约证 券交易 所	美国	723	1,285,4 27.55	0.32
58	Conoco Phillips	康菲石油	COP UN	纽约证 券交易 所	美国	1,697	1,270,4 84.74	0.31
59	Union Pacific Corp	联合太平洋	UNP UN	纽约证 券交易 所	美国	855	1,264,1 54.43	0.31
60	Applied Materials Inc	应用材料	AMAT UW	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,185	1,237,6 34.30	0.30
61	International	国际商业机器	IBM UN	纽约证 券交易	美国	1,273	1,230,8 43.71	0.30

	Business Machines Corp			所				
62	Intuitive Surgical Inc	直觉外科手术公司	ISRG UW	纳斯达克证券交易所	美国	491	1,213,157.92	0.30
63	General Electric Co	通用电气	GE UN	纽约证券交易所	美国	1,527	1,212,062.56	0.30
64	Boeing Co/The	波音	BA UN	纽约证券交易所	美国	793	1,209,959.34	0.30
65	Amgen Inc	安进公司	AMGN UW	纳斯达克证券交易所	美国	749	1,201,599.81	0.29
66	Medtronic PLC	美敦力	MDT UN	纽约证券交易所	美国	1,865	1,187,245.91	0.29
67	Service Now Inc	Service Now 公司	NOW UN	纽约证券交易所	美国	286	1,161,355.29	0.28
68	AT&T Inc	美国电话电报公司	T UN	纽约证券交易所	美国	10,024	1,155,281.14	0.28
69	Starbucks Corp	星巴克公司	SBUX UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,607	1,150,270.91	0.28
70	Prologis Inc	安博	PLD UN	纽约证券交易所	美国	1,295	1,147,499.31	0.28
71	Morgan Stanley	摩根士丹利	MS UN	纽约证券交易所	美国	1,827	1,127,411.23	0.28
72	Deere & Co	迪尔	DE UN	纽约证券交易所	美国	378	1,106,716.68	0.27
73	Goldman Sachs Group Inc/The	高盛	GS UN	纽约证券交易所	美国	466	1,086,064.04	0.27
74	Elevance Health Inc	Elevance 健康股份有	ELV UN	纽约证券交易所	美国	332	1,065,836.43	0.26

		限公司						
75	Lockheed Martin Corp	洛克希德马丁	LMT UN	纽约证券交易所	美国	316	1,051,209.96	0.26
76	American Express Co	美国运通	AXP UN	纽约证券交易所	美国	834	1,049,784.46	0.26
77	BlackRock Inc	贝莱德有限公司	BLK UN	纽约证券交易所	美国	210	1,048,748.28	0.26
78	Stryker Corp	史赛克	SYK UN	纽约证券交易所	美国	474	1,044,942.16	0.26
79	Booking Holdings Inc	Booking 控股股份有限公司	BKNG UW	纳斯达克证券交易所	美国	52	1,014,626.31	0.25
80	Mondelez International Inc	亿滋国际	MDLZ UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,909	1,006,138.17	0.25
81	Analog Devices Inc	亚德诺半导体	ADI UW	纳斯达克证券交易所	美国	709	998,029.59	0.24
82	TJX Cos Inc/The	TJX 公司	TJX UN	纽约证券交易所	美国	1,615	989,471.06	0.24
83	Gilead Sciences Inc	吉利德科学	GILD UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,749	974,004.82	0.24
84	Marsh & McLennan Cos Inc	Marsh & McLennan 股份有限公司	MMC UN	纽约证券交易所	美国	694	943,165.75	0.23
85	Automatic Data Processing Inc	ADP 公司	ADP UW	纳斯达克证券交易所	美国	579	919,543.82	0.23
86	Vertex Pharmaceutical	福泰制药	VRTX UW	纳斯达克证券交易所	美国	361	917,962.09	0.23

	s Inc							
87	American Tower Corp	美国发射塔公司	AMT UN	纽约证券交易所	美国	653	915,095.69	0.22
88	Citigroup Inc	花旗集团	C UN	纽约证券交易所	美国	2,730	908,205.02	0.22
89	CVS Health Corp	CVS 健康公司	CVS UN	纽约证券交易所	美国	1,798	898,136.16	0.22
90	Lam Research Corp	泛林集团	LRCX UW	纳斯达克证券交易所	美国	188	873,293.42	0.21
91	Charles Schwab Corp/The	嘉信理财	SCHW UN	纽约证券交易所	美国	2,084	853,519.59	0.21
92	Cigna Group/The	信诺集团	CI UN	纽约证券交易所	美国	415	841,437.18	0.21
93	Altria Group Inc	高特利	MO UN	纽约证券交易所	美国	2,503	819,303.84	0.20
94	Eaton Corp PLC	伊顿	ETN UN	纽约证券交易所	美国	559	812,287.58	0.20
95	T-Mobile US Inc	T-Mobile US 股份有限公司	TMUS UW	纳斯达克证券交易所	美国	808	810,960.20	0.20
96	Chubb Ltd	邱博保险集团	CB UN	纽约证券交易所	美国	581	808,403.43	0.20
97	Zoetis Inc	硕腾股份有限公司	ZTS UN	纽约证券交易所	美国	648	806,342.05	0.20
98	Fiserv Inc	Fiserv 公司	FI UN	纽约证券交易所	美国	866	789,389.02	0.19
99	Boston Scientific Corp	波士顿科学	BSX UN	纽约证券交易所	美国	2,016	787,940.54	0.19
100	Progressive	前进保险公司	PGR UN	纽约证券交易所	美国	821	785,269.38	0.19



	Corp/Th e			所				
101	Regener on Pharma ceutical s Inc	再生元 制药股 份有限 公司	REGN UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	151	783,995 .98	0.19
102	Palo Alto Networ ks Inc	Palo Alto Networ ks 股 份有 限公 司	PANW UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	424	782,816 .00	0.19
103	Souther n Co/The	南方公 司	SO UN	纽约证 券交易 所	美国	1,529	776,139 .44	0.19
104	Becton Dickins on & Co	碧迪	BDX UN	纽约证 券交易 所	美国	398	759,258 .02	0.19
105	PayPal Holdings Inc	Paypal 控股股 份有限 公司	PYPL UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,564	754,125 .82	0.18
106	Equinix Inc	Equinix 有限公 司	EQIX UQ	纳斯达 克证券 交易所	美国	131	742,061 .77	0.18
107	Aon PLC	怡安集 团	AON UN	纽约证 券交易 所	美国	286	713,383 .00	0.17
108	Schlum berger NV	斯伦贝 谢公众 有限公 司	SLB UN	纽约证 券交易 所	美国	1,999	709,507 .66	0.17
109	CSX Corp	CSX 公 司	CSX UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,851	702,485 .77	0.17
110	Illinois Tool Works Inc	伊利诺 伊工具 股份有 限公司	ITW UN	纽约证 券交易 所	美国	388	701,351 .18	0.17
111	Duke Energy Corp	杜克能 源	DUK UN	纽约证 券交易 所	美国	1,081	700,967 .20	0.17
112	Micron	美光科	MU	纳斯达	美国	1,534	699,535	0.17

	Technol ogy Inc	技股份 有限公司	UW	克证券 交易所			.05	
113	EOG Resourc es Inc	EOG 资 源	EOG UN	纽约证 券交易 所	美国	820	678,074 .85	0.17
114	Air Product s and Chemic als Inc	空气产 品公司	APD UN	纽约证 券交易 所	美国	313	677,439 .63	0.17
115	CME Group Inc	芝加哥 商业交 易所	CME UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	504	674,789 .71	0.17
116	Synopsy s Inc	新思科 技公司	SNPS UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	214	673,283 .71	0.17
117	KLA Corp	KLA 公 司	KLAC UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	192	672,894 .24	0.16
118	Northro p Grumm an Corp	诺斯洛 普格鲁 门公司	NOC UN	纽约证 券交易 所	美国	200	658,703 .93	0.16
119	Waste Manage ment Inc	废品管 理	WM UN	纽约证 券交易 所	美国	519	650,357 .98	0.16
120	Colgate- Palmoli ve Co	高露洁 棕榄	CL UN	纽约证 券交易 所	美国	1,163	647,413 .76	0.16
121	Cadence Design Systems Inc	Cadence 设计系 统股份 有限公司	CDNS UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	382	647,335 .14	0.16
122	Intercon tinenta l Exchan ge Inc	洲际交 易所 (ICE)	ICE UN	纽约证 券交易 所	美国	785	641,418 .37	0.16
123	HCA Healthc are Inc	HCA 医 疗保健 有限公司	HCA UN	纽约证 券交易 所	美国	289	633,743 .99	0.16

