

南方标普 500 交易型开放式指数证券 投资基金（QDII）2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 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：2025 年 3 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的法律责任。

本年度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 2025 年 3 月 27 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。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	11
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.10 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	23
§8 投资组合报告	50
8.1 期末基金资产组合情况	50
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	51

8.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合.....	51
8.4 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.....	51
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	93
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	99
8.7 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.....	100
8.8 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.....	100
8.9 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.....	100
8.10 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.....	100
8.11 投资组合报告附注.....	100
§9 基金份额持有人信息.....	101
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	101
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	101
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	102
9.4 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.....	102
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况.....	102
§10 开放式基金份额变动.....	102
§11 重大事件揭示.....	102
11.1 基金份额持有人大会决议.....	103
11.2 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.....	103
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	103
11.4 基金投资策略的改变.....	103
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	103
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	103
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	104
11.8 其他重大事件.....	105
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	108
12.1 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.....	108
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	108
§13 备查文件目录.....	108
13.1 备查文件目录.....	108
13.2 存放地点.....	108
13.3 查阅方式.....	109

§ 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 南方
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	2,551,734,000.00 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	鲍文革	张姗
	联系电话	0755-82763888	400-61-95555
	电子邮箱	manager@southernfund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话	400-889-8899	400-61-95555	
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	境外投资顾问	境外资产托管人
名称	中文	- 美国花旗银行有限公司
	英文	- Citibank N.A.
注册地址		- 701 East 60th Street North, Sioux Falls, SD57104, USA
办公地址		- 50/F Champion Tower, Three Garden Road Central, HK
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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	容诚会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公	北京市西城区太平桥大街 17 号

	司	
--	---	--

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年	2023 年 3 月 23 日-2023 年 12 月 31 日
本期已实现收益	50,232,174.69	43,642,497.84
本期利润	217,384,119.21	70,942,402.40
加权平均基金份额本期利润	0.2171	0.1947
本期加权平均净值利润率	15.01%	17.35%
本期基金份额净值增长率	24.26%	22.49%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末	2023 年末
期末可供分配利润	470,219,981.03	27,127,635.90
期末可供分配基金份额利润	0.1842	0.1305
期末基金资产净值	3,884,098,679.22	254,459,925.02
期末基金份额净值	1.5221	1.2249
3.1.3 累计期末指标	2024 年末	2023 年末
基金份额累计净值增长率	52.21%	22.49%

注：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；

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；

对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

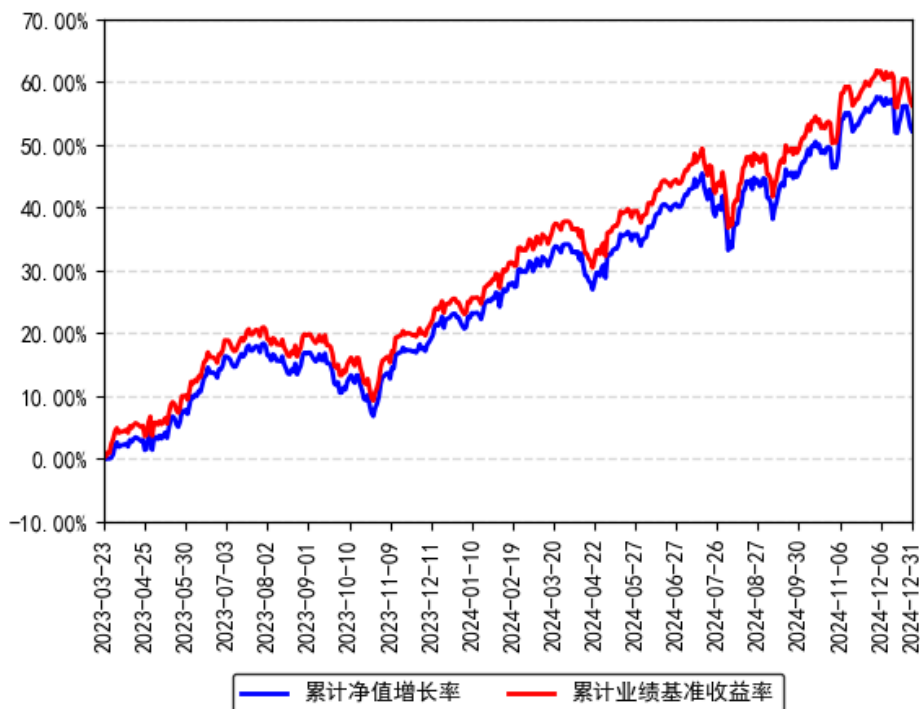
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	4.64%	0.80%	4.70%	0.81%	-0.06%	-0.01%
过去六个月	8.64%	0.92%	8.64%	0.92%	0.00%	0.00%
过去一年	24.26%	0.81%	25.15%	0.81%	-0.89%	0.00%
自基金合同生效起	52.21%	0.78%	56.28%	0.79%	-4.07%	-0.01%

至今						
----	--	--	--	--	--	--

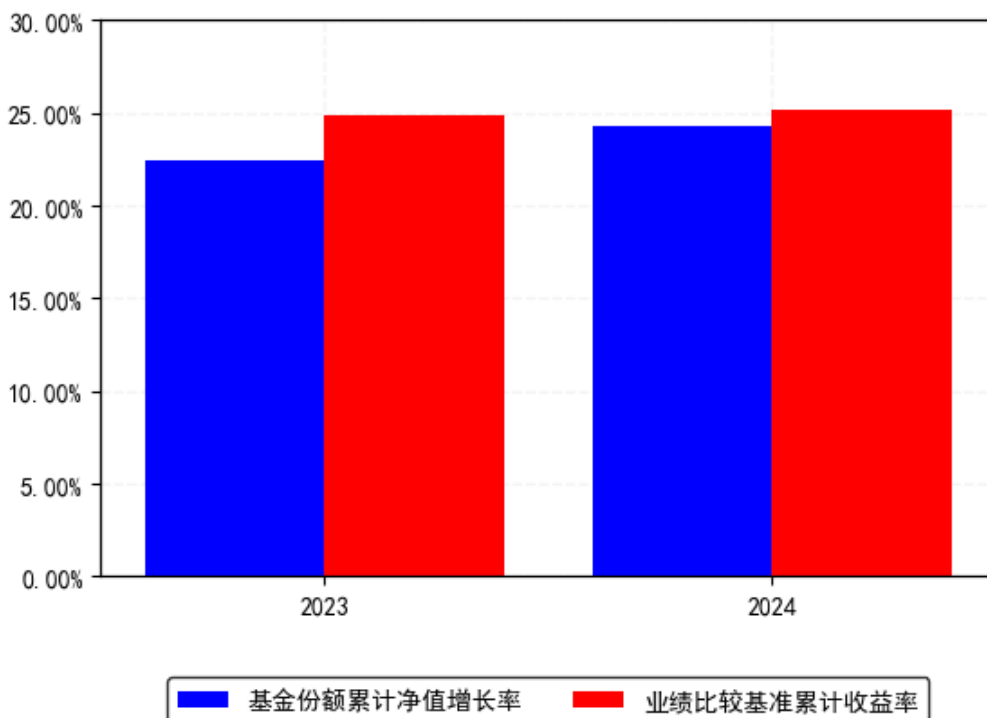
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方标普500ETF（QDII）每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于 2023 年 3 月 23 日成立，自基金合同生效日以来未进行利润分配。

§ 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。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	-	12 年	中国国籍，美国南加州大学金融工程硕士，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 2024 年 5 月 31 日，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；2023 年 7 月 28 日至今，任南方中证通信服务 ETF 基金经理；2023 年 9 月 7 日至今，任南方中证 2000ETF 基金经理；2023 年 12 月 5 日至今，任南方中证电池主题指数发起基金经理；2024 年 2 月 28 日至今，任南方中证国新央企科技引领 ETF 联接基金经理；2024 年 3 月 19 日至今，任南方中证光伏产业指数发起

					基金经理: 2024 年 3 月 29 日至今, 任南方中证半导体产业指数发起基金经理; 2024 年 4 月 15 日至今, 任南方上证科创板芯片 ETF 基金经理; 2024 年 5 月 14 日至今, 任南方中证通信服务 ETF 发起联接基金经理; 2024 年 5 月 21 日至今, 任南方富时亚太低碳精选 ETF 发起联接 (QDII) 基金经理; 2024 年 7 月 8 日至今, 任南方上证科创板芯片 ETF 发起联接基金经理。
杜冠豪	本基金基金经理助理	2023 年 10 月 23 日	-	5 年	中国国籍, 北京大学金融学专业硕士, 具有基金从业资格。2019 年 7 月加入南方基金, 任指数投资部研究员; 2023 年 10 月 23 日至今, 任南方恒生指数 ETF、南方标普 500ETF、南方中证创新药产业 ETF 基金经理助理。

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	18	9,521,292,277.79	2016 年 08 月 05 日
	私募资产管理计划	1	4,891,442.64	2024 年 06 月 28 日
	其他组合	-	-	-
	合计	19	9,526,183,720.43	-

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理兼任私募资产管理计划投资经理, 基金经理薪酬激励与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现不直接挂钩。基金经理薪酬激励遵守最新政策导向、监管要求及公司相关制度规定。

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遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.4.2 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，两两组合同单日、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。

4.4.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金管理人依据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》的要求，建立和完善了兼任相关的制度及流程，确保兼任基金经理公平对待其管理的所有投资组合。通过对基金经理的投资交易行为进行监控和分析，本报告期内，两两组合同各项操作、流程及事后分析均正常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.4.3 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129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

本产品跟踪标普 500 指数，标普 500 指数以 500 家美股龙头企业为样本，编制方式融入了主动选股的理念，覆盖美股市值的约 70%，是美股最受欢迎的指数之一。2024 年，标普 500 指数涨跌幅为 23.31%。

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 1.5221 元，报告期内，份额净值增长率为 24.26%，同期业绩基准增长率为 25.15%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年，美股市场表现优异。美股的持续上涨得益于投资者的看涨情绪高涨、企业盈利韧性强劲，以及市场对美联储年内开始降息的预期。美联储于 2024 年三季度启动降息，但四季度在美国宏观及就业数据保持强劲、特朗普交易等驱动下，美债收益率及美元指数大幅反弹，市场对未来降息的预期有所降低。展望 2025 年，美联储降息节奏仍具有较大不确定性，强美元与高美债利率的海外宏观环境或有所延续。美股维持上涨的趋势，虽然对美股估值过高的担忧屡次出现，多数企业却能通过高盈利增速打消担忧。我们继续维持对美股市场谨慎偏乐观的看法。

4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、监管要求、自律规则和业务发展情况，严格遵守包括《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》在内的公募基金行业各项法律法规及其他规范要求，有效落实了 2024 年度发布的《关于加强证券公司和公募基金监管加快推进

建设一流投资银行和投资机构的意见（试行）》《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》和《证券市场程序化交易管理规定（试行）》等公募基金相关新法律法规。

本基金管理人坚持从保护基金份额持有人利益出发，树立并坚守“全员合规、合规从高层做起、合规创造价值、合规是公司生存基础、合规为先、行稳致远”的合规理念。严守合规底线，持续优化内控和合规管理机制，将合规管理全面深度嵌入各项流程与业务，强化业务风险的防范与管控，努力做到风险“早识别、早预警、早处置”，确保各项法规和管理制度的落实，有效保障了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期内，本基金管理人结合新法规、新的监管要求和公司业务发展实际情况，积极推动监管新规落实，持续完善内部控制体系制度及业务流程，制订和修订了包括公司《合规手册》《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》《程序化交易管理规定》《投资管理制度》《投资者适当性管理制度》等一系列与监察稽核和合规内控相关的公司管理制度。

在进一步优化制度体系的基础上，本基金管理人贯彻“合规为先，行稳致远”的合规理念，推进落实全面风险管理与全员合规管理要求，持续优化合规及内控管理机制，全面排查风险并针对性完善优化，在投资、销售、运营、合规风控等领域加强管控，大力推进公司廉洁从业文化建设，着力创新丰富文化宣传方式，强化廉洁从业及人员管理，优化员工行为管理机制，加强规范检查力度并严格问责；紧跟监管形势，对投研交易、市场销售、后台运营及人员管理等业务和相关部门严细深实开展各类稽核检查，通过专项稽核和合规检查识别问题、防范风险；根据监管和市场形势并结合业务发展实际情况、各类组合或业务特点，持续完善投资合规风控管理机制，提升系统化监控效能，落实事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，为投资业务平稳合规发展提供保障，全面履行新产品、新业务合规评估程序，保障各类新产品、新业务合规开展，积极响应监管政策要求，不断强化销售合规风险管控，督促完善投资者适当性管理等各项制度机制；加强信息披露专项管理，保障所披露信息的真实性、准确性和完整性；落实提升投资者获得感，持续加强投资者教育及保护力度，开展各类监管组织的投教活动，监督和落实客户投诉处理，重视媒体监督和投资者关系管理。

本基金管理人高度重视反洗钱相关工作，贯彻风险为本，自评估驱动，持续落实反洗钱风险管控。从制度建设、系统功能建设、业务流程规范、宣传培训、监督检查等方面入手，推动反洗钱内控管理依据新《反洗钱法》完善，将反洗钱工作贯穿于公司各项业务流程，有效提升了公司反洗钱工作的合规水平。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全各项管理制度，不断提高监察稽核及合规管理工作的科学性和有效性，坚持“看不清管不住则不展业”，落实全面风险管理与全员合规管理要求，持续推进合规数智化在更广更深的范围应用及融合，努力防范和管理各类风险，覆盖各类业务、场景及人员，切实维护基金资产的安全与利益。

4.8 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,组成人员包括财务负责人、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。

