

嘉实全球价值机会股票型证券投资基金
(QDII)
2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 03 月 24 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 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	15
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	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（基金净值）变动表.....	21

7.4 报表附注.....	24
§8 投资组合报告	55
8.1 期末基金资产组合情况.....	55
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	55
8.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	56
8.4 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.....	56
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	102
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	104
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.....	105
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	105
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.....	105
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.....	105
8.11 投资组合报告附注.....	106
§9 基金份额持有人信息.....	107
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	107
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	107
9.3 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.....	108
9.4 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.....	108
§10 开放式基金份额变动.....	108
§11 重大事件揭示.....	109
11.1 基金份额持有人大会决议.....	109
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.....	109
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	109
11.4 基金投资策略的改变.....	109
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	109
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.....	109
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	110
11.8 其他重大事件.....	114
§12 备查文件目录.....	115
12.1 备查文件目录.....	115
12.2 存放地点.....	116
12.3 查阅方式.....	116

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）	
基金简称	嘉实全球价值股票（QDII）	
基金主代码	013328	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 11 月 23 日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	188,725,646.04 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实全球价值股票（QDII）人民币	嘉实全球价值股票（QDII）美元现汇
下属分级基金的交易代码	013328	013329
报告期末下属分级基金的份额总额	188,279,860.18 份	445,785.86 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于全球市场中具备价值投资机会的股票，在股票选择及组合构建方面均运用基本面系统化投资方法并结合风险管理手段，力争获取长期资本增值。
投资策略	在正常的市场条件下，本基金将在基金合同以及法律法规所允许的投资范围内，最大程度的持有股票类资产。当基金经理认为足够审慎时，本基金亦可以将小部分资产配置于债券类和现金类等大类资产上。具体包括：资产配置策略、股票投资策略、固定收益投资策略、衍生品投资策略。
业绩比较基准	MSCI 全球指数 (MSCI All Country World Index) 收益率×75%+沪深 300 指数收益率×20%+境内银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金产品，预期风险和收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金投资境外市场，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、国家/地区风险等境外投资面临的特有风险。

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		嘉实基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	胡勇钦	秦一楠
	联系电话	(010)65215588	010-66060069
	电子邮箱	service@jsfund.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-600-8800	95599
传真		(010)65215588	010-68121816

注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 1806A 单元	北京东城区建国门内大街 69 号
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100005	100031
法定代表人	经雷	谷澍

2.4 境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	JPMorgan Chase Bank, National Association
	中文	摩根大通银行
注册地址		1111 Polaris Parkway, Columbus, OH 43240, U. S. A.
办公地址		270 Park Avenue, New York, New York 10017
邮政编码		10017

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.jsfund.cn
基金年度报告备置地点	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城东三办公楼 16 层
注册登记机构	嘉实基金管理有限公司	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层

§ 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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2022 年 1 月 1 日-2022 年 12 月 31 日）		2021 年 11 月 23 日（基金合同生效日）-2021 年 12 月 31 日	
	嘉实全球价值股票（QDII）人民币	嘉实全球价值股票（QDII）美元现汇	嘉实全球价值股票（QDII）人民币	嘉实全球价值股票（QDII）美元现汇
本期已实现收益	-27,755,809.47	-297,002.69	-1,091,938.32	-8,249.63
本期利润	-32,580,044.67	-332,023.56	-1,943,968.65	-14,686.71
加权平均基金份额本期利润	-0.1555	-0.9825	-0.0082	-0.0522

本期加权平均净利润率	-17.45%	-17.33%	-0.82%	-0.82%
本期基金份额净值增长率	-14.78%	-21.94%	-0.82%	-0.55%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末		2021 年末	
期末可供分配利润	-29,137,654.80	-441,273.95	-1,943,968.65	-14,686.71
期末可供分配基金份额利润	-0.1548	-0.9899	-0.0082	-0.0522
期末基金资产净值	159,142,205.38	2,410,339.23	236,014,369.08	1,783,098.35
期末基金份额净值	0.8452	0.7763	0.9918	0.9945s
3.1.3 累计期末指标	2022 年末		2021 年末	
基金份额累计净值增长率	-15.48%	-22.37%	-0.82%	-0.55%

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用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。

（2）上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

（4）嘉实全球价值股票(QDII)美元现汇的期末基金份额净值单位为美元。

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

嘉实全球价值股票（QDII）人民币

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	2.32%	0.96%	7.51%	0.91%	-5.19%	0.05%
过去六个月	-0.77%	0.91%	-1.59%	0.85%	0.82%	0.06%
过去一年	-14.78%	1.02%	-18.82%	0.97%	4.04%	0.05%
自基金合同生效起至今	-15.48%	0.97%	-18.36%	0.94%	2.88%	0.03%

嘉实全球价值股票（QDII）美元现汇

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	4.30%	0.91%	7.51%	0.91%	-3.21%	0.00%
过去六个月	-4.31%	0.89%	-1.59%	0.85%	-2.72%	0.04%
过去一年	-21.94%	1.02%	-18.82%	0.97%	-3.12%	0.05%
自基金合同生效 起至今	-22.37%	0.97%	-18.36%	0.94%	-4.01%	0.03%

注：本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

$$\text{Return}(t) = 75\% * (\text{MSCI 全球指数}(t) / \text{MSCI 全球指数}(t-1) - 1) + 20\% * (\text{沪深 300 指数}(t) / \text{沪深 300 指数}(t-1) - 1) + 5\% * ((1 + \text{境内银行活期存款税后利率})^{1/365} - 1)$$

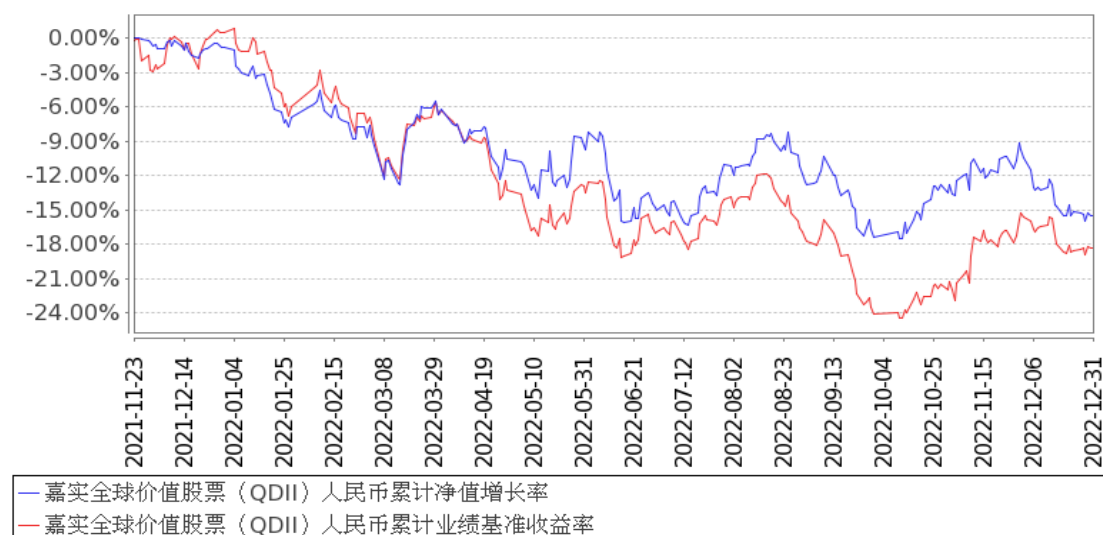
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

其中， $t = 1, 2, 3, \dots, T$ ， T 表示时间截至日。

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

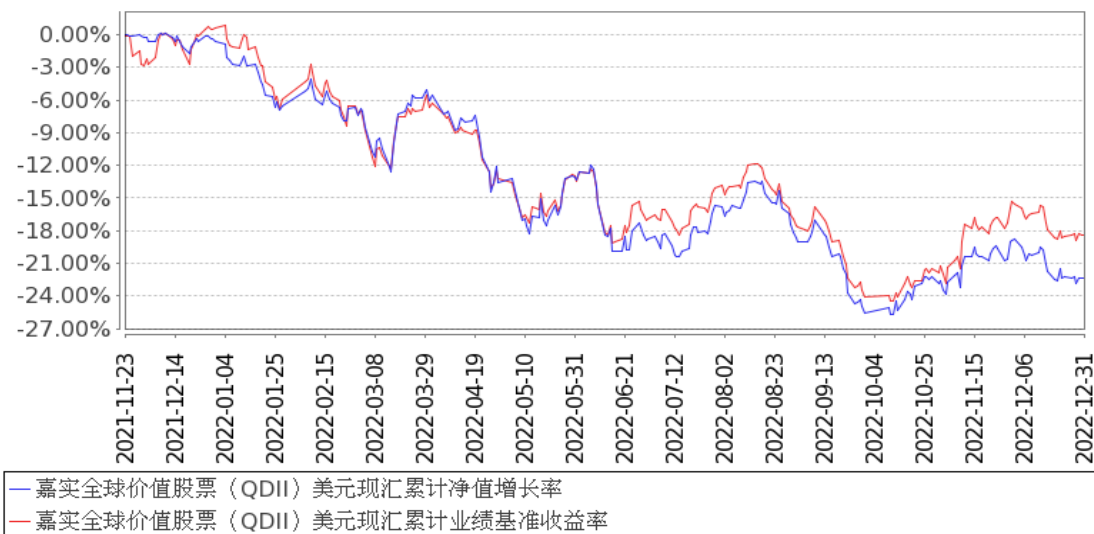
嘉实全球价值股票（QDII）人民币累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2021年11月23日至2022年12月31日）



嘉实全球价值股票（QDII）美元现汇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

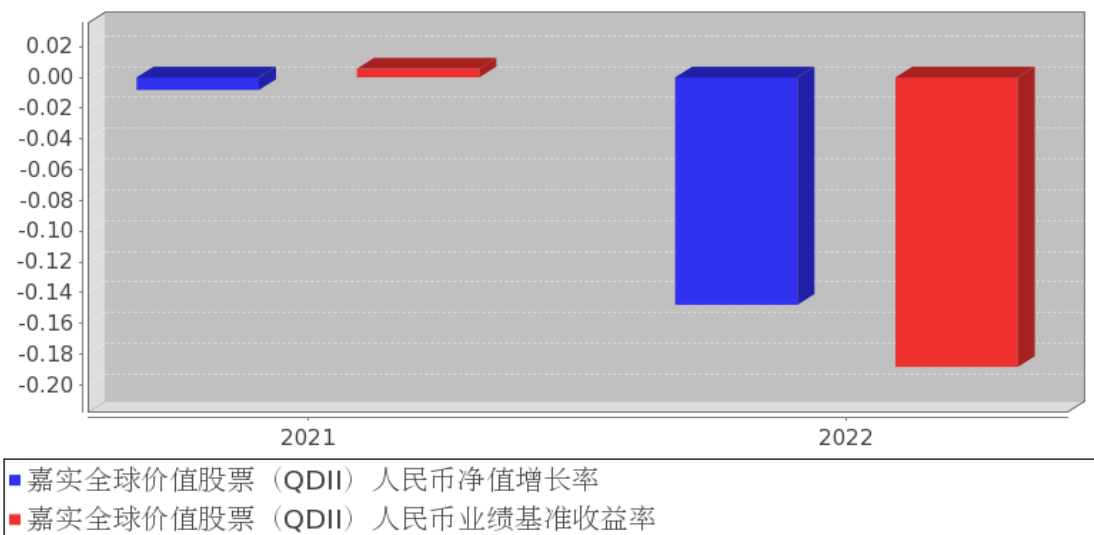
（2021年11月23日至2022年12月31日）



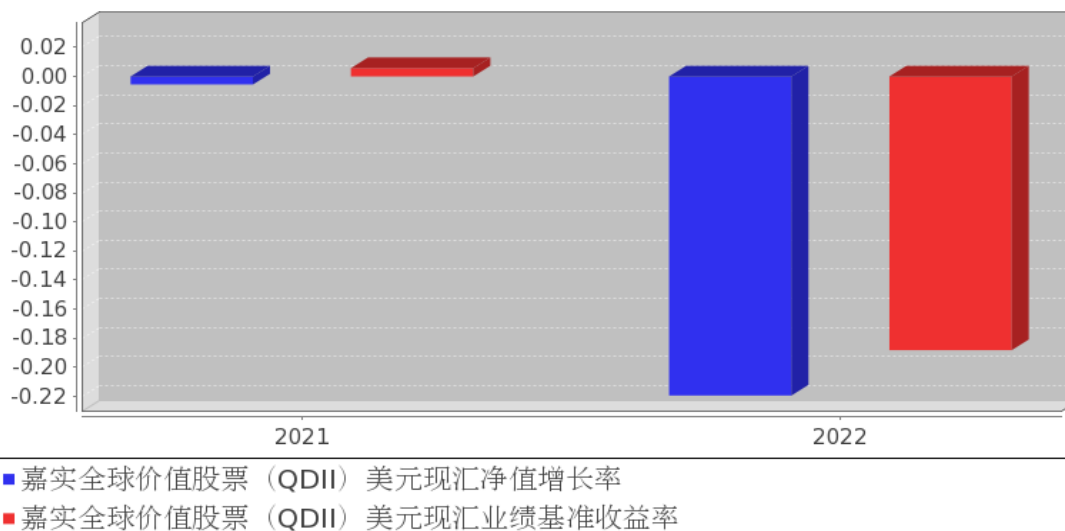
注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