124	Sherwin-Williams Co/The	宣伟公司	SHW UN	纽约证券交易所	美国	329	631,217.56	0.15
125	Target Corp	塔吉特公司	TGT UN	纽约证券交易所	美国	647	616,644.71	0.15
126	Activision Blizzard Inc	动视暴雪股份有限公司	ATVI UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,003	610,962.34	0.15
127	Chipotle Mexican Grill Inc	Chipotle Mexican Grill 股份有限公司	CMG UN	纽约证券交易所	美国	39	602,783.46	0.15
128	Ford Motor Co	福特汽车	F UN	纽约证券交易所	美国	5,510	602,388.21	0.15
129	O'Reilly Automotive Inc	O'Reilly 汽车股份有限公司	ORLY UW	纳斯达克证券交易所	美国	85	586,738.57	0.14
130	McKesson Corp	McKesson 公司	MCK UN	纽约证券交易所	美国	190	586,654.75	0.14
131	Freeport-McMoran Inc	自由港迈克墨伦股份有限公司	FCX UN	纽约证券交易所	美国	2,010	580,954.32	0.14
132	FedEx Corp	联邦快递	FDX UN	纽约证券交易所	美国	324	580,373.37	0.14
133	Edwards Lifesciences Corp	爱德华生命科学公司	EW UN	纽约证券交易所	美国	850	579,368.26	0.14
134	Humana Inc	Humana 股份有限公司	HUM UN	纽约证券交易所	美国	175	565,402.59	0.14
135	3M Co	3M 公司	MMM UN	纽约证券交易所	美国	774	559,780.27	0.14

				所				
136	Moody's Corp	穆迪	MCO UN	纽约证券交易所	美国	221	555,274.69	0.14
137	General Motors Co	通用汽车公司	GM UN	纽约证券交易所	美国	1,949	543,043.73	0.13
138	NXP Semiconductors NV	恩智浦半导体公司	NXPI UW	纳斯达克证券交易所	美国	364	538,347.53	0.13
139	Emerson Electric Co	艾默生电气	EMR UN	纽约证券交易所	美国	801	523,165.19	0.13
140	Norfolk Southern Corp	诺福克南方	NSC UN	纽约证券交易所	美国	319	522,688.65	0.13
141	Roper Technologies Inc	儒博技术公司	ROP UN	纽约证券交易所	美国	149	517,650.53	0.13
142	Amphenol Corp	安费诺公司	APH UN	纽约证券交易所	美国	835	512,549.48	0.13
143	PNC Financial Services Group Inc/The	PNC 财务服务	PNC UN	纽约证券交易所	美国	560	509,650.13	0.12
144	Parker-Hannifin Corp	派克汉尼汾公司	PH UN	纽约证券交易所	美国	180	507,303.19	0.12
145	Dexcom Inc	Dexcom 股份有限公司	DXCM UW	纳斯达克证券交易所	美国	544	505,151.63	0.12
146	Marathon Petroleum Corp	马拉松石油公司	MPC UN	纽约证券交易所	美国	595	501,304.33	0.12
147	Crown Castle Inc	冠城股份有限公司	CCI UN	纽约证券交易所	美国	608	500,571.05	0.12

148	Fortinet Inc	Fortinet 股份有限公司	FTNT UW	纳斯达克证券交易所	美国	914	499,225.17	0.12
149	Motorola Solutions Inc	摩托罗拉解决方案股份有限公司	MSI UN	纽约证券交易所	美国	235	498,007.92	0.12
150	Microchip Technology Inc	微芯科技股份有限公司	MCHP UW	纳斯达克证券交易所	美国	768	497,172.04	0.12
151	Pioneer Natural Resources Co	Pioneer 自然资源公司	PXD UN	纽约证券交易所	美国	328	491,029.53	0.12
152	General Dynamics Corp	通用动力	GD UN	纽约证券交易所	美国	315	489,708.72	0.12
153	Marriott International Inc/MD	万豪国际	MAR UW	纳斯达克证券交易所	美国	362	480,485.21	0.12
154	Arthur J Gallagher & Co	亚瑟加拉格尔有限公司	AJG UN	纽约证券交易所	美国	300	475,970.67	0.12
155	Johnson Controls International plc	江森自控国际有限公司	JCI UN	纽约证券交易所	美国	962	473,656.10	0.12
156	Kimberly-Clark Corp	金佰利	KMB UN	纽约证券交易所	美国	473	471,861.94	0.12
157	TransDigm Group Inc	TransDigm 集团公司	TDG UN	纽约证券交易所	美国	73	471,659.83	0.12
158	AutoZone Inc	AutoZone 股份有限公司	AZO UN	纽约证券交易所	美国	26	468,429.54	0.11
159	Public Storage	公共存储公司	PSA UN	纽约证券交易所	美国	222	468,212.76	0.11

				所				
160	Ecolab Inc	艺康集团	ECL UN	纽约证券交易所	美国	347	468,097.66	0.11
161	US Bancorp	美国合众银行	USB UN	纽约证券交易所	美国	1,956	466,976.28	0.11
162	Sempra Energy	桑普拉能源	SRE UN	纽约证券交易所	美国	441	463,933.86	0.11
163	Estee Lauder Cos Inc/The	雅诗兰黛	EL UN	纽约证券交易所	美国	325	461,175.85	0.11
164	General Mills Inc	通用磨坊	GIS UN	纽约证券交易所	美国	824	456,676.34	0.11
165	TE Connectivity Ltd	泰科电子公司	TEL UN	纽约证券交易所	美国	442	447,643.51	0.11
166	Monster Beverage Corp	怪兽饮料公司	MNST UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,071	444,518.50	0.11
167	Autodesk Inc	欧特克	ADSK UW	纳斯达克证券交易所	美国	300	443,541.28	0.11
168	Phillips 66	Phillips 66	PSX UN	纽约证券交易所	美国	643	443,153.54	0.11
169	PACCAR Inc	帕卡	PCAR UW	纳斯达克证券交易所	美国	733	443,053.18	0.11
170	Trane Technologies PLC	特灵科技公共有限公司	TT UN	纽约证券交易所	美国	320	442,242.08	0.11
171	American Electric Power Co Inc	美国电力	AEP UW	纳斯达克证券交易所	美国	722	439,273.72	0.11
172	Domini Energy	Domini 能源股份有	D UN	纽约证券交易所	美国	1,172	438,590.74	0.11

	Inc	限公司						
173	Cintas Corp	CINTAS 公司	CTAS UW	纳斯达克证券交易所	美国	121	434,607.88	0.11
174	Valero Energy Corp	Valero 能源	VLO UN	纽约证券交易所	美国	507	429,726.27	0.11
175	Occidental Petroleum Corp	西方石油	OXY UN	纽约证券交易所	美国	1,007	427,851.18	0.10
176	Capital One Financial Corp	第一资本金融	COF UN	纽约证券交易所	美国	535	422,802.87	0.10
177	IQVIA Holdings Inc	艾昆纬	IQV UN	纽约证券交易所	美国	260	422,277.20	0.10
178	American International Group Inc	美国国际集团	AIG UN	纽约证券交易所	美国	1,015	422,009.12	0.10
179	IDEXX Laboratories Inc	爱德士股份有限公司	IDXX UW	纳斯达克证券交易所	美国	116	420,965.57	0.10
180	Carrier Global Corp	开利全球公司	CARR UN	纽约证券交易所	美国	1,171	420,616.78	0.10
181	Biogen Inc	渤健公司	BIIB UW	纳斯达克证券交易所	美国	203	417,828.63	0.10
182	Archer-Daniels-Midland Co	Archer-Daniels-Midland 公司	ADM UN	纽约证券交易所	美国	764	417,129.83	0.10
183	Nucor Corp	纽柯公司	NUE UN	纽约证券交易所	美国	352	417,080.11	0.10
184	ON Semiconductor Corp	安森美半导体公司	ON UW	纳斯达克证券交易所	美国	606	414,150.20	0.10