4.9 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。

4.10 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。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	容诚审字[2025]200Z0433 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)（以下简称“南方标普 500ETF 基金”）财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“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，公允反映了南方标普 500ETF 基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于南方标普 500ETF 基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>南方标普 500ETF 基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司 (以下简称“基金管理人”) 管理层对其他信息负责。其他信息包括南方标普 500ETF 基金 2024 年年度报告中涵盖的信息, 但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息, 我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计, 我们的责任是阅读其他信息, 在此过程中, 考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作, 如果我们确定其他信息存在重大错报, 我们应当报告该事实。在这方面, 我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表, 使其实现公允反映, 并设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时, 基金管理人管理层负责评估南方标普 500ETF 基金的持续经营能力, 披露与持续经营相关的事项 (如适用), 并运用持续经营假设, 除非基金管理人管理层计划清算南方标普 500ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督南方标普 500ETF 基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证, 并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证, 但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致, 如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策, 则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中, 我们运用职业判断, 并保持职业怀疑。同时, 我们也执行以下工作:</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险, 设计和实施审计程序以应对这些风险, 并获取充分、适当的审计证据, 作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上, 未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制, 以设计恰当的审计程序, 但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p>

	<p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时, 根据获取的审计证据, 就可能对南方标普 500ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性, 审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露; 如果披露不充分, 我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而, 未来的事项或情况可能导致南方标普 500ETF 基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容, 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	容诚会计师事务所 (特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	张振波	成磊
会计师事务所的地址	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26	
审计报告日期	2025 年 3 月 27 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 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: 2024 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产:			
货币资金	7.4.7.1	206,095,477.98	14,535,105.96
结算备付金		171,327,035.45	8,073,541.40
存出保证金		28,445,821.47	1,493,918.50
交易性金融资产	7.4.7.2	3,507,448,592.76	232,147,790.38
其中: 股票投资		3,507,448,592.76	232,147,790.38
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		60,844.15	17,943,020.23
应收股利		1,754,233.12	241,512.11
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		3,915,132,004.93	274,434,888.58
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		15,200,716.23	8,668.51
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,794,013.04	155,347.76
应付托管费		448,503.27	38,836.93
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		397,952.65	49,519.93
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	13,192,140.52	19,722,590.43
负债合计		31,033,325.71	19,974,963.56
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	2,551,734,000.00	207,734,000.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	1,332,364,679.22	46,725,925.02
净资产合计		3,884,098,679.22	254,459,925.02
负债和净资产总计		3,915,132,004.93	274,434,888.58

注：1. 报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.5221 元，基金份额总额 2,551,734,000.00 份。

2. 基金合同生效日为 2023 年 03 月 23 日，2023 年度实际报告期间为 2023 年 03 月 23 日至 2023 年 12 月 31 日。

7.2 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 3 月 23 日 (基金合同 生效日) 至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		228,376,870.63	73,392,762.64
1.利息收入		435,102.76	155,017.10
其中：存款利息收入	7.4.7.9	435,102.76	155,017.10
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益 (损失以“-” 填列)		59,000,206.78	45,367,948.36
其中：股票投资收益	7.4.7.10	19,967,183.52	38,245,336.48
基金投资收益	7.4.7.11	-	-
债券投资收益	7.4.7.12	-	-
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	22,904,314.21	2,833,989.09
股利收益	7.4.7.15	16,128,709.05	4,288,622.79
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)	7.4.7.16	167,151,944.52	27,299,904.56
4.汇兑收益 (损失以“-” 号填列)		-26,281,768.70	441,668.09
5.其他收入 (损失以“-” 号填列)	7.4.7.17	28,071,385.27	128,224.53
减：二、营业总支出		10,992,751.42	2,450,360.24
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	8,574,138.01	1,904,133.27
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	7.4.10.2.2	2,143,534.61	476,033.26
3.销售服务费	7.4.10.2.3	-	-

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		-	-
7.税金及附加		82,527.40	10,228.14
8.其他费用	7.4.7.18	192,551.40	59,965.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		217,384,119.21	70,942,402.40
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		217,384,119.21	70,942,402.40
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		217,384,119.21	70,942,402.40

7.3 净资产变动表

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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	207,734,000.00	-	46,725,925.02	254,459,925.02
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	207,734,000.00	-	46,725,925.02	254,459,925.02
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,344,000,000.00	-	1,285,638,754.20	3,629,638,754.20
（一）、综合收益总额	-	-	217,384,119.21	217,384,119.21
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	2,344,000,000.00	-	1,068,254,634.99	3,412,254,634.99
其中：1.基金申购	2,626,000,000.00	-	1,156,999,543.35	3,782,999,543.35

款				
2.基金赎回款	-282,000,000.00	-	-88,744,908.36	-370,744,908.36
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	2,551,734,000.00	-	1,332,364,679.22	3,884,098,679.22
项目	上年度可比期间 2023 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 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	-	-	-	-
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	420,734,000.00	-	-	420,734,000.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-213,000,000.00	-	46,725,925.02	-166,274,074.98
(一)、综合收益总额	-	-	70,942,402.40	70,942,402.40
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-213,000,000.00	-	-24,216,477.38	-237,216,477.38
其中: 1.基金申购款	349,000,000.00	-	52,598,790.92	401,598,790.92
2.基金赎回款	-562,000,000.00	-	-76,815,268.30	-638,815,268.30
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号	-	-	-	-

填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	207,734,000.00	-	46,725,925.02	254,459,925.02

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

____杨小松____ ____蔡忠评____ ____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

7.4 报表附注

7.4.1 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化产品及金融衍生产品等。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。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司于 2025 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 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 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年度财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2023 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 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、金融负债或权益工具。

(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商业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商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为货币资金、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。

7.4.4.4 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。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在

清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 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。

7.4.4.10 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逐日确认。

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。

7.4.4.11 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(经估值汇率调整)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。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 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。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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。

对基金从境内证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，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。

对基金取得的境内企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从境内上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

基金卖出境内股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入境内股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	206,095,477.98	14,535,105.96
等于：本金	206,075,932.07	14,534,175.20
加：应计利息	19,545.91	930.76
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	206,095,477.98	14,535,105.96

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	3,301,989,560.09	-	3,507,448,592.76	205,459,032.67
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	3,301,989,560.09	-	3,507,448,592.76	205,459,032.67
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	205,420,247.66	-	232,147,790.38	26,727,542.72
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	205,420,247.66	-	232,147,790.38	26,727,542.72

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 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	386,514,946.97	-	-	-
一指期货	386,514,946.97	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	386,514,946.97	-	-	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 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	21,722,396.47	-	-	-
一指期货	21,722,396.47	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	21,722,396.47	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值	公允价值变动
ES2503	ES2503	176.00	375,507,763.38	-11,007,183.59

合计	-11,007,183.59
减：可抵销期货暂收款	-11,007,183.59
净额	0.00

注：1、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

2、衍生金融资产项下的利率/货币/权益/其他衍生工具为国债/外汇/股指/商品期货投资，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国债/外汇/股指/商品期货投资合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的国债/外汇/股指/商品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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 其他资产

无。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 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	13,012,140.52	19,667,590.43
预提费用	180,000.00	55,000.00
应付指数使用费	-	-
可退替代款	-	-
合计	13,192,140.52	19,722,590.43

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	207,734,000.00	207,734,000.00
本期申购	2,626,000,000.00	2,626,000,000.00

本期赎回 (以“-”号填列)	-282,000,000.00	-282,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	2,551,734,000.00	2,551,734,000.00

注：红利再投及转入份额计入本期申购，转出份额计入本期赎回。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	27,127,635.90	19,598,289.12	46,725,925.02
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	27,127,635.90	19,598,289.12	46,725,925.02
本期利润	50,232,174.69	167,151,944.52	217,384,119.21
本期基金份额交易产生的变动数	392,860,170.44	675,394,464.55	1,068,254,634.99
其中：基金申购款	434,720,005.36	722,279,537.99	1,156,999,543.35
基金赎回款	-41,859,834.92	-46,885,073.44	-88,744,908.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	470,219,981.03	862,144,698.19	1,332,364,679.22

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 3 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	190,765.74	94,059.74
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	244,337.02	-
其他	-	60,957.36
合计	435,102.76	155,017.10

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 3 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 12 月 31 日
----	-------------------------------------	--

股票投资收益——买卖股票差价收入	19,967,183.52	38,245,336.48
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	19,967,183.52	38,245,336.48

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	329,703,763.23	525,576,951.70
减：卖出股票成本总额	309,278,992.44	487,103,285.65
减：交易费用	457,587.27	228,329.57
买卖股票差价收入	19,967,183.52	38,245,336.48

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	370,744,908.36	638,815,268.30
减：现金支付赎回款总额	370,744,908.36	638,815,268.30
减：赎回股票成本总额	-	-
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-	-

7.4.7.11 基金投资收益

无。

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

无。

7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
股指期货-投资收益	22,904,314.21	2,833,989.09

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	16,128,709.05	4,288,622.79
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	16,128,709.05	4,288,622.79

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	178,731,489.95	26,727,542.72
——股票投资	178,731,489.95	26,727,542.72
——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	-11,579,545.43	572,361.84
——权证投资	-	-
——期货投资	-11,579,545.43	572,361.84
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	167,151,944.52	27,299,904.56

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 3 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	28,071,385.27	128,224.53
合计	28,071,385.27	128,224.53

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额，或强制退款的被替代证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 3 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	55,000.00
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
银行费用	12,551.40	4,965.57
合计	192,551.40	59,965.57

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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("美国花旗银行")	境外资产托管人
华泰证券股份有限公司("华泰证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司("兴业证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
南方资本管理有限公司("南方资本")	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司("南方东英")	基金管理人的子公司
厦门国际信托有限公司("厦门国际信托")	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司("深圳投资控股")	基金管理人的股东

厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 基金交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 权证交易

无。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	8,574,138.01	1,904,133.27
其中：应支付销售机构的客户维护费	566,201.99	7,420.38
应支付基金管理人的净管理费	8,007,936.02	1,896,712.89

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60% 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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,143,534.61	476,033.26

注：支付基金托管人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。

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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

无。

7.4.10.4.2 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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2023 年 03 月 23 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	7,608,200.00	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份	7,608,200.00	-

额		
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注：基金管理人南方基金投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

7.4.10.5.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
兴业证券股份有限公司	1,848,000.00	0.07%	-	-

注：本基金其他关联方投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 3 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
美国花旗银行	23,215,125.46	6,410.20	194,011.42	6,538.98
招商银行	182,880,352.52	184,355.54	14,341,094.54	87,520.76

注：本基金的银行存款由基金托管人和境外资产托管人保管，按银行约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

无。

7.4.12 期末 (2024 年 12 月 31 日) 本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人开立的托管账户或其他大中型商业银行开立的存款账户,因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算,在境内交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算,违约风险发生的可能性很小;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净资产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。

于本期末,本基金无债券投资(上期末:同)。

7.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的进行期货投资,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,本基金的卖出回购金融资产款(若有)计息且利息金额不重大;除此之外,本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息,该部分账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金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,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超过基金资产净值的 15%。于本期末,本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合该要求。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

本基金持有的利率敏感性资产存在相应的利率风险。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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
货币资金	206,095,477.98	-	-	-	206,095,477.98
结算备付金	171,327,035.45	-	-	-	171,327,035.45
存出保证金	-	-	-	28,445,821.47	28,445,821.47
交易性金融资产	-	-	-	3,507,448,592.76	3,507,448,592.76
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	-	-	-	60,844.15	60,844.15
应收股利	-	-	-	1,754,233.12	1,754,233.12
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	377,422,513.43	-	-	3,537,709,491.50	3,915,132,004.93
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	-	-	-	15,200,716.23	15,200,716.23
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,794,013.04	1,794,013.04
应付托管费	-	-	-	448,503.27	448,503.27
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾	-	-	-	-	-

问费					
应交税费	-	-	-	397,952.65	397,952.65
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税 负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	13,192,140.5 2	13,192,140.5 2
负债总计	-	-	-	31,033,325.7 1	31,033,325.7 1
利率敏感度 缺口	377,422,513. 43	-	-	3,506,676,16 5.79	3,884,098,67 9.22
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	14,535,105.9 6	-	-	-	14,535,105.9 6
结算备付金	8,073,541.40	-	-	-	8,073,541.40
存出保证金	-	-	-	1,493,918.50	1,493,918.50
交易性金融 资产	-	-	-	232,147,790. 38	232,147,790. 38
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	-	-	-	17,943,020.2 3	17,943,020.2 3
应收股利	-	-	-	241,512.11	241,512.11
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税 资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	22,608,647.3 6	-	-	251,826,241. 22	274,434,888. 58
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	-	-	-	8,668.51	8,668.51
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	155,347.76	155,347.76
应付托管费	-	-	-	38,836.93	38,836.93
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	49,519.93	49,519.93
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	19,722,590.43	19,722,590.43
负债总计	-	-	-	19,974,963.56	19,974,963.56
利率敏感度缺口	22,608,647.36	-	-	231,851,277.66	254,459,925.02

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。

7.4.13.4.1.2 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（2024年12月31日）	上年度末（2023年12月31日）
	1.市场利率平行上升25个基点	0.00	0.00
2.市场利率平行下降25个基点	0.00	0.00	

7.4.13.4.2 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或负债，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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日					
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产						
货币资金	23,214,474.79	-	-	-	-	23,214,474.79
结算备付金	21,081,697.43	-	-	-	-	21,081,697.43
存出保证金	28,445,821.47	-	-	-	-	28,445,821.47
交易性金融资产	3,507,448,592.76	-	-	-	-	3,507,448,592.76
应收股利	1,754,233.12	-	-	-	-	1,754,233.12
资产合计	3,581,944,819.57	-	-	-	-	3,581,944,819.57
以外币计价的负债						
应付清算款	15,200,716.23	-	-	-	-	15,200,716.23
负债合计	15,200,716.23	-	-	-	-	15,200,716.23
资产负债表外汇风险敞口净额	3,566,744,103.34	-	-	-	-	3,566,744,103.34

项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日					
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产						
货币资金	11,086,906.07	-	-	-	-	11,086,906.07
结算备付金	8,073,541.40	-	-	-	-	8,073,541.40
存出保证金	1,493,918.50	-	-	-	-	1,493,918.50
交易性金融资产	232,147,790.38	-	-	-	-	232,147,790.38
应收股利	241,512.11	-	-	-	-	241,512.11
应收清算款	17,943,020.23	-	-	-	-	17,943,020.23
资产合计	270,986,688.69	-	-	-	-	270,986,688.69
以外币计价的负债						