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

嘉实全球价值股票（QDII）人民币基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



嘉实全球价值股票（QDII）美元现汇基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：上述数据根据基金当年实际存续期计算。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 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

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5号文批准，于1999年3月25日成立，是中国第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，总部设在北京并设北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII和特定资产管理业务等资格。

截止2022年12月31日，基金管理人共管理298只开放式证券投资基金，覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF等不同类别。同时，还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张自	本基金、	2021年	-	26年	曾任美国世纪投资管理公司（American

力	嘉实美国成长股票（QDII）、嘉实事件驱动股票基金经理	11 月 23 日			Century Investments）资深副总经理，研究部总监暨基金经理，负责直接管理、支持公司旗下近二百亿美元的多项大型公募基金和对冲基金类产品。2012 年 2 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任定量投资部负责人，现任人工智能投资部负责人。博士研究生，毕业于美国德州大学奥斯汀分校和中国科学技术大学，具有基金从业资格。美国国籍。
---	-----------------------------	-----------	--	--	--

注：（1）首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，此后的非首任基金经理的“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期。

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）基金合同》和其他相关法律法规的规定，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。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节应当符合公平交易的监管要求，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司严格执行《公平交易管理制度》，各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，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，合计 17 次，其中 1 次为旗下组合被动跟踪模拟组合权重配置需要与其他组合发生反向交易，另 16 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年，在报告期内，本组合面向产品基准的目标比例完成各类资产配置，并保持相关的资产配置处于稳定水平。本组合面向全球资本市场投资，根据投资基准定义，底层资产上美股配置约达到 60%，境内资产要求至少达到 20%，并在欧股日股港股等发达市场以及新兴市场如印度、巴西等进行配置。

报告期内，全球较为重大的经济和市场事件，为美联储较为坚定的持续加息，而俄乌冲突等国际局势的变化，以及欧佩克在增产上的态度等，导致上游大宗商品价格的波动，年末及 2023 年伊始随着美联储加息减缓预期的抬头，包括黄金价格、资本市场估值等都有逐步的上行。

就美股而言，2022 年全年收益为负，其中价值风格显著占优，罗素 1000 价值跌幅在 10%以内，而纳指则达到-33%左右水平，成长风格、科技板块在市场整体下行过程中进一步大幅跑输价值风格，收到加息对估值收缩的显著影响。接近年末，随着美国通胀的逐步走平和向下，联储高强度加息的预测概率逐渐降低，科技板块在 2022 年末达到当年的最低位置。

就 A 股而言，市场在全年整体呈现较大的回调，主要大盘估值如沪深 300，中小盘中证 500 和中证 1000 等，跌幅都在 20%以上，创业板指跌幅逼近 30%。A 股资本市场也同样在一定程度上收到全球资本市场利率提升的影响，包括权益资产估值回调、外汇币值波动以及部分债券的冲击

波动。就 A 股而言，更加收到国内经济增速放缓的影响，在年内，疫情的几次扩散，带来部分地区的经济生产和生活消费的减缓，对企业盈利的预期、资本市场信心和博弈方向，都带来很强的影响。国家对新能源、高新科技等领域的支持，在年内也推动了几次主题式市场趋势，几次局部地区的抗疫成功和生产恢复，也在当期催生了短期的市场情绪。在 2022 年末，随着国内抗击新冠疫情战役的最终胜利和各项约束的解除，经济逐步恢复活力，在四季度中开始，各类消费板块首先启动上行。

欧股以及发达市场部分，本组合继续侧重于在传统发达国家各自的优势产业上进行配置，实现在全球范围内覆盖各地的强势优势行业。如大工业制造领域内的德国汽车、德国法国的电气化与半导体，以及环保制造业、工业配套服务，日本的精细工业如光学等。在消费领域，作为全球奢侈品领导者，法国多个顶级奢侈品集团的盈利能力在疫情期间反而高歌猛进。金融板块内，银行有较好的估值投资机会，金融服务与咨询是国内尚未发展成熟的行业。本报告期内，已在包括以德法为主的欧洲部分，以及欧洲外的英国、加拿大、澳大利亚、瑞士、日本等国建立部分头寸。报告期内，欧洲军事行动持续对欧洲资本市场产生冲击，相关的能源、自然矿产资源、基础化工产品的贸易中断进一步对欧洲各国产生影响，德国 DAX、法国 CAC 等指数在 2、3 月份都经历了较深的回撤，并在二季度内表现疲软，在三季度末期开始反弹。

新兴市场部分，本组合紧密跟踪全球疫情控制进展、产业链恢复、资源商品价格趋势以及美联储收紧货币对新兴市场国家的影响，优化新兴市场头寸结构，本报告期内也完成对港股布局。在 H 股内，本组合贯彻“价值机会”的两层逻辑，对在 A-H 两地上市的部分优选企业而言，H 股的估值更具吸引力，契合价值投资理念，对在 H 股有而 A 股没有的部分优选互联网和消费股标的，符合投资机会覆盖的理念。本组合目前未进入俄罗斯和乌克兰资本市场，不持有与俄乌冲突相关的上市公司股票。

投资业绩上，本基金纯股票头寸相对业绩基准取得了正超额收益，受仓位水平、较高的交易成本和换汇成本的影响，组合净值层面的收益略有减损。

本基金以全球权益类资产为投资方向，核心两个高配置权重的经济体为美国和中国，这是全球经济从产业链位置、市场体量到技术水平在目前及未来一段时间内的核心部分，尤其在科技、生物医药等创新突破更强的领域，中美两国已经在全球占据优势，是本组合认为在投资价值与机会较好的方向。

本报告期间，运作主要包括各类资产头寸的有效配置、各国别内的选股和组合层面的风险控制。由于投资的资本市场涉及全球不同国家不同体制，本基金资金运作流程较长，单向包括从人民币申购、确认、换汇和掉汇等一系列步骤，涉及国内外券商和银行的多个环节，后续在市场大

幅震荡背景下，申赎的不确定性会直接影响仓位水平并影响投资业绩，本基金将按合约要求保持 90%权益资产配置、5%现金投资配置、20%的境内资产投资配置的合规约束，本报告期内实现了流动性的稳健管理。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实全球价值股票（QDII）人民币基金份额净值为 0.8452 元，本报告期基金份额净值增长率为-14.78%；截至本报告期末嘉实全球价值股票（QDII）美元现汇基金份额净值为 0.7763 美元，本报告期基金份额净值增长率为-21.94%；业绩比较基准收益率为-18.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为，站在当前时点，针对本基金参考基准给出的大类资产配置指引，权益类资产迎来较好的配置机会。随着美国通胀问题的逐步减缓，以及美国经济衰退的概率逐步显现，美联储已经开始放轻加息步伐，当利率提升的预期升高，以致年内加息节奏停止或出现对降息的投资心理，资本市场的受压制的估值空间将再次打开。在此宏观背景下，我们使用企业盈利增速进一步对静态企业估值水平进行修正，以更精细的企业价值测算方式，挖掘个股投资机会。

如我们前次预测，在美国宏观经济层面，其国内通胀指标退居经济衰退之后的第二位，将对美联储加息等各项政策产生影响，进而需要重新审视投资逻辑和方向。就美国经济自身而言，当前美国非政府部门资产负债表状况相对较为健康，至少不会面临较大的债务危机风险，大概率不会出现类似 2008 年金融危机的深度衰退，因此在当前“经济增长放缓，未进入衰退，衰退不会产生严重经济危机”的大背景下，当美联储政策完成既定目标之后，如通胀出现显著拐点、且联邦基金利率有效超过中性利率时，联储的货币政策同时也达到退坡甚至转向的话，那么市场则可以进入增长放缓且政策宽松的交易逻辑，权益类资产是较好的配置选择，其中的结构将更倾向于在业绩与估值两方面具有投资价值的标的。

相对美股而言，国内疫情约束已结束，进入了拼经济的窗口期，有更强烈的政策意愿与条件。对欧股、日股等发达资本市场，本组合侧重于在传统发达国家各自的优势产业上进行配置，实现在全球范围内覆盖各地的强势优势行业。对新兴市场部分，本组合将在监控全球产业链恢复、资源商品价格趋势以及美联储货币政策动向对新兴市场国家的影响后再积极调整新兴市场头寸和结构。在 H 股内，本组合贯彻“价值+机会”的两层逻辑。

后续，我们将根据合同要求，坚持量化框架的纪律化操作，并积极调整和优化模型，控制风险，希望取得更好的投资效果，回馈投资者。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人有关监察稽核工作情况如下：

(1) 继续内控前置。在基金营销、投资管理、信息披露以及新产品设计开发、海外业务、另类业务、制度建设、合同管理、法律咨询等方面，事前进行合规性审核、监控。全力支持创新业务，包括新产品新业务，产品生命周期支持也包括从战略规划到具体产品方案、业务模式、制度流程。在制度流程、投资范围、投资工具、运作规则等方面，防控重大风险。

(2) 全流程动态开展投资交易监督。一是事前防范，主要从事前研讨，合规风险识别、评估和分析，IT 事前设置，建立禁限库，合规培训、承诺书等方面开展；二是事中实时监控，如实时回答组合经理、交易员投资交易事项，盘中交易审批，盘中实时监控等；三是事后检查及改进，如检查投资交易合规情况，对异常行为进行提示、处理建议并督促改正。

(3) 按计划对销售、投资、后台和其它业务开展内部稽核，完成相应内审报告及其后续改进跟踪。完成公司及基金的外审、公司 GIPS 第三方验证、ISAE3402 国际鉴证等。

(4) 基金法务工作。包括合同、协议审查，主动解决各项法律文件以及实务运作中存在的差错和风险隐患，重点防控新增产品、新增业务以及日常业务的法律风险问题。

(5) 加强差错管理。继续推动各业务单元梳理流程、制度，落实风险责任授权体系，确保所有识别的关键风险点均有相应措施控制。

此外，我们还积极配合监管，按时完成合规报告和各项统计报表以及专题报告。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括基金投资市场的各证券交易所以及境内相关机构等。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 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**

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—嘉实基金管理有限公司 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，嘉实基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，嘉实基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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	安永华明（2023）审字第 60468756_A80 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	嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

	我们认为，后附的嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。
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，我们独立于嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII），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	无
其他事项	无
其他信息	<p>嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）管理层对其他信息负责。其他信息包括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。</p> <p>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。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>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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，管理层负责评估嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）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</p>