185	Corteva Inc	科迪华公司	CTVA UN	纽约证券交易所	美国	997	412,796.22	0.10
186	Exelon Corp	Exelon 公司	EXC UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,395	410,658.83	0.10
187	Arista Networks Inc	Arista 网络股份有限公司	ANET UN	纽约证券交易所	美国	350	409,854.60	0.10
188	Truist Financial Corp	Truist 金融公司	TFC UN	纽约证券交易所	美国	1,868	409,658.06	0.10
189	Realty Income Corp	Realty Income 公司	O UN	纽约证券交易所	美国	948	409,564.99	0.10
190	Welltower Inc	Welltower Inc	WELL UN	纽约证券交易所	美国	697	407,392.99	0.10
191	Travelers Cos Inc/The	旅行家集团	TRV UN	纽约证券交易所	美国	324	406,565.71	0.10
192	Moderna Inc	莫德纳公司	MRNA UW	纳斯达克证券交易所	美国	460	403,849.96	0.10
193	Williams Cos Inc/The	威廉姆斯公司	WMB UN	纽约证券交易所	美国	1,708	402,708.57	0.10
194	Constellation Brands Inc	星座品牌股份有限公司	STZ UN	纽约证券交易所	美国	226	401,937.87	0.10
195	Copart Inc	Copart 股份有限公司	CPRT UW	纳斯达克证券交易所	美国	601	396,098.20	0.10
196	Yum! Brands Inc	百胜餐饮集团	YUM UN	纽约证券交易所	美国	393	393,445.89	0.10
197	Hilton Worldwide Holdings Inc	希尔顿全球控股股份有限公司	HLT UN	纽约证券交易所	美国	371	390,186.34	0.10
198	Ross	罗斯百	ROST	纳斯达克	美国	480	388,909	0.10



	Stores Inc	货股份有限公司	UW	克证券交易所			.90	
199	Aflac Inc	家庭人寿保险	AFL UN	纽约证券交易所	美国	771	388,862.21	0.10
200	Charter Communications Inc	Charter 通信公司	CHTR UW	纳斯达克证券交易所	美国	146	387,563.15	0.10
201	Rockwell Automation Inc	罗克韦尔自动化	ROK UN	纽约证券交易所	美国	161	383,266.91	0.09
202	DR Horton Inc	霍顿房屋公司	DHI UN	纽约证券交易所	美国	435	382,498.81	0.09
203	Simon Property Group Inc	西蒙房地产集团公司	SPG UN	纽约证券交易所	美国	458	382,171.41	0.09
204	Dow Inc	陶氏公司	DOW UN	纽约证券交易所	美国	992	381,767.34	0.09
205	Sysco Corp	Sysco 公司	SY Y UN	纽约证券交易所	美国	710	380,669.60	0.09
206	Hess Corp	赫斯公司	HES UN	纽约证券交易所	美国	387	380,168.49	0.09
207	MSCI Inc	MSCI 明晟	MSCI UN	纽约证券交易所	美国	112	379,791.52	0.09
208	AMETEK Inc	阿美特克股份有限公司	AME UN	纽约证券交易所	美国	323	377,817.14	0.09
209	Dollar General Corp	达乐公司	DG UN	纽约证券交易所	美国	307	376,626.47	0.09
210	L3Harris Technologies	L3Harris Technologies 股	LHX UN	纽约证券交易所	美国	266	376,282.23	0.09

	Inc	份有限公司						
211	Centene Corp	Centene 公司	CNC UN	纽约证券交易所	美国	769	374,795.38	0.09
212	Hershey Co/The	好时公司	HSY UN	纽约证券交易所	美国	207	373,486.43	0.09
213	Otis Worldwide Corp	奥的斯电梯公司	OTIS UN	纽约证券交易所	美国	579	372,394.54	0.09
214	CoStar Group Inc	CoStar 集团股份有限公司	CSGP UW	纳斯达克证券交易所	美国	573	368,494.12	0.09
215	MetLife Inc	大都会集团	MET UN	纽约证券交易所	美国	902	368,443.98	0.09
216	Paychex Inc	Paychex 公司	PAYX UW	纳斯达克证券交易所	美国	450	363,757.61	0.09
217	Agilent Technologies Inc	安捷伦	A UN	纽约证券交易所	美国	415	360,594.52	0.09
218	WW Grainger Inc	固安捷股份有限公司	GWV UN	纽约证券交易所	美国	63	358,986.20	0.09
219	PPG Industries Inc	PPG 工业	PPG UN	纽约证券交易所	美国	330	353,623.43	0.09
220	Cummins Inc	康明斯	CMI UN	纽约证券交易所	美国	198	350,752.47	0.09
221	Ameriprise Financial Inc	阿默普莱斯金融公司	AMP UN	纽约证券交易所	美国	146	350,417.77	0.09
222	Xcel Energy Inc	Xcel 能源	XEL UW	纳斯达克证券交易所	美国	772	346,804.01	0.09
223	Kinder Morgan Inc	特拉华州金德摩根公	KMI UN	纽约证券交易所	美国	2,765	344,044.18	0.08

		司						
224	Newmont Corp	纽蒙黄金公司	NEM UN	纽约证券交易所	美国	1,114	343,393.43	0.08
225	Electronic Arts Inc	电子艺界	EA UW	纳斯达克证券交易所	美国	365	342,072.98	0.08
226	Fastenal Co	法思诺公司	FAST UW	纳斯达克证券交易所	美国	801	341,426.20	0.08
227	Old Dominion Freight Line Inc	Old Dominion Freight Line 股份有限公司	ODFL UW	纳斯达克证券交易所	美国	126	336,639.18	0.08
228	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	409	336,525.96	0.08
229	Cognizant Technology Solutions Corp	高知特科技公司	CTSH UW	纳斯达克证券交易所	美国	712	335,850.56	0.08
230	DuPont de Nemours Inc	杜邦公司	DD UN	纽约证券交易所	美国	644	332,439.98	0.08
231	Verisk Analytics Inc	Verisk 分析公司	VRSK UW	纳斯达克证券交易所	美国	203	331,549.26	0.08
232	Fidelity National Information Services Inc	繁德信息技术有限公司	FIS UN	纽约证券交易所	美国	831	328,453.80	0.08
233	Prudential Financial Inc	保德信金融集团	PRU UN	纽约证券交易所	美国	512	326,379.56	0.08

234	ResMed Inc	瑞思迈股份有限公司	RMD UN	纽约证券交易所	美国	206	325,240.48	0.08
235	Baker Hughes Co	贝克休斯公司	BKR UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,419	324,110.30	0.08
236	Bank of New York Mellon Corp/The	纽约梅隆银行股份有限公司	BK UN	纽约证券交易所	美国	1,007	323,944.46	0.08
237	Lennar Corp	Lennar 公司	LEN UN	纽约证券交易所	美国	356	322,345.54	0.08
238	GE Healthcare Technologies Inc	GE Healthcare Technologies Inc	GEHC UW	纳斯达克证券交易所	美国	548	321,689.15	0.08
239	Republic Services Inc	公共服务公司	RSG UN	纽约证券交易所	美国	289	319,858.20	0.08
240	VICI Properties Inc	VICI Properties 股份有限公司	VICI UN	纽约证券交易所	美国	1,408	319,766.51	0.08
241	Consolidated Edison Inc	联合爱迪生	ED UN	纽约证券交易所	美国	486	317,461.19	0.08
242	Public Service Enterprise Group Inc	公共服务企业集团	PEG UN	纽约证券交易所	美国	700	316,685.14	0.08
243	AmerisourceBergen Corp	美源伯根	ABC UN	纽约证券交易所	美国	227	315,634.58	0.08