负债合计	-	-	-	-	-	-
资产负债表外汇率风险敞口净额	270,986,688.69	-	-	-	-	270,986,688.69

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 (2024 年 12 月 31 日)	上年度末 (2023 年 12 月 31 日)
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	178,337,205.17	13,549,334.43
2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-178,337,205.17	-13,549,334.43	

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位: 人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	3,507,448,592.76	90.30	232,147,790.38	91.23
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	3,507,448,592.76	90.30	232,147,790.38	91.23
----	------------------	-------	----------------	-------

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 (2024 年 12 月 31 日)	上年度末 (2023 年 12 月 31 日)
	1.组合自身基准上升 5%	185,613,055.18	12,214,851.96
	2.组合自身基准下降 5%	-185,613,055.18	-12,214,851.96

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位: 人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	3,507,448,592.76	232,147,790.38
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	3,507,448,592.76	232,147,790.38

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关金融工具的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上期末:同)。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	3,507,448,592.76	89.59
	其中: 普通股	3,438,739,227.21	87.83
	存托凭证	-	-
	房地产信托凭证	68,709,365.55	1.75
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	377,422,513.43	9.64
8	其他各项资产	30,260,898.74	0.77
9	合计	3,915,132,004.93	100.00

8.2 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	3,507,448,592.76	90.30
合计	3,507,448,592.76	90.30

8.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

8.3.1 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 (%)
能源	112,963,608.01	2.91
材料	66,414,579.13	1.71
工业	273,767,353.24	7.05
非必需消费品	382,685,591.13	9.85
必需消费品	194,098,050.21	5.00
医疗保健	353,890,238.32	9.11
金融	487,780,216.53	12.56
科技	1,124,067,335.26	28.94
通讯	356,619,802.93	9.18
公用事业	81,604,472.79	2.10
房地产	73,557,345.21	1.89
政府	-	-
合计	3,507,448,592.76	90.30

本基金对以上行业分类采用彭博行业分类标准。

8.3.2 报告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的权益投资。

8.4 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

8.4.1 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

8.4.1.1 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

金额单位：人民币

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	148,087	266,574,241.31	6.86
2	NVIDIA Corp	英伟达	NVDA UW	纳斯达克证券交易所	美国	240,316	231,984,300.99	5.97
3	Microsoft Corp	微软	MSFT UW	纳斯达克证券交易所	美国	72,838	220,692,628.28	5.68
4	Amazon	亚马逊	AMZN	纳斯达克	美国	91,682	144,588	3.72

	.com Inc	公司	UW	克证券 交易所			,296.93	
5	Alphabe t Inc	Alphabe t 公司	GOOG UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	46,625	63,827, 708.53	1.64
			GOOG L UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	57,242	77,892, 859.76	2.01
6	Meta Platfor ms Inc	Meta 平 台股份 有限公司	META UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	21,357	89,889, 051.95	2.31
7	Tesla Inc	特斯拉 公司	TSLA UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	27,360	79,425, 080.16	2.04
8	Broadco m Inc	博通股 份有限 公司	AVGO UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	45,757	76,256, 724.42	1.96
9	Berkshir e Hathaw ay Inc	伯克希 尔哈撒 韦公司	BRK/B UN	纽约证 券交易 所	美国	17,957	58,510, 333.74	1.51
10	JPMorg an Chase & Co	摩根大 通	JPM UN	纽约证 券交易 所	美国	27,582	47,527, 409.28	1.22
11	Eli Lilly & Co	礼来	LLY UN	纽约证 券交易 所	美国	7,719	42,836, 164.41	1.10
12	Visa Inc	维萨公 司	V UN	纽约证 券交易 所	美国	16,929	38,459, 673.55	0.99
13	Exxon Mobil Corp	埃克森 美孚石 油公司	XOM UN	纽约证 券交易 所	美国	43,058	33,294, 864.94	0.86
14	UnitedH ealth Group Inc	联合健 康集团	UNH UN	纽约证 券交易 所	美国	9,016	32,785, 097.40	0.84
15	Masterc ard Inc	万事达 股份有 限公司	MA UN	纽约证 券交易 所	美国	8,031	30,398, 907.37	0.78
16	Costco Wholes	开市客	COST UW	纳斯达 克证券	美国	4,341	28,592, 062.78	0.74

	ale Corp			交易所				
17	Procter & Gamble Co/The	宝洁	PG UN	纽约证券交易所	美国	23,072	27,804,880.72	0.72
18	Walmart Inc	沃尔玛股份有限公司	WMT UN	纽约证券交易所	美国	42,525	27,618,794.25	0.71
19	Home Depot Inc/The	家得宝	HD UN	纽约证券交易所	美国	9,731	27,209,975.13	0.70
20	Netflix Inc	奈飞公司	NFLX UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,188	26,833,205.71	0.69
21	Johnson & Johnson	强生	JNJ UN	纽约证券交易所	美国	23,587	24,520,724.61	0.63
22	Salesforce Inc	Salesforce 股份有限公司	CRM UN	纽约证券交易所	美国	9,366	22,509,286.93	0.58
23	AbbVie Inc	艾伯维股份有限公司	ABBV UN	纽约证券交易所	美国	17,312	22,113,979.71	0.57
24	Bank of America Corp	美国银行公司	BAC UN	纽约证券交易所	美国	65,398	20,661,201.91	0.53
25	Oracle Corp	甲骨文	ORCL UN	纽约证券交易所	美国	15,745	18,860,541.50	0.49
26	Merck & Co Inc	默克	MRK UN	纽约证券交易所	美国	24,783	17,722,373.66	0.46
27	Chevron Corp	雪佛龙	CVX UN	纽约证券交易所	美国	16,373	17,047,041.31	0.44
28	Coca-Cola Co/The	可口可乐	KO UN	纽约证券交易所	美国	37,983	16,999,283.45	0.44
29	Cisco Systems Inc	思科	CSCO UW	纳斯达克证券交易所	美国	39,050	16,617,855.58	0.43
30	Wells Fargo &	富国银行	WFC UN	纽约证 券交易	美国	32,619	16,469,764.19	0.42

	Co			所				
31	Accenture PLC	埃森哲公司	ACN UN	纽约证券交易所	美国	6,122	15,481,357.90	0.40
32	Service Now Inc	Service Now 公司	NOW UN	纽约证券交易所	美国	2,018	15,378,303.41	0.40
33	PepsiCo Inc	百事可乐	PEP UW	纳斯达克证券交易所	美国	13,441	14,691,928.39	0.38
34	McDonald's Corp	麦当劳	MCD UN	纽约证券交易所	美国	7,020	14,628,593.84	0.38
35	International Business Machines Corp	国际商业机器公司	IBM UN	纽约证券交易所	美国	9,058	14,313,686.85	0.37
36	Walt Disney Co/The	华特迪士尼公司	DIS UN	纽约证券交易所	美国	17,741	14,200,399.18	0.37
37	Linde PLC	Linde PLC	LIN UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,665	14,039,632.05	0.36
38	Thermo Fisher Scientific Inc	Thermo Fisher Scientific 公司	TMO UN	纽约证券交易所	美国	3,747	14,012,361.13	0.36
39	Abbott Laboratories	雅培制药	ABT UN	纽约证券交易所	美国	16,992	13,815,854.07	0.36
40	Advanced Micro Devices Inc	AMD 公司	AMD UW	纳斯达克证券交易所	美国	15,898	13,804,024.12	0.36
41	Adobe Inc	奥多比	ADBE UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,313	13,786,667.15	0.35
42	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	15,232	13,177,567.85	0.34

43	Intuitive Surgical Inc	直觉外科手术公司	ISRG UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,489	13,090,927.79	0.34
44	General Electric Co	通用电气航空航天	GE UN	纽约证券交易所	美国	10,603	12,712,501.16	0.33
45	Goldman Sachs Group Inc/The	高盛	GS UN	纽约证券交易所	美国	3,075	12,657,381.44	0.33
46	Intuit Inc	Intuit 股份有限公司	INTU UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,746	12,406,179.21	0.32
47	Caterpillar Inc	卡特彼勒	CAT UN	纽约证券交易所	美国	4,730	12,334,250.64	0.32
48	Texas Instruments Inc	德州仪器	TXN UW	纳斯达克证券交易所	美国	8,937	12,046,154.45	0.31
49	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM UW	纳斯达克证券交易所	美国	10,884	12,019,005.38	0.31
50	Verizon Communications Inc	Verizon 通信股份有限公司	VZ UN	纽约证券交易所	美国	41,241	11,855,307.61	0.31
51	American Express Co	美国运通	AXP UN	纽约证券交易所	美国	5,452	11,631,543.43	0.30
52	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	324	11,571,656.87	0.30
53	AT&T Inc	美国电话电报公司	T UN	纽约证券交易所	美国	70,295	11,505,876.32	0.30
54	S&P Global Inc	标普全球	SPGI UN	纽约证券交易所	美国	3,110	11,133,920.83	0.29
55	Morgan Stanley	摩根士丹利	MS UN	纽约证券交易所	美国	12,153	10,982,977.80	0.28
56	Palantir	Palantir	PLTR	纳斯达克	美国	20,082	10,917,	0.28

	Technologies Inc	科技股份有限公司	UW	克证 券交易所			753.85	
57	RTX Corp	RTX 公司	RTX UN	纽约证 券交易所	美国	13,040	10,847,215.09	0.28
58	Pfizer Inc	辉瑞制 药	PFE UN	纽约证 券交易所	美国	55,519	10,587,931.44	0.27
59	Blackrock Inc	贝莱德 股份有 限公司	BLK UN	纽约证 券交易所	美国	1,426	10,508,052.43	0.27
60	Danaher Corp	丹纳赫	DHR UN	纽约证 券交易所	美国	6,297	10,390,662.19	0.27
61	NextEra Energy Inc	新纪元 能源公 司	NEE UN	纽约证 券交易所	美国	20,146	10,381,967.03	0.27
62	Honeywell International Inc	霍尼韦 尔	HON UW	纳斯达 克证 券交易所	美国	6,371	10,345,151.28	0.27
63	Comcast Corp	康卡斯 特公司	CMCS A UW	纳斯达 克证 券交易所	美国	37,395	10,088,447.48	0.26
64	Progressive Corp/The	前进保 险公司	PGR UN	纽约证 券交易所	美国	5,739	9,884,925.48	0.25
65	Amgen Inc	安进公 司	AMGN UW	纳斯达 克证 券交易所	美国	5,266	9,866,296.38	0.25
66	Lowe's Cos Inc	劳氏	LOW UN	纽约证 券交易所	美国	5,558	9,860,431.79	0.25
67	Union Pacific Corp	联合太 平洋	UNP UN	纽约证 券交易所	美国	5,940	9,737,101.85	0.25
68	TJX Cos Inc/The	TJX 公 司	TJX UN	纽约证 券交易所	美国	11,050	9,596,158.17	0.25
69	Applied Materials Inc	应用材 料	AMAT UW	纳斯达 克证 券交易所	美国	8,076	9,441,243.70	0.24

70	Citigroup Inc	花旗集团	C UN	纽约证券交易所	美国	18,528	9,375,010.07	0.24
71	Boeing Co/The	波音	BA UN	纽约证券交易所	美国	7,324	9,318,667.96	0.24
72	Boston Scientific Corp	波士顿科学	BSX UN	纽约证券交易所	美国	14,439	9,270,818.23	0.24
73	Eaton Corp PLC	伊顿	ETN UN	纽约证券交易所	美国	3,872	9,237,098.60	0.24
74	Conoco Phillips	康菲石油	COP UN	纽约证券交易所	美国	12,673	9,034,247.49	0.23
75	Uber Technologies Inc	优步技术股份有限公司	UBER UN	纽约证券交易所	美国	20,630	8,945,256.46	0.23
76	Blackstone Inc	黑石集团股份有限公司	BX UN	纽约证券交易所	美国	7,074	8,767,684.87	0.23
77	Stryker Corp	史赛克	SYK UN	纽约证券交易所	美国	3,362	8,701,472.66	0.22
78	Automatic Data Processing Inc	ADP 公司	ADP UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,991	8,398,102.99	0.22
79	Palo Alto Networks Inc	Palo Alto Networks 股份有限公司	PANW UW	纳斯达克证券交易所	美国	6,412	8,386,904.10	0.22
80	Fiserv Inc	Fiserv 公司	FI UN	纽约证券交易所	美国	5,573	8,229,321.01	0.21
81	Gilead Sciences Inc	吉利德科学	GILD UW	纳斯达克证券交易所	美国	12,209	8,106,684.53	0.21
82	Bristol-Myers	百时美施贵宝	BMY UN	纽约证券交易所	美国	19,869	8,078,256.64	0.21

	Squibb Co	公司		所				
83	Arista Networks Inc	Arista 网络股份有限公司	ANET UN	纽约证券交易所	美国	10,120	8,040,682.58	0.21
84	Charles Schwab Corp/The	嘉信理财	SCHW UN	纽约证券交易所	美国	14,646	7,791,869.49	0.20
85	Deere & Co	迪尔	DE UN	纽约证券交易所	美国	2,493	7,592,992.62	0.20
86	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	4,775	7,576,471.17	0.20
87	Analog Devices Inc	亚德诺半导体	ADI UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,864	7,428,531.66	0.19
88	Marsh & McLennan Cos Inc	Marsh & McLennan 股份有限公司	MMC UN	纽约证券交易所	美国	4,812	7,347,385.27	0.19
89	Vertex Pharmaceuticals Inc	福泰制药	VRTX UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,523	7,303,501.38	0.19
90	Chubb Ltd	邱博保险集团	CB UN	纽约证券交易所	美国	3,673	7,295,147.02	0.19
91	Starbucks Corp	星巴克	SBUX UW	纳斯达克证券交易所	美国	11,105	7,284,230.36	0.19
92	Lockheed Martin Corp	洛克希德马丁	LMT UN	纽约证券交易所	美国	2,067	7,220,301.98	0.19
93	Medtronic PLC	美敦力	MDT UN	纽约证券交易所	美国	12,565	7,214,941.01	0.19
94	KKR & Co Inc	KKR & Co 有限	KKR UN	纽约证券交易所	美国	6,614	7,032,244.52	0.18