	<p>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，就可能对导致对嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）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嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	孙静习 马剑英
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
审计报告日期	2023年3月27日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）

报告截止日：2022年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	6,236,716.10	73,730,899.83
结算备付金		614,790.79	57,938,421.71
存出保证金		337,715.97	384,775.71
交易性金融资产	7.4.7.2	159,360,436.37	106,146,325.66
其中：股票投资		146,469,030.63	101,785,594.19
基金投资		2,869,247.52	2,860,431.47
债券投资		10,022,158.22	1,500,300.00

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	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		162,494.97	12,472.39
应收申购款		380,406.63	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	54,345.64
资产总计		167,092,560.83	238,267,240.94
负债和净资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		304,129.97	0.66
应付赎回款		4,648,515.08	-
应付管理人报酬		258,615.20	363,585.20
应付托管费		50,286.29	70,697.12
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	278,469.68	35,490.53
负债合计		5,540,016.22	469,773.51
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	191,131,473.36	239,756,122.79
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-29,578,928.75	-1,958,655.36
净资产合计		161,552,544.61	237,797,467.43
负债和净资产总计		167,092,560.83	238,267,240.94

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，嘉实全球价值股票（QDII）人民币基金份额净值 0.8452 元，基金份额总额 188,279,860.18 份，嘉实全球价值股票（QDII）美元现汇基金份额净值 0.7763

美元，基金份额总额 445,785.86 份，基金份额总额合计为 188,725,646.04 份。

7.2 利润表

会计主体：嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 11 月 23 日（基金 合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-28,637,914.18	-1,347,102.43
1. 利息收入		132,995.36	115,623.60
其中：存款利息收入	7.4.7.13	132,995.36	80,990.68
债券利息收入		-	3,694.93
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		-	30,937.99
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		-23,900,757.20	600.75
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-26,604,616.80	-21,828.43
基金投资收益	7.4.7.15	-635,203.33	-
债券投资收益	7.4.7.16	111,935.12	-
资产支持证券投资 收益	7.4.7.17	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.18	-	-
衍生工具收益	7.4.7.19	-291,134.28	-
股利收益	7.4.7.20	3,518,262.09	22,429.18
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）	7.4.7.21	-4,859,256.07	-858,467.41
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-111,507.08	-604,859.37
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.22	100,610.81	-
减：二、营业总支出		4,274,154.05	611,552.93
1. 管理人报酬		3,413,660.60	446,301.28
2. 托管费		663,767.35	86,780.80

3. 销售服务费		-	-
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	7.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.24	196,726.10	78,470.85
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-32,912,068.23	-1,958,655.36
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-32,912,068.23	-1,958,655.36
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-32,912,068.23	-1,958,655.36

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 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(基金净值)	239,756,122.79	-	-1,958,655.36	237,797,467.43
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	239,756,122.79	-	-1,958,655.36	237,797,467.43
三、本期增减变动额(减少以“-”	-48,624,649.43	-	-27,620,273.39	-76,244,922.82

号填列)				
(一)、 综合收 益总额	-	-	-32,912,068.23	-32,912,068.23
(二)、 本期基 金份 额交 易产 生的 基金 净值 变动 数 (净值 减少 以 “-” 号 填列)	-48,624,649.43	-	5,291,794.84	-43,332,854.59
其中:1. 基金申 购款	8,507,994.37	-	-1,024,267.83	7,483,726.54
2 .基金 赎回 款	-57,132,643.80	-	6,316,062.67	-50,816,581.13
(三)、 本期向 基金份 额持有 人分配 利润产 生的基 金净值 变动(净 值减少 以“-” 号填列)	-	-	-	-
(四)、 其他综 合收益 结转留 存收益	-	-	-	-
四、本 期末 净资 产(基 金净值)	191,131,473.36	-	-29,578,928.75	161,552,544.61
项目	上年度可比期间			
	2021年11月23日(基金合同生效日)至2021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(基金净值)	-	-	-	-
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	239,756,122.79	-	-	239,756,122.79
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	-1,958,655.36	-1,958,655.36
(一)、综合收益总额	-	-	-1,958,655.36	-1,958,655.36
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-	-
(三)、本期向基金份额持有	-	-	-	-

人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	239,756,122.79	-	-1,958,655.36	237,797,467.43

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：

经雷

梁凯

李袁

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

嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）（以下简称“本基金”），系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[2021]2555 号《关于准予嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）注册的批复》注册，由嘉实基金管理有限公司于 2021 年 11 月 3 日至 2021 年 11 月 19 日向社会公开募集，基金合同于 2021 年 11 月 23 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金首次设立募集规模为 237,958,337.73 份人民币基金份额和 281,215.89 份美元基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司，境外托管人为摩根大通银行。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督

管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为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，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，

相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资

产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。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。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

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等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 人民币基金份额的现金分红币种为人民币，美元基金份额的现金分红币种为美元；不同币种份额红利再投资适用的基金份额净值为该币种份额的基金份额净值；

(4) 基金收益分配后各类基金份额的每一基金份额净值不能分别低于其面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(5) 由于本基金各类基金份额分别以其认购或申购时的币种计价，每类基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致，可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前按照《信息披露办法》的要求在规定媒介公告。

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金额。

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，与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

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) 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) 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

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

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理。此外，本基金亦已执行财政部于 2022 年发布的《关于印发〈资产管理产品相关会计处理规定〉的通知》（财会〔2022〕14 号）。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产

款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

根据新金融工具准则的衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与原准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 73,730,899.83 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 2,005.37 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 73,732,905.20 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 57,938,421.71 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 17,887.53 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 57,956,309.24 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 54,345.64 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 2,005.37 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 17,887.53 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 34,452.74 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至应收申购款的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 0.00 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 106,146,325.66 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 34,452.74 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 106,180,778.40 元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

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

本基金本报告期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[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以利息及利息性质的收入为销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳；

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；

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，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
活期存款	6,236,716.10	73,730,899.83
等于：本金	6,236,271.77	73,730,899.83
加：应计利息	444.33	-
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	6,236,716.10	73,730,899.83

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	152,105,849.38	-	146,469,030.63	-5,636,818.75	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	9,950,441.61	104,328.22	10,022,158.22	-32,611.61
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	9,950,441.61	104,328.22	10,022,158.22	-32,611.61
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	2,945,380.64	-	2,869,247.52	-76,133.12	

其他	-	-	-	-	
合计	165,001,671.63	104,328.22	159,360,436.37	-5,745,563.48	
项目	上年度末 2021年12月31日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	102,656,565.80	-	101,785,594.19	-870,971.61	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,500,600.00	-	1,500,300.00	-300.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,500,600.00	-	1,500,300.00	-300.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	2,851,427.27	-	2,860,431.47	9,004.20	
其他	-	-	-	-	
合计	107,008,593.07	-	106,146,325.66	-862,267.41	

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 2022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	2,322,000.00	-	-	-
其中：股指期货投资	2,322,000.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,322,000.00	-	-	-
项目	上年度末 2021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	2,955,980.00	-	-	-
其中：股指期货投资	2,955,980.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,955,980.00	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

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
IC2301	IC2301	2.00	2,349,840.00	27,840.00
合计				27,840.00
减：可抵销期货暂收款				27,840.00
净额				0.00

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

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

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。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	54,345.64
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	54,345.64

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	10,490.73	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	97,978.95	19,463.13
其中：交易所市场	97,978.95	19,463.13
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	170,000.00	16,027.40
合计	278,469.68	35,490.53

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实全球价值股票（QDII）人民币

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	237,958,337.73	237,958,337.73

本期申购	7,303,115.44	7,303,115.44
本期赎回 (以“-”号填列)	-56,981,592.99	-56,981,592.99
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	188,279,860.18	188,279,860.18

嘉实全球价值股票 (QDII) 美元现汇

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	281,215.89	1,797,785.06
本期申购	188,164.58	1,204,878.93
本期赎回 (以“-”号填列)	-23,594.61	-151,050.81
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	445,785.86	2,851,613.18

注：(1) 申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

(2) 本基金合同于 2021 年 11 月 23 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 238,239,553.62 份基金份额，其中认购资金利息折合 92,107.63 份基金份额。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

嘉实全球价值股票 (QDII) 人民币

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-1,091,938.32	-852,030.33	-1,943,968.65
本期利润	-27,755,809.47	-4,824,235.20	-32,580,044.67
本期基金份额交易产生的变动数	2,888,099.39	2,498,259.13	5,386,358.52
其中：基金申购款	-546,261.01	-365,150.65	-911,411.66
基金赎回款	3,434,360.40	2,863,409.78	6,297,770.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-25,959,648.40	-3,178,006.40	-29,137,654.80

嘉实全球价值股票 (QDII) 美元现汇

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-8,249.63	-6,437.08	-14,686.71
本期利润	-297,002.69	-35,020.87	-332,023.56

本期基金份额交易产生的变动数	-87,890.20	-6,673.48	-94,563.68
其中：基金申购款	-94,987.42	-17,868.75	-112,856.17
基金赎回款	7,097.22	11,195.27	18,292.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-393,142.52	-48,131.43	-441,273.95

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年11月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日
活期存款利息收入	36,507.99	17,612.73
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	96,337.81	63,362.96
其他	149.56	14.99
合计	132,995.36	80,990.68

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年11月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-26,604,616.80	-21,828.43
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	-26,604,616.80	-21,828.43

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年11月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出股票成交总额	251,889,146.57	371,903.11

减：卖出股票成本总额	277,934,146.66	393,731.54
减：交易费用	559,616.71	-
买卖股票差价收入	-26,604,616.80	-21,828.43

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年11月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出/赎回基金成交总额	3,322,369.61	-
减：卖出/赎回基金成本总额	3,951,888.31	-
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-	-
减：交易费用	5,684.63	-
基金投资收益	-635,203.33	-

7.4.7.16 债券投资收益

7.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年11月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	138,092.72	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-26,157.60	-
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	111,935.12	-

7.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年11月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券	20,702,921.99	-

到期兑付)成交总额		
减:卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	20,444,177.39	-
减:应计利息总额	284,873.79	-
减:交易费用	28.41	-
买卖债券差价收入	-26,157.60	-

7.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.17 资产支持证券投资收益

7.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.18 贵金属投资收益

7.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.19 衍生工具收益

7.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 收益金额 2021年11月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股指期货投资收益	-291,134.28	-

7.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年11月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,464,274.59	17,128.69
其中：证券出借权益补偿收入		-
基金投资产生的股利收益	53,987.50	5,300.49
合计	3,518,262.09	22,429.18

7.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年11月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	-4,883,296.07	-862,267.41
股票投资	-4,765,847.14	-870,971.61
债券投资	-32,311.61	-300.00
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-85,137.32	9,004.20
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	24,040.00	3,800.00
权证投资	-	-
期货投资	24,040.00	3,800.00
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	-4,859,256.07	-858,467.41

7.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月	上年度可比期间 2021年11月23日（基金
----	--------------------------	---------------------------

	31 日	合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	100,570.56	-
其他	40.25	-
合计	100,610.81	-

7.4.7.23 信用减值损失

无。

7.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 11 月 23 日(基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	-
信息披露费	120,000.00	16,027.40
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	6,481.81	1,532.58
债券托管账户维护费	13,500.00	-
其他	6,412.02	800.00
证券组合费	332.27	-
交易费用	-	60,110.87
合计	196,726.10	78,470.85

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

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司(“嘉实基金”)	基金管理人
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人
JPMorgan Chase Bank, National Association(“摩根大通银行”)	境外资产托管人
DWS Investments Singapore Limited	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
嘉实资本管理有限公司(“嘉实资本”)	基金管理人的控股子公司
嘉实财富管理有限公司(“嘉实财富”)	基金管理人的控股子公司