244	Devon Energy Corp	戴文能源	DVN UN	纽约证券交易所	美国	900	314,365.65	0.08
245	Kroger Co/The	克罗格公司	KR UN	纽约证券交易所	美国	916	311,085.14	0.08
246	Delta Air Lines Inc	达美航空有限公司	DAL UN	纽约证券交易所	美国	901	309,506.59	0.08
247	United Rentals Inc	联合租赁公司	URI UN	纽约证券交易所	美国	96	308,942.84	0.08
248	Zimmer Biomet Holdings Inc	捷迈邦美控股股份有限公司	ZBH UN	纽约证券交易所	美国	292	307,206.33	0.08
249	Vulcan Materials Co	Vulcan 材料	VMC UN	纽约证券交易所	美国	187	304,620.07	0.07
250	Dollar Tree Inc	美元树公司	DLTR UW	纳斯达克证券交易所	美国	292	302,775.47	0.07
251	Keysight Technologies Inc	是德科技公司	KEYS UN	纽约证券交易所	美国	250	302,490.05	0.07
252	Halliburton Co	哈利伯顿	HAL UN	纽约证券交易所	美国	1,265	301,549.61	0.07
253	Constellation Energy Corp	美国联合能源公司	CEG UW	纳斯达克证券交易所	美国	455	300,992.51	0.07
254	Illumina Inc	Illumina 公司	ILMN UW	纳斯达克证券交易所	美国	222	300,757.88	0.07
255	Discover Financial Services	Discover 金融服务公司	DFS UN	纽约证券交易所	美国	356	300,583.16	0.07
256	Mettler-	梅特勒-	MTD	纽约证	美国	31	293,807	0.07

	Toledo International Inc	托利多国际股份有限公司	UN	券交易所			.10	
257	Equifax Inc	Equifax 股份有限公司	EFX UN	纽约证券交易所	美国	172	292,439.69	0.07
258	ANSYS Inc	ANSYS 股份有限公司	ANSS UW	纳斯达克证券交易所	美国	122	291,148.73	0.07
259	Allstate Corp/The	好事达保险公司	ALL UN	纽约证券交易所	美国	369	290,735.55	0.07
260	Martin Marietta Materials Inc	Martin Marietta 材料股份有限公司	MLM UN	纽约证券交易所	美国	87	290,238.93	0.07
261	Quanta Services Inc	Quanta 服务股份有限公司	PWR UN	纽约证券交易所	美国	204	289,579.72	0.07
262	West Pharmaceutical Services Inc	西氏医药服务公司	WST UN	纽约证券交易所	美国	104	287,419.78	0.07
263	Kraft Heinz Co/The	卡夫亨氏公司	KHC UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,118	286,784.78	0.07
264	PG&E Corp	太平洋煤气电力	PCG UN	纽约证券交易所	美国	2,267	283,061.76	0.07
265	Arch Capital Group Ltd	阿契资本集团	ACGL UW	纳斯达克证券交易所	美国	522	282,324.29	0.07
266	WEC Energy Group Inc	WEC 能源集团股份有限公司	WEC UN	纽约证券交易所	美国	442	281,821.23	0.07
267	Warner Bros Discover	华纳兄弟探索股份有	WBD UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,108	281,620.64	0.07

	ry Inc	限公司						
268	American Water Works Co Inc	美国自来水股份有限公司	AWK UN	纽约证券交易所	美国	273	281,594.85	0.07
269	Gartner Inc	Gartner 公司	IT UN	纽约证券交易所	美国	111	280,970.97	0.07
270	ONEOK Inc	Oneok 股份有限公司	OKE UN	纽约证券交易所	美国	627	279,627.19	0.07
271	Aptiv PLC	Aptiv 公共有限公司	APT UN	纽约证券交易所	美国	379	279,581.45	0.07
272	Xylem Inc/NY	赛莱默公司	XYL UN	纽约证券交易所	美国	335	272,612.81	0.07
273	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	199	272,157.81	0.07
274	Corning Inc	康宁公司	GLW UN	纽约证券交易所	美国	1,073	271,675.05	0.07
275	HP Inc	惠普	HPQ UN	纽约证券交易所	美国	1,216	269,835.65	0.07
276	Edison International	爱迪生国际	EIX UN	纽约证券交易所	美国	537	269,483.68	0.07
277	Fortive Corp	福迪威公司	FTV UN	纽约证券交易所	美国	496	267,975.44	0.07
278	Ingersoll Rand Inc	英格索兰股份有限公司	IR UN	纽约证券交易所	美国	567	267,781.79	0.07
279	Keurig Dr Pepper Inc	Keurig Dr Pepper 有限公司	KDP UN	纳斯达克证券交易所	美国	1,181	266,847.85	0.07
280	Albema	雅保公	ALB	纽约证	美国	165	265,980	0.07

	rle Corp	司	UN	券交易所			.61	
281	Global Payments Inc	环汇有限公司	GPN UN	纽约证券交易所	美国	367	261,262.09	0.06
282	Align Technology Inc	Align 科技股份有限公司	ALGN UW	纳斯达克证券交易所	美国	100	255,533.19	0.06
283	T Rowe Price Group Inc	普徠仕	TROW UW	纳斯达克证券交易所	美国	315	254,971.75	0.06
284	SBA Communications Corp	SBA 通信公司	SBAC UW	纳斯达克证券交易所	美国	152	254,547.01	0.06
285	CBRE Group Inc	世邦魏理仕	CBRE UN	纽约证券交易所	美国	436	254,272.72	0.06
286	Willis Towers Watson PLC	韦莱韬睿惠悦公共有限公司	WTW UW	纳斯达克证券交易所	美国	149	253,549.71	0.06
287	CDW Corp/DE	特拉华 CDW 公司	CDW UW	纳斯达克证券交易所	美国	189	250,601.58	0.06
288	Eversource Energy	Eversource 能源公司	ES UN	纽约证券交易所	美国	489	250,589.88	0.06
289	State Street Corp	道富集团	STT UN	纽约证券交易所	美国	473	250,114.85	0.06
290	Weyerhaeuser Co	惠好	WY UN	纽约证券交易所	美国	1,027	248,674.25	0.06
291	Church & Dwight Co Inc	切迟杜威股份有限公司	CHD UN	纽约证券交易所	美国	342	247,690.74	0.06
292	Tractor Supply Co	拖拉机供应公司	TSCO UW	纳斯达克证券交易所	美国	154	246,034.15	0.06
293	Monolit	芯源系	MPWR	纳斯达克	美国	63	245,926	0.06



	hic Power Systems Inc	统有限 公司	UW	克证 券交 易所			.42	
294	Cardinal Health Inc	嘉德诺 健康集 团	CAH UN	纽约证 券交易 所	美国	359	245,320 .46	0.06
295	eBay Inc	eBay 公 司	EBAY UW	纳斯达 克证 券交 易所	美国	750	242,190 .75	0.06
296	Diamon dback Energy Inc	Diamon dback 能源股 份有限 公司	FANG UW	纳斯达 克证 券交 易所	美国	254	241,092 .00	0.06
297	Genuine Parts Co	原配部 件	GPC UN	纽约证 券交易 所	美国	197	240,895 .96	0.06
298	Ulta Beauty Inc	Ulta 美 容产品 公司	ULTA UW	纳斯达 克证 券交 易所	美国	70	238,029 .77	0.06
299	Lyondel lBasell Industri es NV	利安德 巴塞尔 工业公 司	LYB UN	纽约证 券交易 所	美国	356	236,222 .10	0.06
300	Take-T wo Interacti ve Softwar e Inc	Take-T wo 互动 软件股 份有限 公司	TTWO UW	纳斯达 克证 券交 易所	美国	222	236,063 .42	0.06
301	Baxter Internati onal Inc	百特	BAX UN	纽约证 券交易 所	美国	709	233,408 .08	0.06
302	Enphase Energy Inc	Enphase 能源股 份有限 公司	ENPH UQ	纳斯达 克证 券交 易所	美国	192	232,353 .98	0.06
303	Royal Caribbe an Cruises Ltd	皇家加 勒比国 际游轮 有限公 司	RCL UN	纽约证 券交易 所	美国	308	230,878 .18	0.06
304	DTE	DTE 能	DTE	纽约证	美国	289	229,749	0.06