		公司		所				
95	Prologis Inc	安博	PLD UN	纽约证券交易所	美国	9,073	6,893,791.33	0.18
96	Micron Technology Inc	美光科技股份有限公司	MU UW	纳斯达克证券交易所	美国	10,875	6,579,111.22	0.17
97	Lam Research Corp	泛林集团	LRCX UW	纳斯达克证券交易所	美国	12,606	6,545,263.77	0.17
98	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	7,165	6,494,766.12	0.17
99	Equinix Inc	Equinix 有限公司	EQIX UW	纳斯达克证券交易所	美国	945	6,405,087.60	0.16
100	GE Vernova Inc	通用电气 Vernova 股份有限公司	GEV UN	纽约证券交易所	美国	2,701	6,386,461.59	0.16
101	Southern Co/The	南方公司	SO UN	纽约证券交易所	美国	10,735	6,352,426.46	0.16
102	NIKE Inc	耐克公司	NKE UN	纽约证券交易所	美国	11,664	6,344,588.80	0.16
103	Altria Group Inc	高特利	MO UN	纽约证券交易所	美国	16,604	6,241,135.36	0.16
104	Intel Corp	英特尔	INTC UW	纳斯达克证券交易所	美国	42,253	6,089,815.88	0.16
105	American Tower Corp	美国发射塔公司	AMT UN	纽约证券交易所	美国	4,578	6,035,747.10	0.16
106	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	9,822	6,026,091.07	0.16
107	Intercontinental	洲际交易所	ICE UN	纽约证券交易所	美国	5,625	6,025,182.10	0.16

	Exchange Inc	(ICE)		所				
108	Elevance Health Inc	Elevance 健康股份有限公司	ELV UN	纽约证券交易所	美国	2,272	6,024,891.33	0.16
109	KLA Corp	KLA 公司	KLAC UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,311	5,938,246.09	0.15
110	Amphenol Corp	安费诺公司	APH UN	纽约证券交易所	美国	11,811	5,896,457.26	0.15
111	CME Group Inc	芝加哥商业交易所	CME UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,530	5,892,848.33	0.15
112	Duke Energy Corp	杜克能源	DUK UN	纽约证券交易所	美国	7,568	5,861,251.14	0.15
113	Trane Technologies PLC	特灵科技公共有限公司	TT UN	纽约证券交易所	美国	2,205	5,854,353.37	0.15
114	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	2,687	5,803,454.25	0.15
115	Chipotle Mexican Grill Inc	Chipotle Mexican Grill 股份有限公司	CMG UN	纽约证券交易所	美国	13,349	5,786,264.48	0.15
116	Parker-Hannifin Corp	派克汉尼汾公司	PH UN	纽约证券交易所	美国	1,261	5,765,339.98	0.15
117	Mondelēz International Inc	亿滋国际	MDLZ UW	纳斯达克证券交易所	美国	13,100	5,624,657.03	0.14
118	CrowdStrike Holdings Inc	CrowdStrike 控股股份有限公司	CRWD UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,280	5,607,849.11	0.14

119	Sherwin-Williams Co/The	宣伟公司	SHW UN	纽约证券交易所	美国	2,270	5,546,864.88	0.14
120	Aon PLC	怡安集团	AON UN	纽约证券交易所	美国	2,119	5,470,803.99	0.14
121	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	1,637	5,439,250.29	0.14
122	Cigna Group/The	信诺集团	CI UN	纽约证券交易所	美国	2,725	5,409,138.01	0.14
123	PNC Financial Services Group Inc/The	PNC 财务服务	PNC UN	纽约证券交易所	美国	3,887	5,388,481.79	0.14
124	Regeneron Pharmaceuticals 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	1,031	5,279,248.87	0.14
125	US Bancorp	美国合众银行	USB UN	纽约证券交易所	美国	15,284	5,254,962.79	0.14
126	Synopsys Inc	新思科技公司	SNPS UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,505	5,250,887.55	0.14
127	Welltower Inc	Welltower Inc	WELL UN	纽约证券交易所	美国	5,795	5,250,003.73	0.14
128	Colgate-Palmolive Co	高露洁棕榄	CL UN	纽约证券交易所	美国	8,004	5,230,593.54	0.13
129	Apollo Global Management Inc	阿波罗全球管理股份有限公司	APO UN	纽约证券交易所	美国	4,379	5,198,907.07	0.13
130	Moody's	穆迪	MCO	纽约证	美国	1,527	5,196,0	0.13

	Corp		UN	券交易所			34.23	
131	Waste Management Inc	废品管理	WM UN	纽约证券交易所	美国	3,579	5,191,508.56	0.13
132	Zoetis Inc	硕腾股份有限公司	ZTS UN	纽约证券交易所	美国	4,420	5,176,730.57	0.13
133	McKesson Corp	McKesson 公司	MCK UN	纽约证券交易所	美国	1,243	5,092,249.12	0.13
134	TransDigm Group Inc	TransDigm 集团公司	TDG UN	纽约证券交易所	美国	550	5,010,343.55	0.13
135	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	2,448	4,994,966.13	0.13
136	Emerson Electric Co	艾默生电气	EMR UN	纽约证券交易所	美国	5,586	4,976,335.09	0.13
137	3M Co	3M 公司	MMM UN	纽约证券交易所	美国	5,335	4,950,616.22	0.13
138	Constellation Energy Corp	美国联合能源公司	CEG UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,064	4,927,270.38	0.13
139	EOG Resources Inc	EOG 资源	EOG UN	纽约证券交易所	美国	5,510	4,855,158.94	0.13
140	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	565	4,816,062.67	0.12
141	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	2,632	4,797,321.93	0.12
142	Capital One	第一资本金融	COF UN	纽约证券交易所	美国	3,737	4,790,219.22	0.12

	Financia l Corp			所				
143	General Dynam ics Corp	通用动 力	GD UN	纽约证 券交易 所	美国	2,528	4,788,2 12.79	0.12
144	William s Cos Inc/The	威廉姆 斯公司	WMB UN	纽约证 券交易 所	美国	11,943	4,646,2 59.43	0.12
145	Becton Dickins on & Co	碧迪	BDX UN	纽约证 券交易 所	美国	2,831	4,616,8 86.26	0.12
146	Air Product s and Chemic als Inc	空气产 品公司	APD UN	纽约证 券交易 所	美国	2,178	4,540,9 63.46	0.12
147	Marriott Internati onal Inc/MD	万豪国 际	MAR UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,260	4,531,5 98.99	0.12
148	Northro p Grumm an Corp	诺斯洛 普格魯 门公司	NOC UN	纽约证 券交易 所	美国	1,342	4,527,1 62.16	0.12
149	Autodes k Inc	欧特克	ADSK UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,106	4,474,5 66.37	0.12
150	FedEx Corp	联邦快 递	FDX UN	纽约证 券交易 所	美国	2,203	4,455,1 54.60	0.11
151	Cintas Corp	Cintas 公司	CTAS UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,359	4,411,4 44.16	0.11
152	Target Corp	塔吉特 公司	TGT UN	纽约证 券交易 所	美国	4,514	4,386,3 79.79	0.11
153	CSX Corp	CSX 公 司	CSX UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	18,892	4,382,3 70.97	0.11
154	Hilton Worldw ide Holdin gs 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	2,388	4,242,7 23.65	0.11

155	Fortinet Inc	Fortinet 股份有限公司	FTNT UN	纳斯达克证券交易所	美国	6,232	4,232,525.32	0.11
156	Ecolab Inc	艺康集团	ECL UN	纽约证券交易所	美国	2,469	4,158,748.76	0.11
157	ONEOK Inc	Oneok 股份有限公司	OKE UN	纽约证券交易所	美国	5,723	4,130,377.01	0.11
158	General Motors Co	通用汽车公司	GM UN	纽约证券交易所	美国	10,773	4,125,262.53	0.11
159	Truist Financial Corp	Truist 金融公司	TFC UN	纽约证券交易所	美国	13,005	4,055,385.46	0.10
160	Royal Caribbean 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	2,424	4,019,699.80	0.10
161	Carrier Global Corp	开利全球公司	CARR UN	纽约证券交易所	美国	8,174	4,010,819.82	0.10
162	Airbnb Inc	爱彼迎股份有限公司	ABNB UN	纳斯达克证券交易所	美国	4,240	4,005,221.21	0.10
163	CVS Health Corp	CVS 健康公司	CVS UN	纽约证券交易所	美国	12,328	3,978,088.74	0.10
164	Bank of New York Mellon Corp/The	纽约梅隆银行	BK UN	纽约证券交易所	美国	7,123	3,933,924.43	0.10
165	Roper Technologies Inc	儒博技术公司	ROP UN	纳斯达克证券交易所	美国	1,051	3,927,471.12	0.10
166	Sempra	Sempra	SRE UN	纽约证券交易所	美国	6,205	3,912,664.81	0.10
167	Digital Realty	数字房地产信	DLR UN	纽约证券交易所	美国	3,054	3,892,991.74	0.10

	Trust Inc	托有限公司		所				
168	Workday Inc	Workday 股份有限公司	WDAY UN	纳斯达克证券交易所	美国	2,087	3,871,015.29	0.10
169	HCA Healthcare Inc	HCA 医疗保健有限公司	HCA UN	纽约证券交易所	美国	1,787	3,855,628.09	0.10
170	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	14,077	3,853,357.35	0.10
171	Travelers Cos Inc/The	旅行家集团	TRV UN	纽约证券交易所	美国	2,224	3,851,108.82	0.10
172	PACCAR Inc	帕卡	PCAR UN	纳斯达克证券交易所	美国	5,136	3,840,379.12	0.10
173	AutoZone Inc	AutoZone 股份有限公司	AZO UN	纽约证券交易所	美国	166	3,820,864.63	0.10
174	Schlumberger NV	斯伦贝谢公众有限公司	SLB UN	纽约证券交易所	美国	13,835	3,812,971.05	0.10
175	Norfolk Southern Corp	诺福克南方	NSC UN	纽约证券交易所	美国	2,217	3,740,339.45	0.10
176	Kinder Morgan Inc	特拉华州金德摩根公司	KMI UN	纽约证券交易所	美国	18,935	3,729,478.50	0.10
177	NXP Semiconductors NV	恩智浦半导体公司	NXPI UN	纳斯达克证券交易所	美国	2,490	3,720,331.26	0.10
178	Simon Property Group Inc	西蒙房地产集团公司	SPG UN	纽约证券交易所	美国	3,005	3,719,932.66	0.10

179	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	6,544	3,712,937.42	0.10
180	Aflac Inc	家庭人寿保险	AFL UN	纽约证券交易所	美国	4,898	3,641,996.53	0.09
181	Ameriprise Financial Inc	阿默普莱斯金融公司	AMP UN	纽约证券交易所	美国	950	3,635,953.82	0.09
182	Allstate Corp/The	好事达保险公司	ALL UN	纽约证券交易所	美国	2,594	3,594,899.14	0.09
183	Copart Inc	Copart 股份有限公司	CPRT UW	纳斯达克证券交易所	美国	8,588	3,542,913.07	0.09
184	Ross Stores Inc	罗斯百货股份有限公司	ROST UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,250	3,534,015.12	0.09
185	American Electric Power Co Inc	美国电力	AEP UW	纳斯达克证券交易所	美国	5,218	3,459,461.64	0.09
186	Fair Isaac Corp	费埃哲公司	FICO UN	纽约证券交易所	美国	238	3,406,161.09	0.09
187	Cummins Inc	康明斯	CMI UN	纽约证券交易所	美国	1,344	3,367,897.67	0.09
188	MetLife Inc	大都会集团	MET UN	纽约证券交易所	美国	5,698	3,353,764.12	0.09
189	Public Storage	公共存储	PSA UN	纽约证券交易所	美国	1,544	3,323,451.50	0.09
190	Phillips 66	Phillips 66	PSX UN	纽约证券交易所	美国	4,046	3,313,570.47	0.09
191	MSCI Inc	MSCI 明晟	MSCI UN	纽约证券交易所	美国	767	3,308,156.82	0.09

192	Vistra Corp	Vistra 公司	VST UN	纽约证券交易所	美国	3,333	3,303,218.67	0.09
193	Realty Income Corp	Realty Income 公司	O UN	纽约证券交易所	美国	8,574	3,291,836.77	0.08
194	WW Grainger Inc	固安捷股份有限公司	GWW UN	纽约证券交易所	美国	434	3,288,388.93	0.08
195	Quanta Services Inc	Quanta 服务股份有限公司	PWR UN	纽约证券交易所	美国	1,446	3,285,158.46	0.08
196	United Rentals Inc	联合租赁公司	URI UN	纽约证券交易所	美国	643	3,256,021.15	0.08
197	American International Group Inc	美国国际集团	AIG UN	纽约证券交易所	美国	6,111	3,197,981.14	0.08
198	Dominion Energy Inc	Dominion 能源股份有限公司	D UN	纽约证券交易所	美国	8,230	3,186,386.25	0.08
199	Paychex Inc	Paychex 公司	PAYX UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,138	3,162,970.47	0.08
200	Marathon Petroleum Corp	马拉松石油公司	MPC UN	纽约证券交易所	美国	3,149	3,157,759.89	0.08
201	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	3,980	3,129,057.33	0.08
202	PG&E Corp	太平洋煤气电力	PCG UN	纽约证券交易所	美国	21,418	3,106,936.03	0.08
203	Kimberly-Clark Corp	金佰利	KMB UN	纽约证券交易所	美国	3,267	3,077,409.25	0.08