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 基金交易

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 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年11月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,413,660.60	446,301.28
其中：支付销售机构的客户维护费	1,423,449.68	183,265.59

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.80%/当年天数。2. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年11月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日
----	-----------------------------	---

当期发生的基金应支付的托管费	663,767.35	86,780.80
----------------	------------	-----------

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.35% 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×0.35%/当年天数。

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

无。

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

无。

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 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年11月23日（基金合同生效日） 至2021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
中国农业银行股份有限公司_活期	5,365,043.19	36,507.99	23,980,073.68	17,612.73
摩根大通银行_活期	871,672.91	-	49,750,826.15	-

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

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

本期(2022年1月1日至2022年12月31日),本基金未实施利润分配。

7.4.12 期末（2022 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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和 risk 管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

公司建立包括董事会、管理层、各部门及一线员工组成的四道风控防线，还有董事会风险控制与内审委员会、公司风险控制委员会、督察长及其合规管理部门、风险管理部门，评估各项风险并提出防控措施并有效执行。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法，主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，持有境外基金的市值合计不超过基金资产净值的 10%（持有货币市场基金可以不受前述限制），且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的 20%。

本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商及资产托管机构完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	10,022,158.22	-
未评级	-	-
合计	10,022,158.22	-

注：评级取自第三方评级机构。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。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资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。由于本基金主要投资于股票，生息资产主要为银行存款，无重大利率风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	6,236,716.10	-	-	-	6,236,716.10
结算备付金	614,790.79	-	-	-	614,790.79
存出保证金	8,738.37	-	-	328,977.60	337,715.97
交易性金融资产	10,022,158.22	-	-	149,338,278.15	159,360,436.37
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	162,494.97	162,494.97
应收申购款	-	-	-	380,406.63	380,406.63
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	16,882,403.48	-	-	150,210,157.35	167,092,560.83
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	-	-	-	304,129.97	304,129.97
应付赎回款	-	-	-	4,648,515.08	4,648,515.08
应付管理人报酬	-	-	-	258,615.20	258,615.20
应付托管费	-	-	-	50,286.29	50,286.29
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	278,469.68	278,469.68
负债总计	-	-	-	5,540,016.22	5,540,016.22
利率敏感度缺口	16,882,403.48	-	-	-144,670,141.13	161,552,544.61
上年度末 2021 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	73,730,899.83	-	-	-	73,730,899.83
结算备付金	57,938,421.71	-	-	-	57,938,421.71
存出保证金	90.91	-	-	384,684.80	384,775.71
交易性金融资产	1,500,300.00	-	-	104,646,025.66	106,146,325.66
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-

应收清算款	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	-	-	12,472.39	12,472.39
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	54,345.64	54,345.64
资产总计	133,169,712.45	-	-105,097,528.49	238,267,240.94
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	-	-	0.66	0.66
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	363,585.20	363,585.20
应付托管费	-	-	70,697.12	70,697.12
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	35,490.53	35,490.53
负债总计	-	-	469,773.51	469,773.51
利率敏感度缺口	133,169,712.45	-	-104,627,754.98	237,797,467.43

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		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	市场利率上升25个基点	-12,862.87	-215.64
	市场利率下降25个基点	12,910.66	215.70

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

金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的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 2022年12月31日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
银行存款	3,073,412 .51	-	39.71	3,073,452.22
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资 产	92,667,59 6.61	11,897,007.81	21,863,314.73	126,427,919.15
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	131,366.6 6	-	31,128.31	162,494.97
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	95,872,37 5.78	11,897,007.81	21,894,482.75	129,663,866.34
以外币计价的 负债				
应付清算款	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
应付赎回款	1,065.86	-	-	1,065.86
应付管理人报 酬	-	-	-	-

应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
其他负债	2.37	-	-	2.37
负债合计	1,068.23	-	-	1,068.23
资产负债表外 汇风险敞口净额	95,871,30 7.55	11,897,007.81	21,894,482.75	129,662,798.11
	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
项目	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
银行存款	63,443,99 1.95	-	-	63,443,991.95
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资 产	71,048,70 8.84	3,727,193.11	6,052,648.71	80,828,550.66
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	4,301.95	6,279.17	1,891.27	12,472.39
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	42.08	-	-	42.08
资产合计	134,497,0 44.82	3,733,472.28	6,054,539.98	144,285,057.08
以外币计价的 负债				
应付清算款	-	-	-	-

衍生金融负债	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净额	134,497,044.82	3,733,472.28	6,054,539.98	144,285,057.08

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		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	所有外币相对人民币升值 5%	6,483,139.91	7,214,252.85
	所有外币相对人民币贬值 5%	-6,483,139.91	-7,214,252.85

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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。本基金主要投资于上市交易的证券，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。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，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，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	146,469,030.63	90.66	101,785,594.19	42.80
交易性金融资产—基金投资	2,869,247.52	1.78	2,860,431.47	1.20
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	149,338,278.15	92.44	104,646,025.66	44.01

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准以外的其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2022 年 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）	
分析	业绩比较基准上升 5%	7,775,814.20	3,243,652.10
	业绩比较基准下降 5%	-7,775,814.20	-3,243,652.10

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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	149,338,278.15	104,646,025.66
第二层次	10,022,158.22	1,500,300.00
第三层次	-	-
合计	159,360,436.37	106,146,325.66

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。对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、新发未上市、涨跌停等导致的交易不活跃）或非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

无。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

无。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本报告中资产负债表和利润表的上期比较数据，已根据本年《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〉》中的格式要求进行列示调整。其中：

原“应收利息”、“其他资产”项目，合并列示在“其他资产”项目；

原“应付交易费用”、“应付利息”、“其他负债”项目，合并列示在“其他负债”项目；

原“交易费用”、“其他费用”项目，合并列示在“其他费用”项目。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	146,469,030.63	87.66
	其中：普通股	138,343,478.79	82.79
	存托凭证	7,891,201.69	4.72
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	234,350.15	0.14
2	基金投资	2,869,247.52	1.72
3	固定收益投资	10,022,158.22	6.00
	其中：债券	10,022,158.22	6.00
	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	6,851,506.89	4.10
8	其他各项资产	880,617.57	0.53
9	合计	167,092,560.83	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 2,889,520.31 元，占基金资产净值的比例为 1.79%。

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
美国	90,063,986.90	55.75
中国	22,910,359.00	14.18
中国香港	11,897,007.81	7.36
英国	4,105,509.98	2.54
加拿大	4,068,293.13	2.52
日本	3,011,033.18	1.86
法国	2,734,349.99	1.69
德国	2,208,587.16	1.37
澳大利亚	1,536,452.45	0.95
意大利	1,035,226.73	0.64
瑞士	957,218.58	0.59

荷兰	912,665.23	0.56
瑞典	415,642.22	0.26
新加坡	393,184.78	0.24
比利时	153,542.84	0.10
奥地利	65,970.65	0.04
合计	146,469,030.63	90.66

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
金融	30,808,212.50	19.07
房地产	1,191,558.60	0.74
信息技术	29,709,623.62	18.39
原材料	9,020,705.15	5.58
必需消费品	8,196,034.79	5.07
非必需消费品	13,631,483.59	8.44
工业	16,553,240.79	10.25
能源	16,483,781.68	10.20
医疗保健	9,603,387.86	5.94
公用事业	3,403,725.56	2.11
通信服务	7,632,926.34	4.72
房地产信托特殊类	132,811.37	0.08
房地产信托工业类	81.83	-
房地产信托零售类	101,456.95	0.06
合计	146,469,030.63	90.66

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

8.4 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

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代 码	所在证 券市场	所属 国家 (地 区)	数量 (股)	公允价值	占基 金资 产净 值比 例(%)
1	Apple Inc	苹果公司	AAPL UW	纳斯达 克证 券交 易所	美国	7,071	6,398,621.99	3.96
2	Microsoft Corp	微软公司	MSFT UW	纳斯达 克证 券交 易所	美国	3,423	5,717,267.02	3.54
3	Berkshire Hathaway Inc	伯克希 尔哈撒 韦公司	BRK/B UN	纽约证 券交 易所	美国	1,927	4,145,680.24	2.57
4	Exxon	埃克森	XOM UN	纽约证	美国	3,027	2,325,327.42	1.44

	Mobil Corp	美孚石油公司		券交易所				
5	Steel Dynamics Inc	Steel Dynamics 股份有限公司	STLD UN	纳斯达克证券交易所	美国	2,362	1,607,202.63	0.99
6	Teck Resources Ltd	加拿大泰克资源有限公司	TECK UN	纽约证券交易所	美国	5,179	1,364,154.67	0.84
7	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	台积电	TSM UN	纽约证券交易所	美国	2,566	1,331,222.98	0.82
8	NVIDIA Corp	英伟达	NVDA UN	纳斯达克证券交易所	美国	1,272	1,294,650.05	0.80
9	Costco Wholesale Corp	开市客	COST UN	纳斯达克证券交易所	美国	399	1,268,556.62	0.79
10	Activision Blizzard Inc	动视暴雪股份有限公司	ATVI UN	纳斯达克证券交易所	美国	2,246	1,197,432.73	0.74
11	CRRC Corp Ltd	中国中车	601766 CH	上海证券交易所	中国	227,000	1,159,970.00	0.72
12	General Dynamics Corp	通用动力	GD UN	纽约证券交易所	美国	663	1,145,655.32	0.71
13	Raytheon Technologies Corp	雷神技术公司	RTX UN	纽约证券交易所	美国	1,547	1,087,335.92	0.67
14	Canadian Natural Resources Ltd	加拿大自然资源有限公司	CNQ CT	加拿大证券交易所	加拿大	2,799	1,081,432.32	0.67
15	PetroChina Co Ltd	中国石油	857 HK	香港证券交易所	中国香港	226,000	720,708.10	0.45
15	PetroChina	中国石	601857	上海证	中国	63,500	315,595.00	0.20

	a Co Ltd	油	CH	券交易所				
16	ConocoPhillips	康菲石油	COP UN	纽约证券交易所	美国	1,259	1,034,674.91	0.64
17	Foxconn Industrial Internet Co Ltd	工业富联	601138 CH	上海证券交易所	中国	112,500	1,032,750.00	0.64
18	UnitedHealth Group Inc	联合健康集团	UNH UN	纽约证券交易所	美国	269	993,280.25	0.61
19	BOE Technology Group Co Ltd	京东方	000725 CH	深圳证券交易所	中国	292,100	987,298.00	0.61
20	Postal Savings Bank of China Co Ltd	邮储银行	1658 HK	香港证券交易所	中国香港	134,000	580,536.17	0.36
20	Postal Savings Bank of China Co Ltd	邮储银行	601658 CH	上海证券交易所	中国	84,200	389,004.00	0.24
21	Bank of Shanghai Co Ltd	上海银行	601229 CH	上海证券交易所	中国	163,600	966,876.00	0.60
22	Amazon.com Inc	亚马逊公司	AMZN UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,628	952,422.98	0.59
23	China Minsheng Banking Corp Ltd	民生银行	600016 CH	上海证券交易所	中国	268,900	927,705.00	0.57
24	Ameriprise Financial Inc	阿默普莱斯金融公司	AMP UN	纽约证券交易所	美国	427	925,978.32	0.57
25	Huaxia Bank Co Ltd	华夏银行	600015 CH	上海证券交易所	中国	177,000	918,630.00	0.57