	Energy Co	源	UN	券交易所			.95	
305	Equity Residential	公寓物业权益信托	EQR UN	纽约证券交易所	美国	478	227,855.92	0.06
306	Hartford Financial Services Group Inc/The	哈特福德金融服务	HIG UN	纽约证券交易所	美国	435	226,374.92	0.06
307	STERIS PLC	思泰瑞医疗公共有限公司	STE UN	纽约证券交易所	美国	139	225,966.81	0.06
308	McCormick & Co Inc/MD	味好美股份有限公司/马里兰州	MKC UN	纽约证券交易所	美国	352	221,867.90	0.05
309	Hewlett Packard Enterprise Co	慧与	HPE UN	纽约证券交易所	美国	1,817	220,571.88	0.05
310	Southwest Airlines Co	西南航空	LUV UN	纽约证券交易所	美国	834	218,212.95	0.05
311	Ameren Corp	Ameren 公司	AEE UN	纽约证券交易所	美国	368	217,168.24	0.05
312	Laboratory Corp of America Holdings	美国实验控股	LH UN	纽约证券交易所	美国	124	216,231.49	0.05
313	FirstEnergy Corp	第一能源	FE UN	纽约证券交易所	美国	763	214,356.54	0.05
314	Dover Corp	都福	DOV UN	纽约证券交易所	美国	196	209,110.32	0.05
315	M&T	M&T	MTB	纽约证	美国	233	208,363	0.05

	Bank Corp	银行	UN	券交易所			.75	
316	Entergy Corp	Entergy 公司	ETR UN	纽约证 券交易 所	美国	296	208,258 .54	0.05
317	VeriSign Inc	威瑞信 股份有 限公司	VRSN UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	127	207,367 .38	0.05
318	Walgreens Boots Alliance Inc	沃博联 股份有 限公司	WBA UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,004	206,686 .49	0.05
319	International Flavors & Fragrances Inc	国际香 料	IFF UN	纽约证 券交易 所	美国	358	205,886 .31	0.05
320	Darden Restaurants Inc	达登餐 饮公司	DRI UN	纽约证 券交易 所	美国	170	205,238 .73	0.05
321	Fair Isaac Corp	费埃哲 公司	FICO UN	纽约证 券交易 所	美国	35	204,651 .64	0.05
322	Insulet Corp	Insulet 股份有 限公司	PODD UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	98	204,181 .74	0.05
323	Extra Space Storage Inc	Extra Space Storage 有限公司	EXR UN	纽约证 券交易 所	美国	189	203,280 .90	0.05
324	Invitation Homes Inc	邀请家 园公司	INVH UN	纽约证 券交易 所	美国	815	202,582 .53	0.05
325	Hologic Inc	豪洛捷 公司	HOLX UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	345	201,850 .19	0.05
326	Raymond James Financial Inc	Raymond James 金融股 份有限 公司	RJF UN	纽约证 券交易 所	美国	269	201,701 .92	0.05

327	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	西屋制动公司	WAB UN	纽约证券交易所	美国	252	199,698.28	0.05
328	Clorox Co/The	高乐氏公司	CLX UN	纽约证券交易所	美国	173	198,810.08	0.05
329	PPL Corp	PPL 公司	PPL UN	纽约证券交易所	美国	1,033	197,504.09	0.05
330	Broadridge Financial Solutions Inc	布罗德里奇金融解决方案股份有限公司	BR UN	纽约证券交易所	美国	165	197,473.53	0.05
331	Teledyne Technologies Inc	Teledyne 科技股份有限公司	TDY UN	纽约证券交易所	美国	66	196,059.51	0.05
332	Coterra Energy Inc	Coterra 能源股份有限公司	CTRA UN	纽约证券交易所	美国	1,062	194,147.13	0.05
333	Ventas Inc	Ventas 公司	VTR UN	纽约证券交易所	美国	566	193,324.98	0.05
334	Las Vegas Sands Corp	拉斯维加斯金沙集团	LVS UN	纽约证券交易所	美国	461	193,203.44	0.05
335	Omnico Group Inc	Omnico m 集团	OMC UN	纽约证券交易所	美国	280	192,509.76	0.05
336	Carnival Corp	嘉年华公司	CCL UN	纽约证券交易所	美国	1,408	191,575.03	0.05
337	Cooper Cos	库柏股份有限	COO UN	纽约证券交易所	美国	69	191,170.61	0.05

	Inc/The	公司		所				
338	First Solar Inc	福思第一太阳能公司	FSLR UW	纳斯达克证券交易所	美国	139	190,923.77	0.05
339	FleetCor Technologies Inc	FleetCor 技术股份有限公司	FLT UN	纽约证券交易所	美国	104	188,682.40	0.05
340	Expeditors International of Washington Inc	华盛顿康捷国际物流公司	EXPD UW	纳斯达克证券交易所	美国	214	187,305.89	0.05
341	CenterPoint Energy Inc	中点能源	CNP UN	纽约证券交易所	美国	885	186,409.38	0.05
342	Ball Corp	波尔	BALL UN	纽约证券交易所	美国	441	185,490.69	0.05
343	Howmet Aerospace Inc	Howmet 航空航天股份有限公司	HWM UN	纽约证券交易所	美国	516	184,785.09	0.05
344	United Airlines Holdings Inc	美国联合航空控股股份有限公司	UAL UW	纳斯达克证券交易所	美国	460	182,380.64	0.04
345	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	221	181,232.39	0.04
346	Fifth Third Bancorp	五三银行	FITB UW	纳斯达克证券交易所	美国	954	180,676.36	0.04
347	Mid-America Apartment	Mid-America Apartment	MAA UN	纽约证券交易所	美国	164	179,958.84	0.04

	Communities Inc	Communities 股份有限公司						
348	Molina Healthcare Inc	Molina Healthcare 股份有限公司	MOH UN	纽约证券交易所	美国	82	178,489.40	0.04
349	Skyworks Solutions Inc	思佳讯解决方案公司	SWKS UW	纳斯达克证券交易所	美国	223	178,360.71	0.04
350	Tyler Technologies Inc	Tyler 科技公司	TYL UN	纽约证券交易所	美国	59	177,550.41	0.04
351	Steel Dynamics Inc	Steel Dynamics 股份有限公司	STLD UW	纳斯达克证券交易所	美国	225	177,098.94	0.04
352	PulteGroup Inc	Pulte 集团公司	PHM UN	纽约证券交易所	美国	313	175,686.95	0.04
353	Kellogg Co	家乐氏	K UN	纽约证券交易所	美国	360	175,326.81	0.04
354	Teradyne Inc	泰瑞达	TER UW	纳斯达克证券交易所	美国	217	174,565.28	0.04
355	Targa Resources Corp	Targa 资源公司	TRGP UN	纽约证券交易所	美国	317	174,313.03	0.04
356	Principal Financial Group Inc	信安金融	PFG UW	纳斯达克证券交易所	美国	317	173,717.48	0.04
357	CMS Energy Corp	CMS 能源	CMS UN	纽约证券交易所	美国	409	173,626.94	0.04
358	Nasdaq Inc	纳斯达克股份	NDAQ UW	纳斯达克证券	美国	475	171,097.91	0.04

		有限公司		交易所				
359	Atmos Energy Corp	Atmos 能源公司	ATO UN	纽约证券交易所	美国	203	170,651.86	0.04
360	Regions Financial Corp	地区金融公司	RF UN	纽约证券交易所	美国	1,316	169,453.10	0.04
361	Lamb Weston Holdings Inc	蓝威斯顿控股股份有限公司	LW UN	纽约证券交易所	美国	204	169,443.56	0.04
362	Iron Mountain Inc	美国铁山公司	IRM UN	纽约证券交易所	美国	409	167,923.11	0.04
363	NetApp Inc	美国网域存储技术有限公司	NTAP UW	纳斯达克证券交易所	美国	300	165,615.34	0.04
364	IDEX Corp	艺达思集团	IEX UN	纽约证券交易所	美国	106	164,875.13	0.04
365	Brown & Brown Inc	Brown & Brown 股份有限公司	BRO UN	纽约证券交易所	美国	330	164,149.94	0.04
366	Conagra Brands Inc	康尼格拉品牌股份有限公司	CAG UN	纽约证券交易所	美国	669	163,004.51	0.04
367	Garmin Ltd	佳明有限公司	GRMN UN	纽约证券交易所	美国	215	162,019.42	0.04
368	Best Buy Co Inc	百思买	BBY UN	纽约证券交易所	美国	273	161,658.13	0.04
369	JM Smucker Co/The	JM 斯马克公司	SJM UN	纽约证券交易所	美国	150	160,055.08	0.04
370	Waters Corp	沃特世公司	WAT UN	纽约证券交易所	美国	83	159,855.07	0.04