204	Edward s Lifescie nces Corp	爱德华 生命科 学公司	EW UN	纽约证 券交易 所	美国	5,778	3,074,8 04.60	0.08
205	Discove r Financia l Services	Discove r 金融服 务公司	DFS UN	纽约证 券交易 所	美国	2,460	3,063,3 06.47	0.08
206	Fidelity National Informa tion Services Inc	繁德信 息技术 有限公司	FIS UN	纽约证 券交易 所	美国	5,274	3,062,1 21.68	0.08
207	Lululem on Athletic a Inc	Lululem on Athletic a 股份 有限公司	LULU UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,107	3,043,0 50.06	0.08
208	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	710	3,033,2 69.02	0.08
209	TE Connect ivity PLC	TE Connect ivity 公 共有限 公司	TEL UN	纽约证 券交易 所	美国	2,931	3,012,2 63.58	0.08
210	Newmo nt Corp	纽蒙黄 金公司	NEM UN	纽约证 券交易 所	美国	11,153	2,984,0 10.22	0.08
211	Prudenti al Financia l Inc	保德信 金融集 团	PRU UN	纽约证 券交易 所	美国	3,488	2,971,9 19.19	0.08
212	Public Service Enterpri se Group	公共服 务企业 集团	PEG UN	纽约证 券交易 所	美国	4,881	2,964,4 65.18	0.08

	Inc							
213	AMETEK Inc	阿美特克股份有限公司	AME UN	纽约证券交易所	美国	2,266	2,936,239.71	0.08
214	Fastenal Co	法思诺公司	FAST UW	纳斯达克证券交易所	美国	5,612	2,900,942.94	0.07
215	Republic Services Inc	公共服务公司	RSG UN	纽约证券交易所	美国	1,994	2,883,647.65	0.07
216	Kenvue Inc	Kenvue Inc	KVUE UN	纽约证券交易所	美国	18,784	2,882,824.43	0.07
217	DR Horton Inc	霍顿房屋公司	DHI UN	纽约证券交易所	美国	2,857	2,871,519.53	0.07
218	Kroger Co/The	克罗格公司	KR UN	纽约证券交易所	美国	6,521	2,866,440.27	0.07
219	Baker Hughes Co	贝克休斯公司	BKR UW	纳斯达克证券交易所	美国	9,694	2,858,452.02	0.07
220	L3Harris Technologies Inc	L3Harris Technologies 股份有限公司	LHX UN	纽约证券交易所	美国	1,858	2,808,509.61	0.07
221	CBRE Group Inc	世邦魏理仕	CBRE UN	纽约证券交易所	美国	2,947	2,781,275.56	0.07
222	Crown Castle Inc	冠城股份有限公司	CCI UN	纽约证券交易所	美国	4,257	2,777,348.47	0.07
223	Cencora Inc	Cencora 股份有限公司	COR UN	纽约证券交易所	美国	1,718	2,774,724.13	0.07
224	Corteva Inc	科迪华公司	CTVA UN	纽约证券交易所	美国	6,733	2,756,835.36	0.07
225	Targa Resources Inc	Targa 资源公司	TRGP UN	纽约证券交易所	美国	2,136	2,740,764.40	0.07

	es Corp			所				
226	Verisk Analytic s Inc	Verisk 分析公 司	VRSK UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,383	2,738,2 03.10	0.07
227	Valero Energy Corp	Valero 能源	VLO UN	纽约证 券交易 所	美国	3,101	2,732,6 81.69	0.07
228	Delta Air Lines Inc	达美航 空有限 公司	DAL UN	纽约证 券交易 所	美国	6,281	2,731,5 95.59	0.07
229	Xcel Energy Inc	Xcel 能 源	XEL UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	5,625	2,730,1 54.32	0.07
230	Ford Motor Co	福特汽 车	F UN	纽约证 券交易 所	美国	38,241	2,721,4 26.88	0.07
231	Agilent Technol ogies Inc	安捷伦	A UN	纽约证 券交易 所	美国	2,815	2,718,4 16.38	0.07
232	Cogniza nt Technol ogy Solution s Corp	高知特 科技解 决方案 公司	CTSH UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,857	2,684,8 91.12	0.07
233	Exelon Corp	Exelon 公司	EXC UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	9,844	2,663,5 04.63	0.07
234	Sysco Corp	Sysco 公司	SY Y UN	纽约证 券交易 所	美国	4,813	2,645,3 45.43	0.07
235	Yum! Brands Inc	百胜餐 饮集团	YUM UN	纽约证 券交易 所	美国	2,734	2,636,6 57.96	0.07
236	Gartner Inc	Gartner 公司	IT UN	纽约证 券交易 所	美国	755	2,629,3 35.93	0.07
237	Otis Worldw ide Corp	奥的斯 电梯公 司	OTIS UN	纽约证 券交易 所	美国	3,913	2,604,9 53.45	0.07
238	Monster Beverag	怪兽饮 料公司	MNST UW	纳斯达 克证券	美国	6,860	2,591,8 61.01	0.07

	e Corp			交易所				
239	Hess Corp	赫斯公司	HES UN	纽约证券交易所	美国	2,708	2,589,197.56	0.07
240	Corning Inc	康宁公司	GLW UN	纽约证券交易所	美国	7,550	2,579,025.40	0.07
241	Ingersoll Rand Inc	英格索兰股份有限公司	IR UN	纽约证券交易所	美国	3,948	2,567,237.00	0.07
242	Keurig Dr Pepper Inc	Keurig Dr Pepper 有限公司	KDP UW	纳斯达克证券交易所	美国	11,030	2,546,732.23	0.07
243	GE Healthcare Technologies Inc	GE Healthcare Technologies Inc	GEHC UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,475	2,514,901.28	0.06
244	General Mills Inc	通用磨坊	GIS UN	纽约证券交易所	美国	5,439	2,493,260.81	0.06
245	Dell Technologies Inc	戴尔科技公司	DELL UN	纽约证券交易所	美国	3,009	2,492,629.17	0.06
246	Electronic Arts Inc	电子艺界	EA UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,338	2,458,787.91	0.06
247	Arch Capital Group Ltd	阿契资本集团	ACGL UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,671	2,436,988.72	0.06
248	Constellation Brands Inc	星座品牌股份有限公司	STZ UN	纽约证券交易所	美国	1,530	2,430,613.69	0.06
249	Vulcan Materials Co	Vulcan 材料	VMC UN	纽约证券交易所	美国	1,294	2,392,699.34	0.06
250	IQVIA	艾昆纬	IQV UN	纽约证	美国	1,689	2,385,8	0.06

	Holdings Inc			券交易所			68.71	
251	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	802	2,383,521.62	0.06
252	ResMed Inc	瑞思迈股份有限公司	RMD UN	纽约证券交易所	美国	1,438	2,363,950.05	0.06
253	Occidental Petroleum Corp	西方石油	OXY UN	纽约证券交易所	美国	6,619	2,350,928.77	0.06
254	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	1,841	2,334,450.15	0.06
255	Charter Communications Inc	Charter 通信公司	CHTR UW	纳斯达克证券交易所	美国	947	2,333,377.57	0.06
256	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	西屋制动公司	WAB UN	纽约证券交易所	美国	1,684	2,295,037.31	0.06
257	Lennar Corp	Lennar 公司	LEN UN	纽约证券交易所	美国	2,339	2,292,879.85	0.06
258	Entergy Corp	Entergy 公司	ETR UN	纽约证券交易所	美国	4,201	2,289,647.87	0.06
259	Rockwell Automation Inc	罗克韦尔自动化	ROK UN	纽约证券交易所	美国	1,106	2,272,136.36	0.06
260	Nasdaq Inc	纳斯达克股份有限公司	NDAQ UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,055	2,253,506.25	0.06

261	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	3,222	2,248,935.51	0.06
262	DuPont de Nemours Inc	杜邦公司	DD UN	纽约证券交易所	美国	4,095	2,244,532.97	0.06
263	Extra Space Storage Inc	Extra Space Storage 有限公司	EXR UN	纽约证券交易所	美国	2,077	2,233,573.90	0.06
264	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	2,840	2,233,407.13	0.06
265	Garmin Ltd	佳明有限公司	GRMN UN	纽约证券交易所	美国	1,505	2,231,432.47	0.06
266	Equifax Inc	Equifax 股份有限公司	EFX UN	纽约证券交易所	美国	1,214	2,224,003.98	0.06
267	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	599	2,223,972.35	0.06
268	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	987	2,222,422.39	0.06
269	HP Inc	惠普	HPQ UN	纽约证券交易所	美国	9,441	2,214,457.28	0.06
270	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	1,392	2,201,075.43	0.06
271	M&T	M&T	MTB	纽约证	美国	1,625	2,196,1	0.06

	Bank Corp	银行	UN	券交易所			73.01	
272	Consolidated Edison Inc	联合爱迪生	ED UN	纽约证券交易所	美国	3,394	2,176,982.64	0.06
273	Edison International	爱迪生国际	EIX UN	纽约证券交易所	美国	3,792	2,176,311.68	0.06
274	Deckers Outdoor Corp	德克斯户外用品公司	DECK UN	纽约证券交易所	美国	1,488	2,172,319.53	0.06
275	Iron Mountain Inc	美国铁山公司	IRM UN	纽约证券交易所	美国	2,874	2,171,516.01	0.06
276	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	5,261	2,168,872.19	0.06
277	VICI Properties Inc	VICI Properties 股份有限公司	VICI UN	纽约证券交易所	美国	10,328	2,168,602.84	0.06
278	Diamondback Energy Inc	Diamondback 能源股份有限公司	FANG UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,831	2,156,323.97	0.06
279	Centene Corp	Centene 公司	CNC UN	纽约证券交易所	美国	4,946	2,153,850.80	0.06
280	Humana Inc	Humana 股份有限公司	HUM UN	纽约证券交易所	美国	1,180	2,152,047.38	0.06
281	Dexcom Inc	Dexcom 股份有限公司	DXCM UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,827	2,139,453.23	0.06
282	Take-Two Interactive Software Inc	Take-Two 互动软件股份有限公司	TTWO UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,600	2,117,185.08	0.05

283	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	3,099	2,094,915.12	0.05
284	eBay Inc	eBay 股份有限公司	EBAY UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,692	2,089,447.91	0.05
285	ANSYS Inc	ANSYS 股份有限公司	ANSS UW	纳斯达克证券交易所	美国	857	2,078,107.57	0.05
286	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	4,016	2,066,704.10	0.05
287	Monolithic Power Systems Inc	芯源系统有限公司	MPWR UW	纳斯达克证券交易所	美国	478	2,033,113.86	0.05
288	State Street Corp	道富集团	STT UN	纽约证券交易所	美国	2,871	2,025,609.53	0.05
289	Cardinal Health Inc	嘉德诺健康集团	CAH UN	纽约证券交易所	美国	2,371	2,015,757.97	0.05
290	Global Payments Inc	环汇有限公司	GPN UN	纽约证券交易所	美国	2,493	2,008,191.54	0.05
291	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	1,793	2,002,017.49	0.05
292	Fifth Third Bancorp	五三银行	FITB UW	纳斯达克证券交易所	美国	6,570	1,996,790.88	0.05
293	Tractor Supply Co	拖拉机供应公司	TSCO UW	纳斯达克证券交易所	美国	5,234	1,996,333.98	0.05
294	Xylem Inc/NY	赛莱默公司	XYL UN	纽约证券交易所	美国	2,380	1,984,915.64	0.05
295	Dow Inc	陶氏公司	DOW UN	纽约证券交易所	美国	6,859	1,978,619.10	0.05

				所				
296	Keysight Technologies Inc	是德科技公司	KEYS UN	纽约证券交易所	美国	1,700	1,962,943.58	0.05
297	Hewlett Packard Enterprise Co	慧与公司	HPE UN	纽约证券交易所	美国	12,723	1,952,628.58	0.05
298	PPG Industries Inc	PPG 工业	PPG UN	纽约证券交易所	美国	2,273	1,951,721.41	0.05
299	GoDaddy Inc	GoDaddy 股份有限公司	GDDY UN	纽约证券交易所	美国	1,375	1,950,814.95	0.05
300	EQT Corp	EQT 公司	EQT UN	纽约证券交易所	美国	5,845	1,937,366.89	0.05
301	Nucor Corp	纽柯公司	NUE UN	纽约证券交易所	美国	2,300	1,929,603.78	0.05
302	Kraft Heinz Co/The	卡夫亨氏公司	KHC UW	纳斯达克证券交易所	美国	8,648	1,909,095.85	0.05
303	ON Semiconductor Corp	安森美半导体公司	ON UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,171	1,890,416.57	0.05
304	Smurfit WestRock PLC	Smurfit WestRock 公共有限公司	SW UN	纽约证券交易所	美国	4,841	1,874,276.53	0.05
305	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	1,145	1,860,883.03	0.05
306	Fortive Corp	福迪威公司	FTV UN	纽约证券交易所	美国	3,399	1,832,502.87	0.05