26	CITIC Securities Co Ltd	中信证券	600030 CH	上海证券交易所	中国	35,800	712,778.00	0.44
26	CITIC Securities Co Ltd	中信证券	6030 HK	香港证券交易所	中国香港	13,500	190,293.31	0.12
27	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	中国平安	601318 CH	上海证券交易所	中国	11,200	526,400.00	0.33
27	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	中国平安	2318 HK	香港证券交易所	中国香港	8,000	369,099.16	0.23
28	Bank of Beijing Co Ltd	北京银行	601169 CH	上海证券交易所	中国	203,300	876,223.00	0.54
29	Alphabet Inc	Alphabet 公司	GOOGL UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,425	875,643.49	0.54
30	Bank of Communications Co Ltd	交通银行	601328 CH	上海证券交易所	中国	138,800	657,912.00	0.41
30	Bank of Communications Co Ltd	交通银行	3328 HK	香港证券交易所	中国香港	51,000	204,549.90	0.13
31	TotalEnergies SE	道达尔集团	TTE UN	纽约证券交易所	美国	1,329	574,609.59	0.36
31	TotalEnergies SE	道达尔集团	TTE FP	巴黎证券交易所	法国	625	272,095.68	0.17
32	Shell PLC	壳牌公共有限公司	SHEL LN	伦敦证券交易所	英国	4,286	836,827.64	0.52
33	Coca-Cola Co/The	可口可乐	KO UN	纽约证券交易所	美国	1,872	829,330.08	0.51
34	Broadcom Inc	博通股份有限公司	AVGO UW	纳斯达克证券	美国	211	821,658.64	0.51

		公司		交易所				
35	Chevron Corp	雪佛龙	CVX UN	纽约证券交易所	美国	656	820,049.89	0.51
36	Boeing Co/The	波音	BA UN	纽约证券交易所	美国	611	810,605.55	0.50
37	JPMorgan Chase & Co	摩根大通	JPM UN	纽约证券交易所	美国	850	793,859.93	0.49
38	China Everbright Bank Co Ltd	光大银行	601818 CH	上海证券交易所	中国	257,500	790,525.00	0.49
39	China Railway Group Ltd	中国中铁	390 HK	香港证券交易所	中国香港	142,000	522,598.68	0.32
39	China Railway Group Ltd	中国中铁	601390 CH	上海证券交易所	中国	48,000	266,880.00	0.17
40	BP PLC	BP 公司	BP UN	纽约证券交易所	美国	2,201	535,444.93	0.33
40	BP PLC	BP 公司	BP/ LN	伦敦证券交易所	英国	6,295	250,941.28	0.16
41	Eli Lilly & Co	礼来	LLY UN	纽约证券交易所	美国	307	782,214.28	0.48
42	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴巴	BABA UN	纽约证券交易所	美国	1,251	767,503.03	0.48
43	Tesla Inc	特斯拉公司	TSLA UW	纳斯达克证券交易所	美国	870	746,372.50	0.46
44	SAIC Motor Corp Ltd	上汽集团	600104 CH	上海证券交易所	中国	51,400	740,674.00	0.46
45	Shanghai Pudong Development Bank Co Ltd	浦发银行	600000 CH	上海证券交易所	中国	98,800	719,264.00	0.45

46	Pfizer Inc	辉瑞制药	PFE UN	纽约证券交易所	美国	2,008	716,587.14	0.44
47	ASML Holding NV	阿斯麦控股公司	ASML UW	纳斯达克证券交易所	美国	182	692,593.25	0.43
48	China Communications Construction Co Ltd	中国交建	1800 HK	香港证券交易所	中国香港	151,000	505,814.14	0.31
48	China Communications Construction Co Ltd	中国交建	601800 CH	上海证券交易所	中国	21,200	170,660.00	0.11
49	China Telecom Corp Ltd	中国电信	601728 CH	上海证券交易所	中国	156,300	654,897.00	0.41
50	Bristol-Myers Squibb Co	百时美施贵宝公司	BYM UN	纽约证券交易所	美国	1,304	653,438.27	0.40
51	McKesson Corp	McKesson 公司	MCK UN	纽约证券交易所	美国	250	653,140.19	0.40
52	Computershare Ltd	Computershare 有限公司	CPU AT	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	5,201	642,331.61	0.40
53	Cheniere Energy Inc	Cheniere 能源公司	LNG UA	纽约证券交易所	美国	615	642,313.02	0.40
54	HSBC Holdings PLC	汇丰控股	HSBA LN	伦敦证券交易所	英国	9,994	432,624.02	0.27
54	HSBC Holdings PLC	汇丰控股	5 HK	香港证券交易所	中国香港	4,800	208,167.64	0.13
55	Eni SpA	埃尼集团	ENI IM	意大利证券交易所	意大利	4,232	417,362.57	0.26
55	Eni SpA	埃尼集团	E UN	纽约证券交易所	美国	1,072	213,977.03	0.13

56	Bank of China Ltd	中国银行	601988 CH	上海证券交易所	中国	196,400	620,624.00	0.38
57	China Shenhua Energy Co Ltd	中国神华	1088 HK	香港证券交易所	中国香港	22,000	443,151.25	0.27
57	China Shenhua Energy Co Ltd	中国神华	601088 CH	上海证券交易所	中国	6,400	176,768.00	0.11
58	AstraZeneca PLC	阿斯利康公共有限公司	AZN UW	纳斯达克证券交易所	美国	728	343,761.51	0.21
58	AstraZeneca PLC	阿斯利康公共有限公司	AZN LN	伦敦证券交易所	英国	283	266,486.99	0.16
59	Meta Platforms Inc	Meta 平台股份有限公司	META UW	纳斯达克证券交易所	美国	715	599,255.77	0.37
60	Advanced Micro Devices Inc	AMD 公司	AMD UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,312	591,839.45	0.37
61	Metallurgical Corp of China Ltd	中国中冶	601618 CH	上海证券交易所	中国	122,200	388,596.00	0.24
61	Metallurgical Corp of China Ltd	中国中冶	1618 HK	香港证券交易所	中国香港	128,000	197,805.71	0.12
62	Dollarama Inc	Dollarama 股份有限公司	DOL CT	加拿大证券交易所	加拿大	1,436	584,333.98	0.36
63	Daqin Railway Co Ltd	大秦铁路	601006 CH	上海证券交易所	中国	85,700	572,476.00	0.35
64	China Petroleum &	中国石化	600028 CH	上海证券交易所	中国	131,100	571,596.00	0.35

	Chemical Corp							
65	Mitsubishi Corp	三菱商事	8058 JT	日本证券交易所	日本	2,500	560,623.29	0.35
66	Progressive Corp/The	前进保险公司	PGR UN	纽约证券交易所	美国	618	558,287.77	0.35
67	Royal Bank of Canada	加拿大皇家银行	RY CT	加拿大证券交易所	加拿大	852	557,319.65	0.34
68	Applied Materials Inc	应用材料	AMAT UW	纳斯达克证券交易所	美国	819	555,456.24	0.34
69	Glencore PLC	嘉能可	GLEN LN	伦敦证券交易所	英国	11,943	553,785.05	0.34
70	Baidu Inc	百度	BIDU UW	纳斯达克证券交易所	美国	668	532,136.11	0.33
71	Kweichow Moutai Co Ltd	贵州茅台	600519 CH	上海证券交易所	中国	300	518,100.00	0.32
72	Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai	格力电器	000651 CH	深圳证券交易所	中国	15,800	510,656.00	0.32
73	Visa Inc	维萨公司	V UN	纽约证券交易所	美国	348	503,543.92	0.31
74	Olin Corp	奥林公司	OLN UN	纽约证券交易所	美国	1,349	497,384.29	0.31
75	China United Network Communications Ltd	中国联通	600050 CH	上海证券交易所	中国	70,400	315,392.00	0.20
75	China Unicom Hong Kong Ltd	中国联通	762 HK	香港证券交易所	中国香港	42,000	181,208.75	0.11
76	Hess Corp	赫斯公	HES UN	纽约证	美国	498	491,884.35	0.30

		司		券交易 所				
77	Baoshan Iron & Steel Co Ltd	宝钢股 份	600019 CH	上海证 券交易 所	中国	87,100	486,889.00	0.30
78	China Construct ion Bank Corp	建设银 行	939 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	111,000	484,858.02	0.30
79	Amgen Inc	AMGEN- T	AMGN UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	263	481,075.01	0.30
80	China CITIC Bank Corp Ltd	中信银 行	601998 CH	上海证 券交易 所	中国	95,500	475,590.00	0.29
81	CVS Health Corp	CVS 健 康公司	CVS UN	纽约证 券交易 所	美国	728	472,494.62	0.29
82	China Pacific Insurance Group Co Ltd	中国太 保	601601 CH	上海证 券交易 所	中国	19,200	470,784.00	0.29
83	Constella tion Energy Corp	美国联 合能源 公司	CEG UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	756	453,916.13	0.28
84	KLA Corp	KLA 公 司	KLAC UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	172	451,648.46	0.28
85	RWE AG	莱茵集 团	RWE GY	德国证 券交易 所	德国	1,461	451,037.60	0.28
86	Mastercar d Inc	万事达 股份有 限公司	MA UN	纽约证 券交易 所	美国	185	448,033.07	0.28
87	Yum China Holdings Inc	百胜中 国	YUMC UN	纽约证 券交易 所	美国	700	266,430.77	0.16
87	Yum China Holdings Inc	百胜中 国	9987 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	450	176,465.49	0.11

88	Merck & Co Inc	默克	MRK UN	纽约证券交易所	美国	564	435,815.42	0.27
89	Keysight Technologies Inc	是德科技公司	KEYS UN	纽约证券交易所	美国	361	430,107.72	0.27
90	General Mills Inc	通用磨坊	GIS UN	纽约证券交易所	美国	735	429,226.56	0.27
91	Yankuang Energy Group Co Ltd	兖矿能源	1171 HK	香港证券交易所	中国香港	20,000	425,196.52	0.26
92	ON Semiconductor Corp	安森美半导体公司	ON UW	纳斯达克证券交易所	美国	978	424,825.70	0.26
93	Mercedes-Benz Group AG	梅赛德斯-奔驰集团	MBG GY	德国证券交易所	德国	926	422,039.37	0.26
94	China Yangtze Power Co Ltd	长江电力	600900 CH	上海证券交易所	中国	20,000	420,000.00	0.26
95	McDonald's Corp	麦当劳	MCD UN	纽约证券交易所	美国	227	416,631.50	0.26
96	Oracle Corp	甲骨文	ORCL UN	纽约证券交易所	美国	726	413,301.93	0.26
97	Marubeni Corp	丸红株式会社	8002 JT	日本证券交易所	日本	5,200	412,476.32	0.26
98	AbbVie Inc	艾伯维公司	ABBV UN	纽约证券交易所	美国	364	409,699.84	0.25
99	Midea Group Co Ltd	美的集团	000333 CH	深圳证券交易所	中国	7,900	409,220.00	0.25
100	NIKE Inc	耐克公司	NKE UN	纽约证券交易所	美国	496	404,204.21	0.25
101	PepsiCo Inc	百事可乐	PEP UW	纳斯达克证券交易所	美国	321	403,890.11	0.25

10 2	Nucor Corp	纽柯公司	NUE UN	纽约证券交易所	美国	437	401,167.72	0.25
10 3	American International Group Inc	美国国际集团	AIG UN	纽约证券交易所	美国	903	397,718.50	0.25
10 4	Anhui Conch Cement Co Ltd	海螺水泥	600585 CH	上海证券交易所	中国	14,100	386,058.00	0.24
10 5	China Railway Construction Corp Ltd	中国铁建	601186 CH	上海证券交易所	中国	49,800	384,954.00	0.24
10 6	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	LVMH 集团公司	MC FP	巴黎证券交易所	法国	68	343,184.42	0.21
10 6	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	LVMH 集团公司	LVMUY UV	纽约证券交易所	美国	38	38,340.54	0.02
10 7	National Grid PLC	英国国家电网	NG/ LN	伦敦证券交易所	英国	4,448	372,398.79	0.23
10 8	Ping An Bank Co Ltd	平安银行	000001 CH	深圳证券交易所	中国	27,600	363,216.00	0.22
10 9	Mitsui & Co Ltd	三井物产	8031 JT	日本证券交易所	日本	1,800	363,123.67	0.22
11 0	Deutsche Telekom AG	德国电信	DTE GY	德国证券交易所	德国	2,622	362,748.51	0.22
11 1	Wuliangye Yibin Co Ltd	五粮液	000858 CH	深圳证券交易所	中国	2,000	361,380.00	0.22
11 2	Humana Inc	Humana 股份有限公司	HUM UN	纽约证券交易所	美国	101	360,287.05	0.22