371	Quest Diagnos tics Inc	Quest Diagnos tics 股 份有限 公司	DGX UN	纽约证 券交易 所	美国	157	159,458 .38	0.04
372	Expedia Group Inc	亿客行 集团股 份有限 公司	EXPE UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	200	158,086 .05	0.04
373	Paycom Softwar e Inc	Paycom 软件股 份有限 公司	PAYC UN	纽约证 券交易 所	美国	68	157,842 .69	0.04
374	Hunting ton Bancsha res Inc/OH	俄亥俄 州亨廷 顿银行 控股公 司	HBAN UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,024	157,657 .71	0.04
375	Norther n Trust Corp	北美信 托	NTRS UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	292	156,430 .48	0.04
376	FactSet Researc h Systems Inc	FactSet 研究系 统股份 有限公 司	FDS UN	纽约证 券交易 所	美国	54	156,330 .91	0.04
377	Cincinnati Financia l Corp	辛辛那 提金融	CINF UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	220	154,707 .27	0.04
378	Snap-on Inc	实耐宝	SNA UN	纽约证 券交易 所	美国	74	154,097 .84	0.04
379	Zebra Technol ogies Corp	斑马技 术公司	ZBRA UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	72	153,907 .81	0.04
380	SolarEd ge Technol ogies Inc	SolarEd ge 科技 股份有 限公司	SEDG UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	79	153,584 .02	0.04
381	PTC Inc	PTC 公 司	PTC UW	纳斯达 克证券	美国	149	153,206 .47	0.04



				交易所				
382	Jacobs Solution s Inc	Jacobs Solution s Inc	J UN	纽约证 券交易 所	美国	178	152,915 .41	0.04
383	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	90	152,370 .44	0.04
384	JB Hunt Transpo rt Services Inc	JB Hunt 运输服 务股份 有限公 司	JBHT UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	116	151,738 .04	0.04
385	Revvity Inc	Revvity 股份有 限公司	RVTY UN	纽约证 券交易 所	美国	176	151,070 .09	0.04
386	Interpub lic Group of Cos Inc/The	Interpub lic 集 团	IPG UN	纽约证 券交易 所	美国	541	150,815 .31	0.04
387	EQT Corp	EQT 公 司	EQT UN	纽约证 券交易 所	美国	507	150,678 .96	0.04
388	LKQ Corp	LKQ 公 司	LKQ UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	356	149,892 .86	0.04
389	Pool Corp	Pool 公 司	POOL UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	55	148,889 .05	0.04
390	Amcor PLC	安姆科 公司	AMCR UN	纽约证 券交易 所	美国	2,063	148,770 .12	0.04
391	Everest Re Group Ltd	安富来 集团有 限公司	RE UN	纽约证 券交易 所	美国	60	148,212 .72	0.04
392	Cboe Global Markets Inc	Cboe 环 球市场 公司	CBOE UF	Cboe BZX 交 易所	美国	148	147,590 .43	0.04
393	Tyson Foods Inc	泰森食 品公司	TSN UN	纽约证 券交易 所	美国	400	147,521 .93	0.04

394	Synchro ny Financia l	同步金 融公司	SYF UN	纽约证 券交易 所	美国	601	147,304 .58	0.04
395	Stanley Black & Decker Inc	史丹利 百得公 司	SWK UN	纽约证 券交易 所	美国	215	145,582 .89	0.04
396	Maratho n Oil Corp	Maratho n 石油 公司	MRO UN	纽约证 券交易 所	美国	866	144,048 .64	0.04
397	Bunge Ltd	邦吉有 限公司	BG UN	纽约证 券交易 所	美国	211	143,850 .14	0.04
398	AES Corp/The	爱伊斯 公司	AES UN	纽约证 券交易 所	美国	938	140,503 .80	0.03
399	Avery Denniso n Corp	艾利丹 尼森	AVY UN	纽约证 券交易 所	美国	113	140,277 .35	0.03
400	Akamai Technol ogies Inc	阿卡迈 技术公 司	AKAM UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	213	138,318 .50	0.03
401	Textron Inc	德事隆	TXT UN	纽约证 券交易 所	美国	283	138,296 .68	0.03
402	Axon Enterpri se Inc	Axon Enterpri se 股份 有限公司	AXON UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	98	138,170 .01	0.03
403	CF Industri es Holdings Inc	CF 工业 控股股 份有限 公司	CF UN	纽约证 券交易 所	美国	273	136,940 .90	0.03
404	Fox Corp	福克斯 公司	FOX UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	192	44,242. 71	0.01
			FOXA UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	377	92,620. 30	0.02
405	Evergy	Evergy	EVRG	纳斯达	美国	322	135,926	0.03

	Inc	股份有 限公司	UW	克证 券交 易所			.26	
406	UDR Inc	UDR 公司	UDR UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	434	134,722 .44	0.03
407	Nordson Corp	诺 信 公 司	NDSN UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	75	134,497 .43	0.03
408	CarMax Inc	CarMax 股 份 有 限 公 司	KMX UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	222	134,265 .48	0.03
409	MGM Resorts Internati onal	美 高 梅 国 际 酒 店 集 团	MGM UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	423	134,242 .07	0.03
410	Alliant Energy Corp	Alliant 能 源 公 司	LNT UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	352	133,481 .91	0.03
411	Live Nation Entertai nment Inc	Live Nation 娱 乐 公 司	LYV UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	202	132,985 .21	0.03
412	Trimble Inc	天 宝 股 份 有 限 公 司	TRMB UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	347	132,739 .25	0.03
413	FMC Corp	FMC 公 司	FMC UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	175	131,939 .50	0.03
414	EPAM Systems Inc	EPAM 系 统 公 司	EPAM UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	81	131,543 .88	0.03
415	Masco Corp	马 斯 可	MAS UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	316	131,018 .78	0.03
416	Bio-Tec hne Corp	Bio-tech ne 公 司	TECH UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	221	130,355 .09	0.03
417	Citizens Financia l Group Inc	公 民 金 融 集 团 股 份 有 限 公 司	CFG UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	679	127,956 .78	0.03
418	Molson Coors	莫 尔 森 库 尔 斯	TAP UN	纽 约 证 券 交 易	美 国	263	125,121 .37	0.03

	Beverage Co	饮料公司		所				
419	Kimco Realty Corp	Kimco Realty Corp	KIM UN	纽约证券交易所	美国	869	123,826.22	0.03
420	Brown-Forman Corp	百富门公司	BF/B UN	纽约证券交易所	美国	256	123,529.96	0.03
421	Jack Henry & Associates Inc	Jack Henry & Associates 公司	JKHY UW	纳斯达克证券交易所	美国	102	123,327.50	0.03
422	Western Digital Corp	西部数据公司	WDC UW	纳斯达克证券交易所	美国	449	123,059.49	0.03
423	Leidos Holdings Inc	Leidos 控股公司	LDOS UN	纽约证券交易所	美国	192	122,753.05	0.03
424	Domino's Pizza Inc	达美乐披萨公司	DPZ UN	纽约证券交易所	美国	50	121,751.12	0.03
425	WR Berkley Corp	WR Berkley 公司	WRB UN	纽约证券交易所	美国	282	121,363.96	0.03
426	Host Hotels & Resorts Inc	Host 酒店及度假股份有限公司	HST UW	纳斯达克证券交易所	美国	997	121,245.38	0.03
427	Viatis Inc	晖致	VTRS UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,681	121,222.77	0.03
428	Seagate Technology Holdings PLC	Seagate Technology 控股公共有限公司	STX UW	纳斯达克证券交易所	美国	270	120,706.27	0.03
429	Packaging Corp of America	美国包装公司	PKG UN	纽约证券交易所	美国	126	120,325.18	0.03
430	America	美国航	AAL	纳斯达	美国	915	118,612	0.03