307	Carnival Corp	嘉年华公司	CCL UN	纽约证券交易所	美国	10,176	1,822,877.03	0.05
308	Mettler-Toledo International Inc	梅特勒-托利多国际股份有限公司	MTD UN	纽约证券交易所	美国	207	1,820,834.37	0.05
309	Dover Corp	都福	DOV UN	纽约证券交易所	美国	1,344	1,812,442.92	0.05
310	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	2,400	1,806,473.67	0.05
311	Synchrony Financial	同步金融公司	SYF UN	纽约证券交易所	美国	3,815	1,782,543.49	0.05
312	Veralto Corp	Veralto 公司	VLTO UN	纽约证券交易所	美国	2,423	1,773,971.68	0.05
313	T Rowe Price Group Inc	普徠仕	TROW UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,176	1,768,949.08	0.05
314	NVR Inc	NVR 股份有限公司	NVR UN	纽约证券交易所	美国	30	1,763,796.14	0.05
315	Hershey Co/The	好时公司	HSY UN	纽约证券交易所	美国	1,447	1,761,513.47	0.05
316	DTE Energy Co	DTE 能源	DTE UN	纽约证券交易所	美国	2,029	1,761,170.58	0.05
317	Ventas Inc	Ventas 公司	VTR UN	纽约证券交易所	美国	4,110	1,739,865.24	0.04
318	Tyler Technologies Inc	Tyler 科技公司	TYL UN	纽约证券交易所	美国	419	1,736,804.85	0.04
319	Equity Residen	公寓物业权益	EQR UN	纽约证 券交易	美国	3,345	1,725,483.41	0.04

	tial	信托		所				
320	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	1,909	1,708,333.40	0.04
321	Brown & Brown Inc	Brown & Brown 股份有限公司	BRO UN	纽约证券交易所	美国	2,325	1,705,063.32	0.04
322	Archer-Daniels-Midland Co	Archer-Daniels-Midland 公司	ADM UN	纽约证券交易所	美国	4,684	1,701,031.92	0.04
323	PPL Corp	PPL 公司	PPL UN	纽约证券交易所	美国	7,229	1,686,782.07	0.04
324	Halliburton Co	哈利伯顿	HAL UN	纽约证券交易所	美国	8,606	1,682,065.04	0.04
325	Ameren Corp	Ameren 公司	AEE UN	纽约证券交易所	美国	2,615	1,675,623.95	0.04
326	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	2,007	1,674,699.95	0.04
327	West Pharmaceutical Services Inc	西氏医药服务公司	WST UN	纽约证券交易所	美国	709	1,669,434.30	0.04
328	Huntington Bancshares 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	14,233	1,664,624.33	0.04
329	Warner Bros Discovery Inc	华纳兄弟探索股份有限公司	WBD UW	纳斯达克证券交易所	美国	21,870	1,661,712.96	0.04
330	Corpay Inc	Corpay 股份有限公司	CPAY UN	纽约证券交易所	美国	683	1,661,532.96	0.04

331	CDW Corp/DE	特拉华 CDW 公司	CDW UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,306	1,633,896.29	0.04
332	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	1,203	1,611,315.73	0.04
333	Hubbell Inc	哈贝尔公司	HUBB UN	纽约证券交易所	美国	526	1,583,864.31	0.04
334	Cincinnati Financial Corp	辛辛那提金融	CINF UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,532	1,582,514.76	0.04
335	PulteGroup Inc	Pulte 集团公司	PHM UN	纽约证券交易所	美国	2,009	1,572,678.87	0.04
336	Biogen Inc	渤健公司	BIIB UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,427	1,568,629.93	0.04
337	PTC Inc	PTC 公司	PTC UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,177	1,555,677.51	0.04
338	Waters Corp	沃特世公司	WAT UN	纽约证券交易所	美国	582	1,552,050.03	0.04
339	Darden Restaurants Inc	达登餐饮公司	DRI UN	纽约证券交易所	美国	1,151	1,544,644.76	0.04
340	SBA Communications Corp	SBA 通信公司	SBAC UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,054	1,544,105.70	0.04
341	Kellanova	Kellanova	K UN	纽约证券交易所	美国	2,634	1,533,105.87	0.04
342	Teledyne Technologies Inc	Teledyne 科技股份有限公司	TDY UN	纽约证券交易所	美国	457	1,524,712.91	0.04
343	Atmos Energy Corp	Atmos 能源公司	ATO UN	纽约证券交易所	美国	1,521	1,522,716.40	0.04

344	International Flavors & Fragrances Inc	国际香料	IFF UN	纽约证券交易所	美国	2,505	1,522,486.95	0.04
345	Devon Energy Corp	戴文能源	DVN UN	纽约证券交易所	美国	6,436	1,514,238.47	0.04
346	Regions Financial Corp	Regions 金融公司	RF UN	纽约证券交易所	美国	8,904	1,505,409.68	0.04
347	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	1,954	1,483,693.09	0.04
348	Eversource Energy	Eversource 能源公司	ES UN	纽约证券交易所	美国	3,590	1,482,059.03	0.04
349	Texas Pacific Land Corp	德克萨斯州太平洋土地公司	TPL UN	纽约证券交易所	美国	185	1,470,765.33	0.04
350	CenterPoint Energy Inc	中点能源	CNP UN	纽约证券交易所	美国	6,385	1,456,341.45	0.04
351	Western Digital Corp	西部数据公司	WDC UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,387	1,451,818.22	0.04
352	Teradyn Inc	泰瑞达	TER UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,596	1,444,640.67	0.04
353	Ulta Beauty Inc	Ulta 美容产品公司	ULTA UW	纳斯达克证券交易所	美国	462	1,444,420.28	0.04
354	Weyerhaeuser Co	惠好	WY UN	纽约证券交易所	美国	7,118	1,440,351.93	0.04
355	Cboe Global Markets Inc	Cboe 环球市场公司	CBOE UF	Cboe BZX 交易所	美国	1,025	1,439,728.69	0.04
356	FirstEnergy	第一能	FE UN	纽约证	美国	5,025	1,436,9	0.04

	rgy Corp	源		券交易所			21.62	
357	Live Nation Entertainment Inc	Live Nation 娱乐公司	LYV UN	纽约证券交易所	美国	1,537	1,430,789.92	0.04
358	Northern Trust Corp	北美信托	NTRS UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,941	1,430,150.15	0.04
359	STERIS PLC	思泰瑞医疗公共有限公司	STE UN	纽约证券交易所	美国	967	1,428,885.14	0.04
360	Southwest Airlines Co	西南航空	LUV UN	纽约证券交易所	美国	5,875	1,419,834.80	0.04
361	Clorox Co/The	高乐氏公司	CLX UN	纽约证券交易所	美国	1,212	1,414,971.27	0.04
362	Packaging Corp of America	美国包装公司	PKG UN	纽约证券交易所	美国	874	1,414,415.61	0.04
363	CMS Energy Corp	CMS 能源	CMS UN	纽约证券交易所	美国	2,927	1,402,345.78	0.04
364	Zebra Technologies Corp	斑马技术公司	ZBRA UW	纳斯达克证券交易所	美国	505	1,402,033.44	0.04
365	Lennox International Inc	雷诺士国际有限公司	LII UN	纽约证券交易所	美国	314	1,375,286.13	0.04
366	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	2,485	1,361,888.39	0.04
367	LyondellBasell Industries NV	利安德巴塞尔工业公司	LYB UN	纽约证券交易所	美国	2,545	1,358,730.88	0.03

368	Citizens Financial 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	4,318	1,358,289.01	0.03
369	Leidos Holdings Inc	Leidos 控股公司	LDOS UN	纽约证券交易所	美国	1,308	1,354,513.66	0.03
370	Labcorp Holdings Inc	Labcorp 控股股份有限公司	LH US	美国证券交易所	美国	820	1,351,723.99	0.03
371	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	1,049	1,328,960.91	0.03
372	Coterra Energy Inc	Coterra 能源股份有限公司	CTRA UN	纽约证券交易所	美国	7,216	1,324,797.97	0.03
373	International Paper Co	国际纸业	IP UN	纽约证券交易所	美国	3,404	1,316,938.46	0.03
374	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	630	1,292,669.84	0.03
375	Cooper Cos Inc/The	库柏股份有限公司	COO UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,951	1,289,278.57	0.03
376	Insulet Corp	Insulet 股份有限公司	PODD UW	纳斯达克证券交易所	美国	687	1,289,276.13	0.03
377	FactSet Research Systems Inc	FactSet 研究系统股份有限公司	FDS UN	纽约证券交易所	美国	373	1,287,761.89	0.03
378	NRG Energy Inc	NRG 能源股份有限公司	NRG UN	纽约证券交易所	美国	1,985	1,287,346.83	0.03
379	Seagate Technology	Seagate Technology 控	STX UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,072	1,285,532.63	0.03

	Holding s PLC	股公共 有限公司						
380	Invitatio n Homes Inc	邀请家 园公司	INVH UN	纽约证 券交易 所	美国	5,581	1,282,5 87.18	0.03
381	Mid-A merica Apartm ent Commu nities Inc	Mid-A merica Apartm ent Commu nities 股 份有限 公司	MAA UN	纽约证 券交易 所	美国	1,145	1,272,2 22.08	0.03
382	Las Vegas Sands Corp	拉斯维 加斯金 沙公司	LVS UN	纽约证 券交易 所	美国	3,410	1,258,9 59.12	0.03
383	Snap-on Inc	实耐宝	SNA UN	纽约证 券交易 所	美国	514	1,254,3 23.47	0.03
384	W R Berkley Corp	WR Berkley 公司	WRB UN	纽约证 券交易 所	美国	2,949	1,240,5 41.58	0.03
385	Estee Lauder Cos Inc/The	雅诗兰 黛	EL UN	纽约证 券交易 所	美国	2,287	1,232,6 61.51	0.03
386	Trimble Inc	天宝股 份有限 公司	TRMB UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,392	1,214,9 74.17	0.03
387	NiSourc e Inc	NiSourc e 公司	NI UN	纽约证 券交易 所	美国	4,573	1,208,3 95.06	0.03
388	VeriSig n Inc	威瑞信 股份有 限公司	VRSN UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	810	1,205,0 46.12	0.03
389	KeyCor p	KeyCor p 公司	KEY UN	纽约证 券交易 所	美国	9,711	1,196,4 84.31	0.03
390	Quest Diagnos tics Inc	Quest Diagnos tics 股	DGX UN	纽约证 券交易 所	美国	1,094	1,186,3 79.57	0.03

		份有限公司						
391	Omnico m Group Inc	Omnico m 集团	OMC UN	纽约证 券交易 所	美国	1,911	1,181,9 34.27	0.03
392	Fox Corp	福克斯 公司	FOX UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,293	425,135 .06	0.01
			FOXA UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,166	756,394 .21	0.02
393	Best Buy Co Inc	百思买	BBY UN	纽约证 券交易 所	美国	1,914	1,180,4 87.67	0.03
394	Hologic Inc	豪洛捷 公司	HOLX UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,276	1,179,4 49.96	0.03
395	Dollar General Corp	达乐公 司	DG UN	纽约证 券交易 所	美国	2,154	1,173,9 82.75	0.03
396	Molina Healthc are Inc	Molina Healthc are 股 份有 限公 司	MOH UN	纽约证 券交易 所	美国	560	1,171,6 22.94	0.03
397	Pentair PLC	Pentair 公共有 限公司	PNR UN	纽约证 券交易 所	美国	1,619	1,171,2 50.29	0.03
398	Jacobs Solution s Inc	嘉科解 决方案 股份有 限公司	J UN	纽约证 券交易 所	美国	1,217	1,168,9 45.55	0.03
399	Builders FirstSou rce Inc	Builders FirstSou rce 股 份有 限公 司	BLDR UN	纽约证 券交易 所	美国	1,128	1,158,9 50.08	0.03
400	Ball Corp	波尔	BALL UN	纽约证 券交易 所	美国	2,924	1,158,7 70.94	0.03
401	Tyson Foods Inc	泰森食 品公司	TSN UN	纽约证 券交易 所	美国	2,800	1,156,1 24.75	0.03

402	Principal Financial Group Inc	信安金融	PFG UN	纳斯达克证券交易所	美国	2,062	1,147,408.24	0.03
403	Jabil Inc	捷普集团	JBL UN	纽约证券交易所	美国	1,106	1,144,058.30	0.03
404	Genuine Parts Co	原配部件	GPC UN	纽约证券交易所	美国	1,362	1,143,150.55	0.03
405	Steel Dynamics Inc	Steel Dynamics 股份有限公司	STLD UN	纳斯达克证券交易所	美国	1,387	1,137,313.35	0.03
406	IDEX Corp	艺达思集团	IEX UN	纽约证券交易所	美国	742	1,116,309.50	0.03
407	Kimco Realty Corp	Kimco Realty Corp	KIM UN	纽约证券交易所	美国	6,604	1,112,273.50	0.03
408	Masco Corp	马斯可	MAS UN	纽约证券交易所	美国	2,113	1,102,272.20	0.03
409	Everest Group Ltd	Everest 集团有限公司	EG UN	纽约证券交易所	美国	421	1,096,918.64	0.03
410	Expeditors International of Washington Inc	华盛顿康捷国际物流公司	EXPD UN	纽约证券交易所	美国	1,371	1,091,671.18	0.03
411	Super Micro Computer Inc	Super Micro Computer 股份有限公司	SMCI UN	纳斯达克证券交易所	美国	4,933	1,080,832.30	0.03
412	Loews Corp	罗斯公司	L UN	纽约证券交易所	美国	1,771	1,078,159.29	0.03
413	Tapestry	TPR-D	TPR	纽约证	美国	2,283	1,072,1	0.03

	y Inc	RS-RS	UN	券交易所			38.29	
414	Alliant Energy Corp	Alliant 能源公司	LNT UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,514	1,068,756.65	0.03
415	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	1,524	1,068,672.11	0.03
416	Dollar Tree Inc	美元树公司	DLTR UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,980	1,066,623.42	0.03
417	Avery Dennison Corp	艾利丹尼森	AVY UN	纽约证券交易所	美国	787	1,058,645.08	0.03
418	Baxter International Inc	百特	BAX UN	纽约证券交易所	美国	5,002	1,048,487.95	0.03
419	Viartis Inc	晖致	VTRS UW	纳斯达克证券交易所	美国	11,694	1,046,561.31	0.03
420	Gen Digital Inc	Gen Digital 股份有限公司	GEN UW	纳斯达克证券交易所	美国	5,312	1,045,499.30	0.03
421	CF Industries Holdings Inc	CF 工业控股股份有限公司	CF UN	纽约证券交易所	美国	1,704	1,045,087.55	0.03
422	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	687	1,029,712.21	0.03
423	F5 Inc	F5 股份有限公司	FFIV UW	纳斯达克证券交易所	美国	569	1,028,562.49	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	338	1,019,882.14	0.03
425	Akamai Technologies	阿卡迈技术公司	AKAM UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,471	1,011,416.15	0.03