113	Zijin Mining Group Co Ltd	紫金矿业	2899 HK	香港证券交易所	中国香港	38,000	359,130.27	0.22
114	CK Hutchison Holdings Ltd	长和	1 HK	香港证券交易所	中国香港	8,500	355,722.45	0.22
115	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	501	353,148.47	0.22
116	Industrial Bank Co Ltd	兴业银行	601166 CH	上海证券交易所	中国	20,000	351,800.00	0.22
117	Targa Resources Corp	Targa 资源公司	TRGP UN	纽约证券交易所	美国	686	351,162.10	0.22
118	General Electric Co	通用电气	GE UN	纽约证券交易所	美国	595	347,220.48	0.21
119	Lockheed Martin Corp	洛克希德马丁	LMT UN	纽约证券交易所	美国	102	345,597.24	0.21
120	Netflix Inc	奈飞公司	NFLX UW	纳斯达克证券交易所	美国	167	342,971.45	0.21
121	Wanhua Chemical Group Co Ltd	万华化学	600309 CH	上海证券交易所	中国	3,700	342,805.00	0.21
122	Bank of America Corp	美国银行公司	BAC UN	纽约证券交易所	美国	1,429	329,623.93	0.20
123	Jiangxi Copper Co Ltd	江西铜业	358 HK	香港证券交易所	中国香港	32,000	329,295.05	0.20
124	Morgan Stanley	摩根士丹利	MS UN	纽约证券交易所	美国	549	325,079.53	0.20
125	Nestle SA	雀巢	NESN SE	瑞士证券交易所	瑞士	402	324,887.74	0.20
12	Arch	阿契资	ACGL UW	纳斯达克	美国	736	321,806.86	0.20

6	Capital Group Ltd	本集团		克证券交易所				
127	Starbucks Corp	星巴克公司	SBUX UW	纳斯达克证券交易所	美国	461	318,499.52	0.20
128	ASM International NV	ASM 国际有限公司	ASM NA	阿姆斯特丹交易所	荷兰	182	318,355.56	0.20
129	Marathon Oil Corp	Marathon 石油公司	MRO UN	纽约证券交易所	美国	1,680	316,733.29	0.20
130	HP Inc	惠普	HPQ UN	纽约证券交易所	美国	1,673	313,083.22	0.19
131	AXA SA	安盛集团	CS FP	巴黎证券交易所	法国	1,616	312,540.31	0.19
132	Bilibili Inc	哔哩哔哩	BILI UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,875	309,358.83	0.19
133	China Merchants Bank Co Ltd	招商银行	600036 CH	上海证券交易所	中国	8,300	309,258.00	0.19
134	Lowe's Cos Inc	劳氏	LOW UN	纽约证券交易所	美国	222	308,053.17	0.19
135	China Life Insurance Co Ltd	中国人寿	601628 CH	上海证券交易所	中国	8,100	300,672.00	0.19
136	TJX Cos Inc/The	TJX 公司	TJX UN	纽约证券交易所	美国	540	299,366.37	0.19
137	New China Life Insurance Co Ltd	新华保险	1336 HK	香港证券交易所	中国香港	17,500	298,575.50	0.18
138	Schlumberger Ltd	斯伦贝谢有限公司	SLB UN	纽约证券交易所	美国	798	297,117.36	0.18
139	Macquarie Group Ltd	麦格理集团有限公司	MQG AT	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	377	296,705.05	0.18

140	Arista Networks Inc	Arista 网络股份有限公司	ANET UN	纽约证券交易所	美国	350	295,803.97	0.18
141	Occidental Petroleum Corp	西方石油	OXY UN	纽约证券交易所	美国	662	290,419.50	0.18
142	TELUS Corp	泰勒斯电信公司	T CT	加拿大证券交易所	加拿大	2,157	289,618.24	0.18
143	China Resources Cement Holdings Ltd	华润水泥控股	1313 HK	香港证券交易所	中国香港	78,000	288,454.75	0.18
144	CNOOC Ltd	中国海洋石油	883 HK	香港证券交易所	中国香港	32,000	285,274.71	0.18
145	Moody's Corp	穆迪	MCO UN	纽约证券交易所	美国	147	285,250.10	0.18
146	ABN AMRO Bank NV	荷兰银行股份有限公司	ABN NA	阿姆斯特丹交易所	荷兰	2,954	283,409.66	0.18
147	Pinduoduo Inc	拼多多	PDD UW	纳斯达克证券交易所	美国	492	279,437.86	0.17
148	Trip.com Group Ltd	携程集团	TCOM UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,156	276,957.07	0.17
149	Schneider Electric SE	施耐德电气有限公司	SU FP	巴黎证券交易所	法国	283	274,600.98	0.17
150	Archer-Daniels-Midland Co	Archer-Daniels-Midland 公司	ADM UN	纽约证券交易所	美国	424	274,185.16	0.17
151	S&P Global Inc	标普全球	SPGI UN	纽约证券交易所	美国	117	272,928.61	0.17
15	Comcast	康卡斯	CMCSA	纳斯达克	美国	1,120	272,778.31	0.17

2	Corp	特公司	UW	克证券 交易所				
15 3	NXP Semicondu ctors NV	恩智浦 半导体 公司	NXPI UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	246	270,751.47	0.17
15 4	China St ate Cons truction Enginee ring C orp Ltd	中国建 筑	601668 CH	上海证 券交易 所	中国	49,500	268,785.00	0.17
15 5	Cathay Pacific Airways Ltd	国泰航 空	293 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	35,000	266,373.11	0.16
15 6	QUALCOMM Inc	高通公 司	QCOM UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	343	262,631.03	0.16
15 7	Greenland Holdings Corp Ltd	绿地控 股	600606 CH	上海证 券交易 所	中国	88,100	262,538.00	0.16
15 8	Linde PLC	林德公 共有限 公司	LIN UN	纽约证 券交易 所	美国	113	256,703.59	0.16
15 9	Amerisour ceBergen Corp	美源伯 根	ABC UN	纽约证 券交易 所	美国	222	256,211.06	0.16
16 0	Campbell Soup Co	金宝汤	CPB UN	纽约证 券交易 所	美国	644	254,535.24	0.16
16 1	Prudentia l Financial Inc	保德信 金融集 团	PRU UN	纽约证 券交易 所	美国	367	254,220.58	0.16
16 2	Sumitomo Corp	住友商 事有限 公司	8053 JT	日本证 券交易 所	日本	2,200	252,951.97	0.16
16 3	Walmart Inc	沃尔玛 股份有 限公司	WMT UN	纽约证 券交易 所	美国	256	252,802.72	0.16
16 4	ABB Ltd	ABB 有 限公司	ABBN SE	瑞士证 券交易 所	瑞士	686	145,200.26	0.09
16	ABB Ltd	ABB 有	ABB UN	纽约证	美国	500	106,070.86	0.07

4		限公司		券交易 所				
16 5	Siemens AG	西门子	SIE GY	德国证 券交易 所	德国	259	249,236.93	0.15
16 6	Loblaw Cos Ltd	Loblaw 有限公 司	L CT	加拿大 证券交 易所	加拿 大	404	248,533.21	0.15
16 7	Affiliate d Managers Group Inc	Affili ated Manage rs 集团 股份有 限公司	AMG UN	纽约证 券交易 所	美国	223	246,058.55	0.15
16 8	UBS Group AG	瑞银集 团	UBSG SE	瑞士证 券交易 所	瑞士	1,887	244,896.32	0.15
16 9	Cigna Corp	信诺集 团	CI UN	纽约证 券交易 所	美国	106	244,610.96	0.15
17 0	Elevance Health Inc	Elevan ce 健康 股份有 限公司	ELV UN	纽约证 券交易 所	美国	68	242,938.90	0.15
17 1	Travelers Cos Inc/The	旅行家 集团	TRV UN	纽约证 券交易 所	美国	186	242,877.47	0.15
17 2	Ryder System Inc	莱德系 统股份 有限公 司	R UN	纽约证 券交易 所	美国	415	241,543.12	0.15
17 3	Tencent Holdings Ltd	腾讯控 股	700 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	800	238,681.74	0.15
17 4	Hewlett Packard Enterpris e Co	慧与	HPE UN	纽约证 券交易 所	美国	2,117	235,315.17	0.15
17 5	BNP Paribas SA	法国巴 黎银行	BNP FP	巴黎证 券交易 所	法国	594	234,790.04	0.15
17 6	Procter & Gamble Co/The	宝洁	PG UN	纽约证 券交易 所	美国	222	234,333.16	0.15

177	Telstra Group Ltd	Telstra Group Ltd	TLS AT	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	12,423	233,652.55	0.14
178	Toronto-Dominion Bank/The	多伦多道明银行	TD CT	加拿大证券交易所	加拿大	261	117,578.49	0.07
178	Toronto-Dominion Bank/The	多伦多道明银行	TD UN	纽约证券交易所	美国	249	112,305.85	0.07
179	Texas Instruments Inc	德州仪器	TXN UW	纳斯达克证券交易所	美国	197	226,686.17	0.14
180	Lam Research Corp	泛林集团	LRCX UW	纳斯达克证券交易所	美国	77	225,396.05	0.14
181	3i Group PLC	3i 集团公共股份有限公司	III LN	伦敦证券交易所	英国	1,992	224,312.85	0.14
182	Caesars Entertainment Inc	凯撒娱乐集团	CZR UW	纳斯达克证券交易所	美国	771	223,379.79	0.14
183	APA Corp	APA	APA UW	纳斯达克证券交易所	美国	686	223,023.76	0.14
184	Pembina Pipeline Corp	彭比纳管道公司	PPL CT	加拿大证券交易所	加拿大	944	222,940.19	0.14
185	EOG Resources Inc	EOG 资源	EOG UN	纽约证券交易所	美国	247	222,807.58	0.14
186	Domino's Pizza Inc	达美乐披萨公司	DPZ UN	纽约证券交易所	美国	91	219,540.91	0.14
187	Alimentation Couche-Tard Inc	Alimentation Couche-Tard 公司	ATD CT	加拿大证券交易所	加拿大	715	218,604.64	0.14
188	Bunge Ltd	邦吉有限公司	BG UN	纽约证券交易所	美国	313	217,490.60	0.13
189	China Taiping	中国太平	966 HK	香港证券交易所	中国香港	25,000	217,064.61	0.13

	Insurance Holdings Co Ltd			所				
190	Bayerische Motoren Werke AG	宝马汽车股份公司	BMW GY	德国证券交易所	德国	349	216,003.57	0.13
191	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	816	215,958.32	0.13
192	FMC Corp	FMC 公司	FMC UN	纽约证券交易所	美国	245	212,949.61	0.13
193	Chubb Ltd	邱博保险集团	CB UN	纽约证券交易所	美国	138	212,021.92	0.13
194	Dillard's Inc	Dillard's 公司	DDS UN	纽约证券交易所	美国	94	211,590.12	0.13
195	Exelon Corp	Exelon 公司	EXC UW	纳斯达克证券交易所	美国	702	211,357.92	0.13
196	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	188	210,333.15	0.13
197	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	609	209,654.45	0.13
198	Macy's Inc	梅西百货股份有限公司	M UN	纽约证券交易所	美国	1,448	208,249.90	0.13
199	Vertex Pharmaceuticals Inc	福泰制药	VRTX UW	纳斯达克证券交易所	美国	103	207,157.43	0.13
200	United Overseas Bank Ltd	新加坡大华银行	UOB SP	新加坡证券交易所	新加坡	1,300	206,857.52	0.13