	n Airlines Group Inc	空集团 公司	UW	克证券 交易所			.23	
431	Camden Property Trust	Camden 房地产 信托公 司	CPT UN	纽约证 券交易 所	美国	150	118,000 .93	0.03
432	Hormel Foods Corp	荷美尔 食品有 限公司	HRL UN	纽约证 券交易 所	美国	406	117,992 .40	0.03
433	Match Group Inc	Match 集团股 份有限 公司	MTCH UN	纳斯达 克证券 交易所	美国	390	117,935 .89	0.03
434	Mosaic Co/The	Mosaic 公司	MOS UN	纽约证 券交易 所	美国	466	117,852 .80	0.03
435	Celanes e Corp	塞拉尼 斯公司	CE UN	纽约证 券交易 所	美国	140	117,144 .67	0.03
436	Incyte Corp	因赛特 公司	INCY UN	纳斯达 克证券 交易所	美国	260	116,949 .57	0.03
437	BorgWa rner Inc	博格华 纳股份 有限公 司	BWA UN	纽约证 券交易 所	美国	329	116,273 .17	0.03
438	Teleflex Inc	泰利福 公司	TFX UN	纽约证 券交易 所	美国	66	115,424 .78	0.03
439	NiSourc e Inc	NiSourc e 公司	NI UN	纽约证 券交易 所	美国	579	114,425 .24	0.03
440	Loews Corp	罗斯公 司	L UN	纽约证 券交易 所	美国	265	113,703 .02	0.03
441	Internati onal Paper Co	国际纸 业	IP UN	纽约证 券交易 所	美国	487	111,938 .26	0.03
442	Healthp eak Properti	Healthp eak Properti	PEAK UN	纽约证 券交易 所	美国	767	111,397 .99	0.03

	es Inc	es Inc						
443	Caesars Entertainment Inc	凯撒娱乐集团	CZR UW	纳斯达克证券交易所	美国	302	111,226 .31	0.03
444	CH Robinson Worldwide Inc	罗宾逊全球物流有限公司	CHRW UW	纳斯达克证券交易所	美国	163	111,125 .94	0.03
445	Wynn Resorts Ltd	永利渡假村有限公司	WYNN UW	纳斯达克证券交易所	美国	145	110,651 .93	0.03
446	Charles River Laboratories International Inc	查理斯河实验室国际有限公司	CRL UN	纽约证券交易所	美国	72	109,384 .16	0.03
447	Pentair PLC	Pentair 公共有限公司	PNR UN	纽约证券交易所	美国	231	107,827 .72	0.03
448	Henry Schein Inc	亨利香恩公司	HSIC UW	纳斯达克证券交易所	美国	184	107,826 .28	0.03
449	Gen Digital Inc	Gen Digital 股份有限公司	GEN UW	纳斯达克证券交易所	美国	798	106,962 .79	0.03
450	APA Corp	APA	APA UW	纳斯达克证券交易所	美国	433	106,910 .12	0.03
451	Allegion plc	安朗杰公共有限公司	ALLE UN	纽约证券交易所	美国	123	106,670 .58	0.03
452	Etsy Inc	Etsy 股份有限公司	ETSY UW	纳斯达克证券交易所	美国	173	105,767 .86	0.03
453	Ceridian HCM Holding Inc	Ceridian 人力资本管理控股股份有限公司	CDAY UN	纽约证券交易所	美国	217	105,008 .87	0.03

454	Qorvo Inc	Qorvo 股份有限公司	QRVO UW	纳斯达克 证券交易 所	美国	140	103,214 .77	0.03
455	Juniper Networks Inc	瞻博网络股份有限公司	JNPR UN	纽约证 券交易 所	美国	451	102,099 .33	0.03
456	Eastman Chemical Co	伊士曼化工	EMN UN	纽约证 券交易 所	美国	167	101,025 .64	0.02
457	Rollins Inc	Rollins 公司	ROL UN	纽约证 券交易 所	美国	325	100,581 .33	0.02
458	Tapestry Inc	TPR-D RS-RS	TPR UN	纽约证 券交易 所	美国	325	100,510 .88	0.02
459	Universal Health Services Inc	Univers al 保健 服务股 份有限 公司	UHS UN	纽约证 券交易 所	美国	88	100,321 .27	0.02
460	Market Axess Holdings Inc	Market Axess 控股公 司	MKTX UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	53	100,115 .34	0.02
461	Globe Life Inc	Globe Life 股 份有限 公司	GL UN	纽约证 券交易 所	美国	125	99,011. 52	0.02
462	News Corp	新闻集 团	NWS UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	165	23,511. 31	0.01
			NWSA UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	534	75,242. 26	0.02
463	Regency Centers Corp	Regenc y Centers 公司	REG UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	216	96,408. 94	0.02
464	Generac Holdings Inc	Generac 控股公 司	GNRC UN	纽约证 券交易 所	美国	87	93,749. 77	0.02
465	Norwegian	挪威邮 轮控股	NCLH UN	纽约证 券交易	美国	595	93,596. 87	0.02

	Cruise Line Holdings Ltd	有限公司		所				
466	Pinnacle West Capital Corp	Pinnacle 西部资本	PNW UN	纽约证券交易所	美国	159	93,589.57	0.02
467	Campbell Soup Co	金宝汤	CPB UN	纽约证券交易所	美国	281	92,811.86	0.02
468	Huntington Ingalls Industries Inc	Huntington Ingalls 工业公司	HII UN	纽约证券交易所	美国	56	92,097.16	0.02
469	A O Smith Corp	AO 史密斯公司	AOS UN	纽约证券交易所	美国	175	92,031.40	0.02
470	F5 Inc	F5 股份有限公司	FFIV UW	纳斯达克证券交易所	美国	85	89,831.87	0.02
471	KeyCorp	KeyCorp 公司	KEY UN	纽约证券交易所	美国	1,311	87,530.74	0.02
472	NRG Energy Inc	NRG 能源股份有限公司	NRG UN	纽约证券交易所	美国	323	87,265.77	0.02
473	Bath & Body Works Inc	Bath & Body Works 股份有限公司	BBWI UN	纽约证券交易所	美国	321	86,980.57	0.02
474	DENTSPLY SIRONA Inc	登士柏西诺德公司	XRAY UW	纳斯达克证券交易所	美国	298	86,174.60	0.02
475	Hasbro Inc	孩之宝	HAS UW	纳斯达克证券交易所	美国	183	85,646.76	0.02
476	Boston Properties Inc	波士顿地产公司	BXP UN	纽约证券交易所	美国	200	83,226.76	0.02



477	Whirlpool Corp	惠而浦	WHR UN	纽约证券交易所	美国	77	82,784.76	0.02
478	Bio-Rad Laboratories Inc	伯乐生命医学产品有限公司	BIO UN	纽约证券交易所	美国	30	82,183.36	0.02
479	Robert Half International Inc	罗致恒富国际公司	RHI UN	纽约证券交易所	美国	151	82,072.23	0.02
480	Paramount Global	派拉蒙全球	PARA UW	纳斯达克证券交易所	美国	711	81,738.32	0.02
481	Catalent Inc	康泰伦特股份有限公司	CTLT UN	纽约证券交易所	美国	253	79,267.60	0.02
482	Invesco Ltd	景顺有限公司	IVZ UN	纽约证券交易所	美国	642	77,980.98	0.02
483	Franklin Resources Inc	富兰克林资源	BEN UN	纽约证券交易所	美国	400	77,200.45	0.02
484	Westrock Co	WestRock 公司	WRK UN	纽约证券交易所	美国	359	75,409.39	0.02
485	Federal Realty Investment Trust	联邦房地产投资信托公司	FRT UN	纽约证券交易所	美国	103	72,021.79	0.02
486	Alaska Air Group Inc	阿拉斯加航空集团股份有限公司	ALK UN	纽约证券交易所	美国	179	68,783.98	0.02
487	Assurant Inc	安信龙集团	AIZ UN	纽约证券交易所	美国	75	68,132.07	0.02
488	VF Corp	VF 公司	VFC UN	纽约证券交易所	美国	463	63,866.46	0.02
489	DXC	DXC 技	DXC	纽约证	美国	319	61,590.	0.02