	Inc							
426	Aptiv PLC	安波福公共有限公司	APT UN	纽约证 券交易 所	美国	2,303	1,001,2 39.46	0.03
427	Textron Inc	德事隆	TXT UN	纽约证 券交易 所	美国	1,818	999,610 .42	0.03
428	Healthpeak Properties Inc	Healthpeak Properties Inc	DOC UN	纽约证 券交易 所	美国	6,853	998,542 .87	0.03
429	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	1,565	997,636 .34	0.03
430	Evergy Inc	Evergy 股份有限公司	EVRG UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,253	996,830 .88	0.03
431	Moderna Inc	莫德纳公司	MRNA UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,317	991,430 .31	0.03
432	News Corp	新闻集团	NWS UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,097	239,961 .08	0.01
			NWSA UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,712	734,859 .21	0.02
433	Amcor PLC	安姆科公司	AMCR UN	纽约证 券交易 所	美国	14,159	957,755 .03	0.02
434	JB Hunt Transport 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	780	956,882 .43	0.02
435	Revvity Inc	Revvity 股份有限公司	RVTY UN	纽约证 券交易 所	美国	1,192	956,338 .41	0.02
436	EPAM Systems Inc	EPAM 系统公司	EPAM UN	纽约证 券交易 所	美国	555	932,839 .39	0.02
437	Conagra Brands Inc	康尼格拉品牌股份有	CAG UN	纽约证 券交易 所	美国	4,675	932,560 .12	0.02

		限公司						
438	UDR Inc	UDR 公司	UDR UN	纽约证券交易所	美国	2,942	918,046.52	0.02
439	Rollins Inc	Rollins 公司	ROL UN	纽约证券交易所	美国	2,752	916,917.80	0.02
440	Pool Corp	Pool 公司	POOL UW	纳斯达克证券交易所	美国	373	914,153.28	0.02
441	Jack Henry & Associates Inc	Jack Henry & Associates 公司	JKHY UW	纳斯达克证券交易所	美国	715	900,990.46	0.02
442	CarMax Inc	CarMax 股份有限公司	KMX UN	纽约证券交易所	美国	1,518	892,164.40	0.02
443	Juniper Networks Inc	瞻博网络股份有限公司	JNPR UN	纽约证券交易所	美国	3,244	873,302.90	0.02
444	Camden Property Trust	Camden 房地产信托公司	CPT UN	纽约证券交易所	美国	1,046	872,512.47	0.02
445	Stanley Black & Decker Inc	史丹利百得公司	SWK UN	纽约证券交易所	美国	1,511	872,083.68	0.02
446	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	6,847	862,316.44	0.02
447	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	1,158	860,052.96	0.02
448	Regency Centers Corp	Regency Centers 公司	REG UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,600	850,301.46	0.02

449	J M Smucker Co/The	JM 斯马克公司	SJM UN	纽约证券交易所	美国	1,043	825,624.83	0.02
450	Dayforce Inc	Dayforce 股份有限公司	DAY UN	纽约证券交易所	美国	1,545	806,745.51	0.02
451	Bio-Techne Corp	Bio-techn 公司	TECH UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,557	806,184.16	0.02
452	Allegheny plc	安朗杰公共有限公司	ALLE UN	纽约证券交易所	美国	852	800,351.86	0.02
453	Nordson Corp	诺信公司	NDSN UW	纳斯达克证券交易所	美国	532	800,181.63	0.02
454	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	挪威邮轮控股有限公司	NCLH UN	纽约证券交易所	美国	4,308	796,797.05	0.02
455	Incyte Corp	因赛特公司	INCY UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,567	778,019.87	0.02
456	Assurant Inc	安信龙集团	AIZ UN	纽约证券交易所	美国	502	769,420.75	0.02
457	Bunge Global SA	Bunge Global SA	BG US	美国证券交易所	美国	1,368	764,670.94	0.02
458	BXP Inc	波士顿地产公司	BXP UN	纽约证券交易所	美国	1,425	761,704.43	0.02
459	Eastman Chemical Co	伊士曼化工	EMN UN	纽约证券交易所	美国	1,136	745,721.17	0.02
460	Universal Health Services Inc	Universal 保健服务股份有限公司	UHS UN	纽约证券交易所	美国	575	741,602.07	0.02
461	Interpub	Interpub	IPG UN	纽约证	美国	3,650	735,179	0.02

	lic Group of Cos Inc/The	lic 集团		券交易所			.23	
462	Erie Indemnity Co	伊利赔偿公司	ERIE UW	纳斯达克证券交易所	美国	244	723,038.89	0.02
463	Albema rle Corp	雅保公司	ALB UN	纽约证券交易所	美国	1,152	712,831.65	0.02
464	Molson Coors Beverag e Co	莫尔森库尔斯饮料公司	TAP UN	纽约证券交易所	美国	1,711	704,998.88	0.02
465	Paycom Softwar e Inc	Paycom 软件股份有限公司	PAYC UN	纽约证券交易所	美国	476	701,341.42	0.02
466	Pinnacle West Capital Corp	Pinnacle 西部资本	PNW UN	纽约证券交易所	美国	1,114	678,827.78	0.02
467	LKQ Corp	LKQ 公司	LKQ UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,547	672,850.41	0.02
468	Lamb Weston Holding s Inc	蓝威斯顿控股股份有限公司	LW UN	纽约证券交易所	美国	1,397	671,119.88	0.02
469	Charles River Laborat ories Internati onal 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	501	664,816.30	0.02
470	Globe Life Inc	Globe Life 股份有限公司	GL UN	纽约证券交易所	美国	823	659,758.25	0.02
471	Ralph Lauren Corp	拉夫劳伦	RL UN	纽约证券交易所	美国	394	654,188.39	0.02
472	Enphase Energy	Enphase 能源股	ENPH UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,324	653,657.89	0.02

	Inc	份有限公司		交易所				
473	Generac Holdings Inc	Generac 控股公司	GNRC UN	纽约证券交易所	美国	583	649,789.31	0.02
474	AES Corp/The	爱伊斯科公司	AES UN	纽约证券交易所	美国	6,966	644,457.46	0.02
475	Solventum Corp	Solventum 公司	SOLV UN	纽约证券交易所	美国	1,354	642,968.16	0.02
476	Hormel Foods Corp	荷美尔食品有限公司	HRL UN	纽约证券交易所	美国	2,847	641,998.81	0.02
477	Henry Schein Inc	亨利香恩公司	HSIC UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,221	607,370.92	0.02
478	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	749	602,751.29	0.02
479	APA Corp	APA	APA UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,625	601,678.07	0.02
480	Market Axess Holdings Inc	Market Axess 控股公司	MKTX UW	纳斯达克证券交易所	美国	370	601,200.40	0.02
481	Teleflex Inc	泰利福公司	TFX UN	纽约证券交易所	美国	455	582,123.10	0.01
482	The Campbell's Company	金宝汤公司	CPB UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,924	579,220.57	0.01
483	Match Group Inc	Match 集团股份有限公司	MTCH UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,460	578,426.11	0.01
484	A O Smith Corp	AO 史密斯公司	AOS UN	纽约证券交易所	美国	1,167	572,204.33	0.01

485	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	906	561,133 .40	0.01
486	Invesco Ltd	景顺有限公司	IVZ UN	纽约证券交易所	美国	4,403	553,251 .18	0.01
487	MGM Resorts International	美高梅国际酒店集团	MGM UN	纽约证券交易所	美国	2,217	552,206 .06	0.01
488	Mosaic Co/The	Mosaic 公司	MOS UN	纽约证券交易所	美国	3,112	549,861 .99	0.01
489	Celanese Corp	塞拉尼斯公司	CE UN	纽约证券交易所	美国	1,071	532,832 .31	0.01
490	Huntington Ingalls Industries Inc	Huntington Ingalls 工业公司	HII UN	纽约证券交易所	美国	384	521,622 .51	0.01
491	Hasbro Inc	孩之宝	HAS UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,285	516,445 .93	0.01
492	Caesars Entertainment Inc	凯撒娱乐集团	CZR UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,082	500,172 .03	0.01
493	BorgWarner Inc	博格华纳股份有限公司	BWA UN	纽约证券交易所	美国	2,142	489,488 .20	0.01
494	Brown-Forman Corp	百富门公司	BF/B UN	纽约证券交易所	美国	1,784	487,059 .53	0.01
495	DaVita Inc	DaVita 股份有限公司	DVA UN	纽约证券交易所	美国	442	475,161 .15	0.01
496	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	7,031	471,553 .50	0.01
497	Franklin Resources	富兰克林资源	BEN UN	纽约证券交易所	美国	3,074	448,351 .00	0.01

	es Inc			所				
498	Mohawk Industries Inc	Mohawk 工业股份有限公司	MHK UN	纽约证券交易所	美国	513	439,309.65	0.01
499	Paramount Global	派拉蒙全球	PARA UW	纳斯达克证券交易所	美国	5,828	438,211.19	0.01
500	FMC Corp	FMC 公司	FMC UN	纽约证券交易所	美国	1,223	427,350.60	0.01

注:本基金对以上证券代码采用当地市场代码。对基金持有的不同市场上市的同一公司合并计算净值占比, 分开列示。

8.4.1.2 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所有权益投资明细

无。

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位: 人民币

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	Apple Inc	AAPL UW	235,454,959.99	92.53
2	Microsoft Corp	MSFT UW	224,804,715.96	88.35
3	NVIDIA Corp	NVDA UW	207,591,661.57	81.58
4	Amazon.com Inc	AMZN UW	128,480,823.02	50.49
5	Alphabet Inc	GOOGL UW	69,922,031.15	27.48
		GOOG UW	57,794,594.31	22.71
6	Meta Platforms Inc	META UW	82,956,518.45	32.60
7	Berkshire Hathaway Inc	BRK/B UN	57,093,234.12	22.44
8	Broadcom Inc	AVGO UW	56,469,566.81	22.19
9	Tesla Inc	TSLA UW	53,902,021.60	21.18
10	Eli Lilly & Co	LLY UN	45,545,601.65	17.90
11	JPMorgan Chase & Co	JPM UN	43,257,616.75	17.00
12	Exxon Mobil Corp	XOM UN	36,799,130.15	14.46
13	Visa Inc	V UN	35,761,734.18	14.05
14	UnitedHealth	UNH UN	35,403,281.53	13.91

	Group Inc			
15	Mastercard Inc	MA UN	28,621,961.09	11.25
16	Procter & Gamble Co/The	PG UN	27,932,292.72	10.98
17	Home Depot Inc/The	HD UN	27,174,939.57	10.68
18	Costco Wholesale Corp	COST UW	27,088,003.09	10.65
19	Johnson & Johnson	JNJ UN	26,573,048.84	10.44
20	Walmart Inc	WMT UN	23,502,757.58	9.24
21	AbbVie Inc	ABBV UN	22,478,258.52	8.83
22	Netflix Inc	NFLX UW	22,338,140.80	8.78
23	Salesforce Inc	CRM UN	20,316,347.42	7.98
24	Merck & Co Inc	MRK UN	20,249,809.31	7.96
25	Bank of America Corp	BAC UN	19,608,667.95	7.71
26	Chevron Corp	CVX UN	18,334,265.47	7.21
27	Advanced Micro Devices Inc	AMD UW	17,760,704.72	6.98
28	Oracle Corp	ORCL UN	17,708,304.88	6.96
29	Coca-Cola Co/The	KO UN	17,590,720.30	6.91
30	Adobe Inc	ADBE UW	16,320,468.56	6.41
31	PepsiCo Inc	PEP UW	16,304,869.82	6.41
32	Accenture PLC	ACN UN	15,497,973.11	6.09
33	Wells Fargo & Co	WFC UN	15,247,297.59	5.99
34	Cisco Systems Inc	CSCO UW	15,192,911.04	5.97
35	Linde PLC	LIN UW	15,160,804.10	5.96
36	Thermo Fisher Scientific Inc	TMO UN	15,087,307.92	5.93
37	McDonald's Corp	MCD UN	14,690,767.20	5.77
38	Abbott Laboratories	ABT UN	13,948,535.51	5.48
39	Walt Disney Co/The	DIS UN	13,483,042.57	5.30
40	International Business Machines Corp	IBM UN	13,420,685.49	5.27
41	QUALCOMM	QCOM UW	13,310,634.76	5.23

	Inc			
42	ServiceNow Inc	NOW UN	13,263,324.44	5.21
43	General Electric Co	GE UN	12,999,359.77	5.11
44	Intuit Inc	INTU UW	12,764,854.48	5.02
45	Philip Morris International Inc	PM UN	12,643,425.92	4.97
46	Verizon Communications Inc	VZ UN	12,567,649.80	4.94
47	Caterpillar Inc	CAT UN	12,487,851.76	4.91
48	Texas Instruments Inc	TXN UW	12,438,623.05	4.89
49	Intuitive Surgical Inc	ISRG UW	11,975,766.52	4.71
50	Arista Networks Inc	ANET UN	11,525,324.04	4.53
51	Amgen Inc	AMGN UW	11,400,443.25	4.48
52	Danaher Corp	DHR UN	11,350,537.59	4.46
53	Comcast Corp	CMCSA UW	11,297,658.15	4.44
54	Goldman Sachs Group Inc/The	GS UN	11,222,487.23	4.41
55	Applied Materials Inc	AMAT UW	11,177,401.98	4.39
56	Pfizer Inc	PFE UN	11,101,488.83	4.36
57	S&P Global Inc	SPGI UN	10,828,916.81	4.26
58	Uber Technologies Inc	UBER UN	10,671,638.39	4.19
59	RTX Corp	RTX UN	10,630,031.21	4.18
60	NextEra Energy Inc	NEE UN	10,603,590.95	4.17
61	AT&T Inc	T UN	10,520,103.34	4.13
62	Union Pacific Corp	UNP UN	10,311,787.91	4.05
63	American Express Co	AXP UN	10,248,195.37	4.03
64	ConocoPhillips	COP UN	10,134,197.05	3.98
65	Booking Holdings Inc	BKNG UW	10,115,599.62	3.98
66	Lowe's Cos Inc	LOW UN	10,064,207.60	3.96
67	Honeywell International Inc	HON UW	9,901,472.29	3.89
68	Morgan Stanley	MS UN	9,768,650.16	3.84