201	China Vanke Co Ltd	万科	000002 CH	深圳证券交易所	中国	11,200	203,840.00	0.13
202	Commercial Metals Co	美国商业金属公司	CMC UN	纽约证券交易所	美国	605	203,516.06	0.13
203	C&D International Investment Group Ltd	建发国际集团	1908 HK	香港证券交易所	中国香港	10,000	203,218.93	0.13
204	WH Group Ltd	万洲国际	288 HK	香港证券交易所	中国香港	50,000	202,772.29	0.13
205	Caterpillar Inc	卡特彼勒	CAT UN	纽约证券交易所	美国	120	200,212.75	0.12
206	Intel Corp	英特尔	INTC UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,078	198,432.18	0.12
207	Etsy Inc	Etsy 股份有限公司	ETSY UW	纳斯达克证券交易所	美国	237	197,710.09	0.12
208	Engie SA	Engie	ENGI FP	巴黎证券交易所	法国	1,986	197,364.30	0.12
209	Nippon Yusen KK	日本邮船株式会社	9101 JT	日本证券交易所	日本	1,200	195,400.06	0.12
210	Hua Hong Semiconductor Ltd	华虹半导体	1347 HK	香港证券交易所	中国香港	8,000	194,732.86	0.12
211	Jazz Pharmaceuticals PLC	爵士制药公司	JAZZ UW	纳斯达克证券交易所	美国	175	194,167.82	0.12
212	Onto Innovation Inc	Onto 创新股份有限公司	ONTO UN	纽约证券交易所	美国	409	193,955.82	0.12
213	China Overseas Land & Investment	中国海外发展	688 HK	香港证券交易所	中国香港	10,500	193,214.30	0.12

	t Ltd							
214	Hermes International	爱马仕国际公司	RMS FP	巴黎证券交易所	法国	18	193,069.63	0.12
215	Carrefour SA	家乐福	CA FP	巴黎证券交易所	法国	1,660	192,716.30	0.12
216	Adobe Inc	奥多比	ADBE UW	纳斯达克证券交易所	美国	82	192,191.34	0.12
217	Barclays PLC	巴克莱	BARC LN	伦敦证券交易所	英国	14,306	190,360.31	0.12
218	Ganfeng Lithium Group Co Ltd	赣锋锂业	1772 HK	香港证券交易所	中国香港	3,640	189,562.61	0.12
219	Power Construction Corp of China Ltd	中国电建	601669 CH	上海证券交易所	中国	26,500	187,620.00	0.12
220	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	188	184,473.59	0.11
221	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	319	183,224.21	0.11
222	Gartner Inc	Gartner 公司	IT UN	纽约证券交易所	美国	78	182,604.29	0.11
223	Delta Air Lines Inc	达美航空有限公司	DAL UN	纽约证券交易所	美国	796	182,169.98	0.11
224	ExlService Holdings Inc	ExlService 控股公司	EXLS UW	纳斯达克证券交易所	美国	153	180,541.86	0.11
225	ZTO Express Cayman Inc	中通快递	ZTO UN	纽约证券交易所	美国	959	179,466.11	0.11

22 6	Estee Lauder Cos Inc/The	雅诗兰 黛	EL UN	纽约证 券交易 所	美国	102	176,254.66	0.11
22 7	Goldman Sachs Group Inc/The	高盛	GS UN	纽约证 券交易 所	美国	73	174,579.82	0.11
22 8	Air China Ltd	中国国 航	753 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	28,000	173,830.34	0.11
22 9	JD.com Inc	京东集 团	9618 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	878	172,700.89	0.11
23 0	Sinopharm Group Co Ltd	国药控 股	1099 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	9,600	170,135.78	0.11
23 1	Vinci SA	万喜集 团	DG FP	巴黎证 券交易 所	法国	245	169,658.17	0.11
23 2	Valero Energy Corp	Valero 能源	VLO UN	纽约证 券交易 所	美国	192	169,637.60	0.11
23 3	Home Depot Inc/The	家得宝	HD UN	纽约证 券交易 所	美国	77	169,387.57	0.10
23 4	Cisco Systems Inc	思科系 统股份 有限公司	CSCO UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	507	168,219.33	0.10
23 5	Kinder Morgan Inc	特拉华 州金德 摩根公 司	KMI UN	纽约证 券交易 所	美国	1,330	167,473.56	0.10
23 6	Raymond James Financial Inc	Raymon d James 金融股 份有限 公司	RJF UN	纽约证 券交易 所	美国	223	165,949.35	0.10
23 7	Shanghai Pharmaceu ticals Holding Co Ltd	上海医 药	2607 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	14,200	164,643.95	0.10

23 8	Booz Allen Hamilton Holding Corp	博思艾 伦咨询 控股公 司	BAH UN	纽约证 券交易 所	美国	224	163,058.56	0.10
23 9	Resona Holdings Inc	理索纳 控股株 式会社	8308 JT	日本证 券交易 所	日本	4,300	162,820.81	0.10
24 0	Intuit Inc	Intuit 股份有 限公司	INTU UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	60	162,645.70	0.10
24 1	China Energy Engineeri ng Corp Ltd	中国能 建	3996 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	200,000	162,575.14	0.10
24 2	Synopsys Inc	新思科 技公司	SNPS UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	73	162,332.08	0.10
24 3	China Water Affairs Group Ltd	中国水 务	855 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	28,000	161,324.56	0.10
24 4	Citigroup Inc	花旗集 团	C UN	纽约证 券交易 所	美国	510	160,654.52	0.10
24 5	Shaanxi Coal Industry Co Ltd	陕西煤 业	601225 CH	上海证 券交易 所	中国	8,600	159,788.00	0.10
24 6	PVH Corp	PVH 公 司	PVH UN	纽约证 券交易 所	美国	325	159,780.11	0.10
24 7	American Express Co	美国运 通	AXP UN	纽约证 券交易 所	美国	154	158,469.03	0.10
24 8	Sempra Energy	桑普拉 能源	SRE UN	纽约证 券交易 所	美国	147	158,217.46	0.10
24 9	Accenture PLC	埃森哲 公司	ACN UN	纽约证 券交易 所	美国	85	157,966.88	0.10
25 0	T-Mobile US Inc	T-Mobi le US	TMUS UW	纳斯达 克证券	美国	161	156,982.08	0.10

		股份有 限公司		交易所				
25 1	Automatic Data Processin g Inc	ADP 公 司	ADP UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	94	156,375.05	0.10
25 2	Meituan	美团一 W	3690 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	1,000	156,054.27	0.10
25 3	Fair Isaac Corp	费埃哲 公司	FICO UN	纽约证 券交易 所	美国	37	154,248.20	0.10
25 4	General Motors Co	通用汽 车公司	GM UN	纽约证 券交易 所	美国	651	152,522.23	0.09
25 5	Dongfeng Motor Group Co Ltd	东风集 团股份	489 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	38,000	152,070.28	0.09
25 6	China National Building Material Co Ltd	中国建 材	3323 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	26,000	148,872.38	0.09
25 7	Nexstar Media Group Inc	Nexsta r 媒体 集团股 份有限 公司	NXST UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	122	148,719.70	0.09
25 8	BlackRock Inc	贝莱德 有限公司	BLK UN	纽约证 券交易 所	美国	30	148,059.73	0.09
25 9	Enphase Energy Inc	Enphas e 能源 股份有 限公司	ENPH UQ	纳斯达 克证券 交易所	美国	80	147,627.23	0.09
26 0	Central China New Life Ltd	建业新 生活	9983 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	54,000	146,639.20	0.09
26 1	Hershey Co/The	好时公 司	HSY UN	纽约证 券交易 所	美国	90	145,151.32	0.09
26 2	Ovintiv Inc	Ovinti v 股份	OVV UN	纽约证 券交易	美国	409	144,448.52	0.09

		有限公司		所				
263	HCA Healthcare Inc	HCA 医疗保健有限公司	HCA UN	纽约证券交易所	美国	86	143,725.39	0.09
264	Man Group PLC/Jersey	Man Group PLC/Jersey	EMG LN	伦敦证券交易所	英国	7,973	143,021.19	0.09
265	International Business Machines Corp	国际商业机器	IBM UN	纽约证券交易所	美国	145	142,280.16	0.09
266	Las Vegas Sands Corp	拉斯维加斯金沙集团	LVS UN	纽约证券交易所	美国	423	141,615.46	0.09
267	Bank of Montreal	蒙特利尔银行	BMO CT	加拿大证券交易所	加拿大	224	141,184.60	0.09
268	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	287	140,418.52	0.09
269	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	115	139,233.50	0.09
270	Xiamen C & D Inc	建发股份	600153 CH	上海证券交易所	中国	10,200	139,230.00	0.09
271	State Street Corp	道富集团	STT UN	纽约证券交易所	美国	256	138,302.47	0.09
272	Tsingtao Brewery Co Ltd	青岛啤酒	168 HK	香港证券交易所	中国香港	2,000	137,742.23	0.09
273	Poly Developments and Holdings Group Co Ltd	保利发展	600048 CH	上海证券交易所	中国	9,100	137,683.00	0.09

27 4	AutoZone Inc	AutoZone 股份有限公司	AZO UN	纽约证 券交易 所	美国	8	137,407.66	0.09
27 5	Principal Financial Group Inc	信安金 融	PFG UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	232	135,596.86	0.08
27 6	Equinor ASA	挪威国 家石油 公司	EQNR UN	纽约证 券交易 所	美国	530	132,183.23	0.08
27 7	Union Pacific Corp	联合太 平洋	UNP UN	纽约证 券交易 所	美国	91	131,236.53	0.08
27 8	AES Corp/The	爱伊斯 公司	AES UN	纽约证 券交易 所	美国	654	130,997.44	0.08
27 9	Sandvik AB	山特维 克股份 公司	SAND SS	斯德哥 尔摩证 券交易 所	瑞典	1,044	130,977.96	0.08
28 0	Commonwea lth Bank of Australia	澳大利 亚联邦 银行	CBA AT	澳大利 亚证券 交易所	澳大 利亚	268	129,614.42	0.08
28 1	GXO Logistics Inc	GXO Logist ics 股 份有限 公司	GXO UN	纽约证 券交易 所	美国	434	129,036.35	0.08
28 2	Novo Nordisk A/S	诺和诺 德公司	NVO UN	纽约证 券交易 所	美国	136	128,192.10	0.08
28 3	China Qinfa Group Ltd	中国秦 发	866 HK	香港证 券交易 所	中 国 香 港	640,000	128,059.19	0.08
28 4	Koninklij ke Ahold Delhaize NV	皇家阿 霍德德 尔海兹 集团	AD NA	阿姆斯 特丹交 易所	荷 兰	637	126,909.92	0.08
28 5	Group 1 Automotiv e Inc	第一汽 车集团 公司	GPI UN	纽约证 券交易 所	美国	101	126,876.70	0.08
28 6	W R Berkley	WR Berkle	WRB UN	纽约证 券交易	美国	251	126,860.68	0.08