	Technology Co	术公司	UN	券交易所			41	
490	Sealed Air Corp	希悦尔公司	SEE UN	纽约证券交易所	美国	202	58,384.46	0.01
491	DaVita Inc	DaVita 股份有限公司	DVA UN	纽约证券交易所	美国	78	56,626.14	0.01
492	Comerica Inc	Comerica 公司	CMA UN	纽约证券交易所	美国	185	56,625.70	0.01
493	Mohawk Industries Inc	Mohawk 工业股份有限公司	MHK UN	纽约证券交易所	美国	74	55,160.60	0.01
494	Organon & Co	Organon & Co	OGN UN	纽约证券交易所	美国	358	53,832.07	0.01
495	Ralph Lauren Corp	拉夫劳伦	RL UN	纽约证券交易所	美国	58	51,674.59	0.01
496	Advance Auto Parts Inc	领先汽车配件股份有限公司	AAP UN	纽约证券交易所	美国	83	42,161.82	0.01
497	Zions Bancorp NA	锡安银行	ZION UW	纳斯达克证券交易所	美国	208	40,369.68	0.01
498	Lincoln National Corp	林肯国民	LNC UN	纽约证券交易所	美国	216	40,205.51	0.01
499	Newell Brands Inc	纽威尔品牌公司	NWL UW	纳斯达克证券交易所	美国	528	33,192.43	0.01

#### 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	占期末基金资产
----	----------	------	---------	---------

			额	净值比例 (%)
1	APPLE INC	AAPL UW	33,521,872.04	8.22
2	MICROSOFT CORP	MSFT UW	29,176,878.70	7.15
3	AMAZON.COM INC	AMZN UW	12,623,796.03	3.09
4	NVIDIA CORP	NVDA UW	9,720,620.91	2.38
5	ALPHABET INC-CL A	GOOGL UW	8,454,547.82	2.07
6	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	BRK/B UN	7,618,811.92	1.87
7	ALPHABET INC-CL C	GOOG UW	7,377,923.68	1.81
8	TESLA INC	TSLA UW	7,366,971.78	1.81
9	META PLATFORMS INC-CLASS A	META UW	6,555,635.30	1.61
10	EXXON MOBIL CORP	XOM UN	6,081,461.37	1.49
11	UNITEDHEALTH GROUP INC	UNH UN	5,991,974.96	1.47
12	JOHNSON & JOHNSON	JNJ UN	5,525,890.60	1.35
13	JPMORGAN CHASE & CO	JPM UN	5,244,103.98	1.29
14	VISA INC-CLASS A SHARES	V UN	4,980,225.72	1.22
15	PROCTER & GAMBLE CO/THE	PG UN	4,731,453.25	1.16
16	MASTERCARD INC - A	MA UN	4,232,602.44	1.04
17	HOME DEPOT INC	HD UN	3,971,756.82	0.97
18	CHEVRON CORP	CVX UN	3,896,194.51	0.96
19	BROADCOM INC	AVGO UW	3,788,251.05	0.93
20	ELI LILLY & CO	LLY UN	3,776,265.89	0.93

注: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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	APPLE INC	AAPL UW	10,043,620.13	2.46
2	MICROSOFT CORP	MSFT UW	8,777,455.50	2.15
3	AMAZON.COM INC	AMZN UW	3,737,470.25	0.92
4	NVIDIA CORP	NVDA UW	2,857,314.28	0.70
5	ALPHABET INC-CL A	GOOGL UW	2,599,297.34	0.64
6	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	BRK/B UN	2,337,465.28	0.57
7	ALPHABET INC-CL C	GOOG UW	2,329,529.36	0.57
8	META PLATFORMS INC-CLASS A	META UW	2,055,630.69	0.50
9	TESLA INC	TSLA UW	1,960,686.06	0.48
10	EXXON MOBIL CORP	XOM UN	1,912,262.60	0.47
11	UNITEDHEALTH GROUP INC	UNH UN	1,884,478.72	0.46
12	JOHNSON & JOHNSON	JNJ UN	1,708,239.03	0.42
13	JPMORGAN CHASE & CO	JPM UN	1,554,810.32	0.38
14	VISA INC-CLASS A SHARES	V UN	1,477,249.77	0.36
15	PROCTER & GAMBLE CO/THE	PG UN	1,392,110.42	0.34
16	MASTERCARD INC - A	MA UN	1,303,785.70	0.32
17	CHEVRON CORP	CVX UN	1,234,310.47	0.30
18	HOME DEPOT INC	HD UN	1,180,392.17	0.29

19	ELI LILLY & CO	LLY UN	1,179,932.68	0.29
20	BROADCOM INC	AVGO UW	1,135,675.52	0.28

注: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	467,007,614.03
卖出收入(成交)总额	139,855,758.40

注: 买入股票成本、卖出股票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

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	期货	ES2309 FDER	266,090.09	0.07

### 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 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	2,225,546.40
2	应收清算款	-
3	应收股利	186,849.01
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	46,461,894.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	48,874,289.41

**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

持有人户	户均持有的基金份额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

数 (户)		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
821	427,203.41	333,425,000.00	95.06 %	17,309,000.00	4.94%

## 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	法国兴业银行	200,000,000.00	57.02%
2	BARCLAYS BANK PLC	55,648,300.00	15.87%
3	国泰君安证券股份有限公司	42,275,800.00	12.05%
4	上海迎水投资管理有限公司-迎水长丰 11 号私募证券投资基金	20,000,000.00	5.70%
5	MORGAN STANLEY & CO. INTERNATIONAL PLC.	9,992,900.00	2.85%
6	郑灿标	2,778,000.00	0.79%
7	中信建投证券股份有限公司	2,051,600.00	0.58%
8	广发证券股份有限公司	1,043,100.00	0.30%
9	上海橡杉资产管理有限公司	979,200.00	0.28%
10	中信证券股份有限公司	957,000.00	0.27%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本公司的所有从业人员(包含高级管理人员、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。

## 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

基金合同生效日(2023 年 3 月 23 日)基金份额总额	420,734,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	80,000,000.00
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	150,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-

本报告期末基金份额总额	350,734,000.00
-------------	----------------

## § 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

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

### 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	
China Internation	-	423,699,940.50	69.82%	82,954.33	58.61%	-



al Capital Corporation Hong Kong Securities Limited						
CITI Group Global Markets Asia Limited	-	118,364,369.57	19.50%	26,181.44	18.50%	-
GuangFa Securities (Hong Kong)Business Limited	-	64,799,062.36	10.68%	32,401.03	22.89%	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-

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：

华泰证券

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	
	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
China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	-	-	-	-	-	-
CITI Group Global Markets Asia Limited	-	-	-	-	-	-
GuangFa Securities (Hong Kong) Business Limited	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

### 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	南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 基金合同及招募说明书提示性公告	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	2023-01-18
2	关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 调整募集期限的公告	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	2023-03-06

3	南方基金关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 增加部分券商为网下发售代理机构的公告	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	2023-03-11
4	南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 上网发售提示性公告	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	2023-03-16
5	南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 开放日常申购与赎回业务的公告	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	2023-03-30
6	关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 2023 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	2023-03-30
7	南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 上市交易公告书提示性公告	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	2023-03-30
8	南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 上市交易公告书	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	2023-03-30
9	南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 上市交易提示性公告	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	2023-04-04
10	南方基金关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 增加部分券商为申购赎回代理券商的公告	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	2023-04-18
11	南方基金关于旗下部分基金增加华福证券为申购赎回代理券商的公告	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	2023-05-30

## § 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	1	20230323-20230630	-	200,000,000.00	-	200,000,000.00	57.02%
机构	2	20230404-20230409	-	347,093,000.00	291,444,700.00	55,648,300.00	15.87%

**产品特有风险**

本基金存在持有基金份额超过 20% 的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。

注：申购份额包含红利再投资和份额折算。

**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标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的文件；
- 2、《南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 基金合同》；
- 3、《南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 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、《南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 2023 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>