69	Blackrock Inc	BLK UN	9,591,566.73	3.77
70	Progressive Corp/The	PGR UN	9,567,436.36	3.76
71	Eaton Corp PLC	ETN UN	9,143,546.70	3.59
72	TJX Cos Inc/The	TJX UN	9,010,434.76	3.54
73	Boeing Co/The	BA UN	8,959,041.08	3.52
74	Intel Corp	INTC UW	8,948,247.39	3.52
75	Stryker Corp	SYK UN	8,735,370.30	3.43
76	Citigroup Inc	C UN	8,601,213.26	3.38
77	Boston Scientific Corp	BSX UN	8,400,558.87	3.30
78	Vertex Pharmaceuticals Inc	VRTX UW	8,272,754.29	3.25
79	Micron Technology Inc	MU UW	8,226,308.86	3.23
80	Palo Alto Networks Inc	PANW UW	8,171,305.75	3.21
81	Automatic Data Processing Inc	ADP UW	7,908,918.88	3.11
82	Medtronic PLC	MDT UN	7,894,494.75	3.10
83	Blackstone Inc	BX UN	7,893,363.74	3.10
84	Prologis Inc	PLD UN	7,799,152.78	3.06
85	Lam Research Corp	LRCX UW	7,689,318.22	3.02
86	Charles Schwab Corp/The	SCHW UN	7,681,332.11	3.02
87	Analog Devices Inc	ADI UW	7,627,660.31	3.00
88	Lockheed Martin Corp	LMT UN	7,577,341.19	2.98
89	Elevance Health Inc	ELV UN	7,570,137.07	2.97
90	Bristol-Myers Squibb Co	BMJ UN	7,529,292.62	2.96
91	Marsh & McLennan Cos Inc	MMC UN	7,523,500.86	2.96
92	Chubb Ltd	CB UN	7,489,958.93	2.94
93	Starbucks Corp	SBUX UW	7,442,939.86	2.92
94	Fiserv Inc	FI UN	7,381,438.82	2.90
95	Deere & Co	DE UN	7,375,354.21	2.90
96	Chipotle	CMG UN	7,347,175.12	2.89

	Mexican Grill Inc			
97	Gilead Sciences Inc	GILD UW	7,341,728.52	2.89
98	Palantir Technologies Inc	PLTR UN	4,760,870.69	1.87
		PLTR UW	2,427,028.86	0.95
99	United Parcel Service Inc	UPS UN	7,168,509.90	2.82
100	NIKE Inc	NKE UN	7,144,696.72	2.81
101	T-Mobile US Inc	TMUS UW	7,142,213.91	2.81
102	Regeneron Pharmaceuticals Inc	REGN UW	6,799,741.49	2.67
103	American Tower Corp	AMT UN	6,778,984.68	2.66
104	KLA Corp	KLAC UW	6,610,214.66	2.60
105	Cigna Group/The	CI UN	6,499,361.19	2.55
106	Mondelez International Inc	MDLZ UW	6,499,008.00	2.55
107	Southern Co/The	SO UN	6,389,646.82	2.51
108	Cintas Corp	CTAS UW	6,301,672.00	2.48
109	Amphenol Corp	APH UN	6,277,345.89	2.47
110	KKR & Co Inc	KKR UN	6,174,935.31	2.43
111	Intercontinental Exchange Inc	ICE UN	6,073,196.92	2.39
112	Altria Group Inc	MO UN	5,968,371.49	2.35
113	Equinix Inc	EQIX UW	5,959,966.31	2.34
114	Synopsys Inc	SNPS UW	5,928,208.88	2.33
115	Duke Energy Corp	DUK UN	5,889,159.02	2.31
116	Cadence Design Systems Inc	CDNS UW	5,758,624.47	2.26
117	CME Group Inc	CME UW	5,756,195.31	2.26
118	Sherwin-Williams Co/The	SHW UN	5,743,923.45	2.26
119	Zoetis Inc	ZTS UN	5,723,819.12	2.25
120	CrowdStrike Holdings Inc	CRWD UW	5,679,642.83	2.23
121	Trane Technologies PLC	TT UN	5,656,224.21	2.22
122	Parker-Hannifin Corp	PH UN	5,496,311.43	2.16

123	CVS Health Corp	CVS UN	5,468,020.98	2.15
124	Waste Management Inc	WM UN	5,454,637.41	2.14
125	Colgate-Palmolive Co	CL UN	5,437,948.97	2.14
126	Apollo Global Management Inc	APO UN	5,389,498.09	2.12
127	PayPal Holdings Inc	PYPL UW	5,388,724.18	2.12
128	Aon PLC	AON UN	5,253,836.11	2.06
129	General Dynamics Corp	GD UN	5,214,713.18	2.05
130	US Bancorp	USB UN	5,138,042.92	2.02

注：1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。对基金持有的不同市场上市的同一公司合并计算净值占比，分开列示。

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。

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

金额单位：人民币

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	Microsoft Corp	MSFT UW	21,525,557.05	8.46
2	Apple Inc	AAPL UW	18,264,246.86	7.18
3	NVIDIA Corp	NVDA UW	15,305,818.03	6.02
4	Alphabet Inc	GOOGL UW	6,520,930.63	2.56
		GOOG UW	5,925,519.84	2.33
5	Amazon.com Inc	AMZN UW	11,295,649.75	4.44
6	Meta Platforms Inc	META UW	7,619,182.92	2.99
7	Arista Networks Inc	ANET UN	5,389,902.72	2.12
8	Berkshire Hathaway Inc	BRK/B UN	5,121,525.29	2.01
9	Broadcom Inc	AVGO UW	4,846,012.46	1.90
10	Exxon Mobil Corp	XOM UN	4,589,994.25	1.80
11	Eli Lilly & Co	LLY UN	4,411,274.57	1.73
12	JPMorgan Chase & Co	JPM UN	3,919,763.51	1.54
13	Tesla Inc	TSLA UW	3,270,761.81	1.29

14	UnitedHealth Group Inc	UNH UN	3,189,416.39	1.25
15	Visa Inc	V UN	3,106,762.09	1.22
16	Mastercard Inc	MA UN	2,661,550.95	1.05
17	Procter & Gamble Co/The	PG UN	2,616,018.88	1.03
18	Johnson & Johnson	JNJ UN	2,583,732.74	1.02
19	Home Depot Inc/The	HD UN	2,473,366.45	0.97
20	Costco Wholesale Corp	COST UW	2,266,036.98	0.89

注:1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。对基金持有的不同市场上上市的同一公司合并计算净值占比, 分开列示。

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。

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位: 人民币元

买入成本(成交)总额	3,405,848,304.87
卖出收入(成交)总额	329,703,763.23

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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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	占基金资产净值
----	-------	-------	---------	---------

			币元)	比例 (%)
1	期货	ES2503	-11,007,183.59	-0.28

注：金融衍生品投资项下的期货投资，在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则金融衍生品投资项下的期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间相抵销后的净额为 0，因此此处的公允价值实为公允价值变动。

8.10 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

无。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

8.11.2 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（如有）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。

8.11.3 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	28,445,821.47
2	应收清算款	60,844.15
3	应收股利	1,754,233.12
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,260,898.74

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

无。

8.11.5.2 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

无。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
26,860	95,001.27	1,050,333,875.00	41.16%	1,501,400,125.00	58.84%

9.2 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	上海浦东发展银行股份有限公司一兴证全球积极配置混合型基金中基金 (FOF-LOF)	120,165,000.00	4.71%
2	杨巧伟	98,872,800.00	3.87%
3	BARCLAYS BANK PLC	64,058,058.00	2.51%
4	西南证券股份有限公司	58,629,600.00	2.30%
5	中国民生银行股份有限公司一兴证全球优选平衡三个月持有期混合型基金中基金 (FOF)	49,214,200.00	1.93%
6	黄秋元	44,401,700.00	1.74%
7	上海东证期货一工商银行一东证期货工银慧享二号集合资产管理计划	34,864,600.00	1.37%
8	中国工商银行股份有限公司一兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金 (FOF)	22,994,500.00	0.90%
9	张保根	22,381,400.00	0.88%
10	吕建东	22,286,200.00	0.87%

9.3 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。

9.4 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。

9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间（万份）
李佳亮	公募基金	>100
	私募资产管理计划	0
	合计	>100

§ 10 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
本报告期期初基金份额总额	207,734,000.00
本报告期基金总申购份额	2,626,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	282,000,000.00
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	2,551,734,000.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金无基金份额持有人大会决议。

11.2 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

2024年9月21日，本基金管理人发布了《南方基金管理股份有限公司关于高级管理人员变更的公告》，杨小松先生任公司首席信息官，俞文宏先生任公司董事会秘书，陈莉女士任公司副总经理，孙鲁闽先生任公司副总经理，侯利鹏先生任公司副总经理，茅炜先生任公司副总经理，常克川先生不再担任公司副总经理、首席信息官、董事会秘书，朱运东先生不再担任公司副总经理，史博先生不再担任公司副总经理。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 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业务的诉讼事项。

本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金的审计事务所由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）改聘为容诚会计师事务所（特殊普通合伙），该变更事项已由南方基金管理股份有限公司董事会审议通过，并已按照相关规定及基金合同约定通知基金托管人；

目前容诚会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 1 年，本报告期应支付给容诚会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 60,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人、个别高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2024-12-13
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会深圳监管局
受到的具体措施类型	警示函、监管谈话
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定与制度执行不到位
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已完成整改
其他	—

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
CLSA	-	1,862,058,350.42	49.91%	186,212.08	41.11%	-

Limited						
CITI Group Global Markets Asia Limited	-	1,597,604,685.63	42.82%	239,630.54	52.91%	-
Susquehanna Financial Group, LLLP	-	271,120,696.33	7.27%	27,094.97	5.98%	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-

注：根据 2024 年 7 月 1 日起施行的《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（证监会公告〔2024〕3 号），基金管理人制定了证券公司交易单元的选择标准和程序：

1、选择标准

基金管理人建立了选择机制，选择财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易，并制定了定性与定量相结合的具体标准。

2、选择程序

(1) 基金管理人根据上述标准对证券公司进行评估，与符合标准的证券公司签订交易单元租用协议后将其入库，并对入库的证券公司开展动态管理，定期检视其是否持续符合选择标准；

(2) 基金管理人根据其建立的服务评价及交易量分配机制，定期对证券公司开展评价后，根据评价结果进行交易量的分配。

3、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：方正证券、国联证券；减少交易单元：无。

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

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
CLSA Limited	-	-	-	-	-	-
CITI Group	-	-	-	-	-	-

Global Markets Asia Limited						
Susquehanna Financial Group, LLLP	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	南方基金管理股份有限公司旗下部分ETF增加中原证券为一级交易商的公告	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	2024-01-18
2	南方基金管理股份有限公司旗下部分ETF增加财达证券为一级交易商的公告	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	2024-01-25
3	南方基金管理股份有限公司旗下部分ETF增加山西证券为一级交易商的公告	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	2024-02-01
4	南方基金管理股份有限公司关于旗下部分基金调整申购赎回相关规则的公告	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	2024-02-08
5	南方基金管理股份有限公司旗下部分ETF增加西南证券为一级交易商的公告	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	2024-02-26
6	南方基金管理股份有限公司旗下部分ETF增加东海证券为一级交易商的公告	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	2024-03-01
7	南方基金管理股份有限公司旗下部分ETF增加联储证券为一级交易商的公告	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	2024-03-13
8	南方基金管理股份有限公司旗下部分ETF增加渤海证券为一级交易商的公告	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	2024-03-15
9	南方基金管理股份有限公司旗下部分ETF增加民生证券为一级交易商的公告	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	2024-04-24

10	南方基金管理股份有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	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	2024-06-20
11	南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 增加一级交易商的公告	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	2024-07-08
12	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加东方财富证券为一级交易商的公告	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	2024-08-01
13	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加光大证券为一级交易商的公告	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	2024-08-20
14	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加东吴证券为一级交易商的公告	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	2024-08-21
15	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加财通证券为一级交易商的公告	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	2024-08-28
16	南方基金管理股份有限公司关于高级管理人员变更的公告	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	2024-09-21
17	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加国海证券为一级交易商的公告	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	2024-09-24
18	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加国联证券为一级交易商的公告	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	2024-10-28
19	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加长江证券为一级交易商的公告	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	2024-10-28
20	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加华西证券为一级交易商的公告	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	2024-11-01
21	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所公告	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	2024-11-02
22	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加国新证券为一级交易商的公告	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	2024-12-12
23	南方基金管理股份有限公司关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 二级市场交易价格溢价风险提示公告	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	2024-12-19
24	南方基金管理股份有限公司关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 二级	中国证券报、基金管理人网站、中国证监	2024-12-20

	市场交易价格溢价风险提示公告	会基金电子披露网站	
25	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加万和证券为一级交易商的公告	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	2024-12-23
26	南方基金管理股份有限公司关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 二级市场交易价格溢价风险提示公告	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	2024-12-23
27	南方基金管理股份有限公司关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 二级市场交易价格溢价风险提示公告	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	2024-12-24
28	南方基金管理股份有限公司关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 二级市场交易价格溢价风险提示公告	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	2024-12-24
29	南方基金管理股份有限公司关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 午间收盘二级市场交易价格溢价风险提示公告	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	2024-12-25
30	关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 2025 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	2024-12-26
31	南方基金管理股份有限公司关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 午间收盘二级市场交易价格溢价风险提示公告	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	2024-12-26
32	南方基金管理股份有限公司关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 午间收盘二级市场交易价格溢价风险提示公告	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	2024-12-27
33	南方基金管理股份有限公司关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 午间收盘二级市场交易价格溢价风险提示公告	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	2024-12-30
34	南方基金管理股份有限公司关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 午间收盘二级市场交易价格溢价风险提示公告	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	2024-12-31

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20240101- 20240123	56,050,300.00	-	56,050,000.00	300.00	0.00%
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。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 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) 2024 年年度报告》原文。

13.2 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。

13.3 查阅方式

网站: <http://www.nffund.com>