	Corp	y 公司		所				
28 7	Investor AB	瑞典银 瑞达集 团	INVEB SS	斯德哥 尔摩证 券交易 所	瑞典	1,005	126,192.18	0.08
28 8	Swiss Life Holding AG	瑞士人 寿控股 公司	SLHN SE	瑞士证 券交易 所	瑞士	35	125,880.92	0.08
28 9	Dai-ichi Life Holdings Inc	第一生 命控股 株式会 社	8750 JT	日本证 券交易 所	日本	800	125,407.88	0.08
29 0	CNH Industria l NV	凯斯纽 荷兰工 业集团	CNHI IM	意大利 证券交 易所	意 大 利	1,125	124,969.20	0.08
29 1	Block Inc	Block 股份有 限公司	SQ UN	纽约证 券交易 所	美国	281	122,981.19	0.08
29 2	Sompo Holdings Inc	损保控 股株式 会社	8630 JT	日本证 券交易 所	日本	400	122,727.15	0.08
29 3	Woodside Energy Group Ltd	伍德赛 德能源 集团有 限公司	WDS AT	澳大利 亚证券 交易所	澳 大 利亚	732	122,285.78	0.08
29 4	Northrop Grumman Corp	诺斯洛 普格鲁 门公司	NOC UN	纽约证 券交易 所	美国	32	121,598.57	0.08
29 5	Duke Energy Corp	杜克能 源	DUK UN	纽约证 券交易 所	美国	167	119,786.45	0.07
29 6	Chesapeak e Energy Corp	切萨皮 克能源 公司	CHK UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	182	119,619.37	0.07
29 7	BAE Systems PLC	英国宇 航系统	BA/ LN	伦敦证 券交易 所	英国	1,659	119,204.95	0.07
29 8	Wells Fargo & Co	富国银 行	WFC UN	纽约证 券交易 所	美国	411	118,190.59	0.07
29 9	MongoDB Inc	MongoD B 股份 有限公	MDB UQ	纳斯达 克证券 交易所	美国	86	117,898.42	0.07

		司						
300	Boston Scientific Corp	波士顿科学	BSX UN	纽约证券交易所	美国	359	115,688.48	0.07
301	Marathon Petroleum Corp	马拉松石油公司	MPC UN	纽约证券交易所	美国	142	115,106.59	0.07
302	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	141	113,981.74	0.07
303	COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd	中远海控	1919 HK	香港证券交易所	中国香港	16,000	113,766.87	0.07
304	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	华侨银行有限公司	OCBC SP	新加坡证券交易所	新加坡	1,800	113,634.28	0.07
305	Diageo PLC	帝亚吉欧	DGE LN	伦敦证券交易所	英国	370	113,362.32	0.07
306	DoorDash Inc	DoorDash 股份有限公司	DASH UN	纽约证券交易所	美国	333	113,223.92	0.07
307	Pernod Ricard SA	保乐力加股份有限公司	RI FP	巴黎证券交易所	法国	83	113,208.50	0.07
308	3M Co	3M 公司	MMM UN	纽约证券交易所	美国	135	112,751.30	0.07
309	Juniper Networks Inc	瞻博网络股份有限公司	JNPR UN	纽约证券交易所	美国	502	111,739.49	0.07
310	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	三菱日联金融集团	8306 JT	日本证券交易所	日本	2,400	111,711.03	0.07
311	Martin Marietta Materials	Martin Marietta 材	MLM UN	纽约证券交易所	美国	47	110,629.82	0.07

	Inc	料股份 有限公司						
31 2	CenterPoint Energy Inc	中点能源	CNP UN	纽约证券交易所	美国	525	109,655.89	0.07
31 3	Tenaris SA	特纳股份公司	TEN IM	意大利证券交易所	意大利	905	109,398.18	0.07
31 4	AIA Group Ltd	友邦保险	1299 HK	香港证券交易所	中国香港	1,400	108,550.17	0.07
31 5	Assicurazioni Generali SpA	忠利保险	G IM	意大利证券交易所	意大利	878	108,285.04	0.07
31 6	Moderna Inc	莫德纳公司	MRNA UW	纳斯达克证券交易所	美国	86	107,584.40	0.07
31 7	Xerox Holdings Corp	Xerox Holdings Corp	XRX UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,057	107,479.10	0.07
31 8	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	Mediobanca 公共有限公司	MB IM	意大利证券交易所	意大利	1,593	106,232.91	0.07
31 9	Komatsu Ltd	小松制作所	6301 JT	日本证券交易所	日本	700	105,407.13	0.07
32 0	Vipshop Holdings Ltd	唯品会控股有限公司	VIPS UN	纽约证券交易所	美国	1,109	105,351.83	0.07
32 1	Intuitive Surgical Inc	直觉外科手术公司	ISRG UW	纳斯达克证券交易所	美国	57	105,339.23	0.07
32 2	Hitachi Ltd	日立	6501 JT	日本证券交易所	日本	300	105,098.21	0.07
32 3	Sony Group Corp	索尼集团公司	6758 JT	日本证券交易所	日本	200	105,082.51	0.07
32	Lloyds	劳埃德	LLOY LN	伦敦证	英国	27,422	104,526.10	0.06

4	Banking Group PLC	银行集团		券交易所				
325	Suncor Energy Inc	森科能源公司	SU CT	加拿大证券交易所	加拿大	470	103,728.33	0.06
326	Mitsui OSK Lines Ltd	商船三井	9104 JT	日本证券交易所	日本	600	103,354.69	0.06
327	Futu Holdings Ltd	富途控股有限公司	FUTU UQ	纳斯达克证券交易所	美国	365	103,335.51	0.06
328	US Bancorp	美国合众银行	USB UN	纽约证券交易所	美国	339	102,963.18	0.06
329	Rio Tinto PLC	力拓公司	RIO UN	纽约证券交易所	美国	205	101,655.30	0.06
330	Simon Property Group Inc	西蒙房地产集团公司	SPG UN	纽约证券交易所	美国	124	101,456.95	0.06
331	NiSource Inc	NiSource 公司	NI UN	纽约证券交易所	美国	527	100,640.84	0.06
332	Pop Mart International Group Ltd	泡泡玛特	9992 HK	香港证券交易所	中国香港	5,600	99,145.82	0.06
333	Indivior PLC	Indivior 公共有限公司	INDV LN	伦敦证券交易所	英国	637	99,027.21	0.06
334	AT&T Inc	美国电话电报公司	T UN	纽约证券交易所	美国	769	98,599.86	0.06
335	Canadian National Railway Co	加拿大国家铁路公司	CNR CT	加拿大证券交易所	加拿大	119	98,350.68	0.06
336	Atmos Energy Corp	Atmos 能源公司	ATO UN	纽约证券交易所	美国	126	98,345.86	0.06
337	360 DigiTech Inc	360 数科	QFIN UW	纳斯达克证券交易所	美国	693	98,266.88	0.06

338	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	7	98,249.33	0.06
339	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	6	97,959.75	0.06
340	Alstom SA	阿尔斯通股份有限公司	ALO FP	巴黎证券交易所	法国	569	96,383.24	0.06
341	Enbridge Inc	安桥公司	ENB CT	加拿大证券交易所	加拿大	353	95,991.09	0.06
342	Anheuser-Busch InBev SA/NV	百威英博股份有限公司	ABI BB	布鲁塞尔证券交易所	比利时	226	94,397.17	0.06
343	Lamb Weston Holdings Inc	蓝威斯顿控股股份有限公司	LW UN	纽约证券交易所	美国	151	93,975.86	0.06
344	Cie Financiere Richemont SA	瑞士历峰集团	CFR SE	瑞士证券交易所	瑞士	103	93,156.26	0.06
345	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	161	92,944.61	0.06
346	Halliburton Co	哈利伯顿	HAL UN	纽约证券交易所	美国	339	92,905.33	0.06
347	Vertiv Holdings Co	维谛技术	VRT UN	纽约证券交易所	美国	972	92,472.62	0.06
348	Shenzhen International Holdings Ltd	深圳国际	152 HK	香港证券交易所	中国香港	13,500	92,373.05	0.06
349	iQIYI Inc	爱奇艺	IQ UW	纳斯达克证券	美国	2,499	92,244.04	0.06

				交易所				
350	Weibo Corp	微博公司	WB UW	纳斯达克证券交易所	美国	692	92,148.90	0.06
351	Gilead Sciences Inc	吉利德科学	GILD UW	纳斯达克证券交易所	美国	154	92,078.28	0.06
352	Enel SpA	恩耐股份有限公司	ENEL IM	意大利证券交易所	意大利	2,456	91,700.13	0.06
353	Daiwa Securities Group Inc	大和证券	8601 JT	日本证券交易所	日本	3,000	91,574.14	0.06
354	Teradyne Inc	泰瑞达	TER UW	纳斯达克证券交易所	美国	149	90,645.31	0.06
355	Teleflex Inc	泰利福公司	TFX UN	纽约证券交易所	美国	52	90,405.80	0.06
356	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	香港交易所	388 HK	香港证券交易所	中国香港	300	90,363.19	0.06
357	Pacific Basin Shipping Ltd	太平洋航运	2343 HK	香港证券交易所	中国香港	38,000	89,612.85	0.06
358	Kunlun Energy Co Ltd	昆仑能源	135 HK	香港证券交易所	中国香港	18,000	89,559.25	0.06
359	BASF SE	巴斯夫欧洲公司	BAS GY	德国证券交易所	德国	259	89,186.22	0.06
360	Logitech International SA	罗技国际股份有限公司	LOGI UW	纳斯达克证券交易所	美国	205	88,877.00	0.06
361	Kuaishou Technology	快手	1024 HK	香港证券交易所	中国香港	1,400	88,853.57	0.05
362	Five9 Inc	Five9 公司	FIVN UQ	纳斯达克证券交易所	美国	188	88,852.14	0.05

				交易所				
363	Verizon Communications Inc	Verizon 通信股份有限公司	VZ UN	纽约证券交易所	美国	323	88,632.89	0.05
364	TravelSky Technology Ltd	中国民航信息网络	696 HK	香港证券交易所	中国香港	6,000	88,433.73	0.05
365	Air Products and Chemicals Inc	空气产品公司	APD UN	纽约证券交易所	美国	41	88,023.21	0.05
366	Credicorp Ltd	Credicorp 有限公司	BAP UN	纽约证券交易所	美国	93	87,868.04	0.05
367	BrightSphere Investment Group Inc	BrightSphere 投资集团有限公司	BSIG UN	纽约证券交易所	美国	612	87,718.86	0.05
368	Everest Re Group Ltd	安富来集团有限公司	RE UN	纽约证券交易所	美国	38	87,672.20	0.05
369	MSCI Inc	MSCI 明晟	MSCI UN	纽约证券交易所	美国	27	87,472.52	0.05
370	Metro Inc/CN	麦德龙股份有限公司	MRU CT	加拿大证券交易所	加拿大	226	87,062.74	0.05
371	Emerson Electric Co	艾默生电气	EMR UN	纽约证券交易所	美国	130	86,972.53	0.05
372	Atlas Copco AB	阿特拉斯·科普柯集团	ATCOASS	斯德哥尔摩证券交易所	瑞典	1,060	86,892.19	0.05
373	L'Oreal SA	欧莱雅	OR FP	巴黎证券交易所	法国	35	86,669.78	0.05
374	Workday Inc	Workday 股份有限公司	WDAY UW	纳斯达克证券交易所	美国	74	86,238.60	0.05

375	Capri Holdings Ltd	Capri 控股有限公司	CPRI UN	纽约证券交易所	美国	216	86,229.55	0.05
376	Anglo American PLC	英美公司	AAL LN	伦敦证券交易所	英国	316	85,849.31	0.05
377	Pandora A/S	潘多拉公司	PANDY UV	纽约证券交易所	美国	700	85,828.25	0.05
378	FedEx Corp	联邦快递	FDX UN	纽约证券交易所	美国	71	85,645.08	0.05
379	Sterling Infrastructure Inc	Sterling 基础设施股份有限公司	STRL UW	纳斯达克证券交易所	美国	374	85,436.14	0.05
380	IMCD NV	艾敏斯帝公众有限公司	IMCD NA	阿姆斯特丹交易所	荷兰	86	84,998.89	0.05
381	Under Armour Inc	安德玛股份有限公司	UAA UN	纽约证券交易所	美国	1,200	84,912.40	0.05
382	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	190	84,411.65	0.05
383	Xponential Fitness Inc	Xponential Fitness Inc	XPOF UN	纽约证券交易所	美国	528	84,320.69	0.05
384	AIXTRON SE	爱思强股份有限公司	AIXA GY	德国证券交易所	德国	419	83,881.96	0.05
385	Franklin Resources Inc	富兰克林资源	BEN UN	纽约证券交易所	美国	455	83,595.40	0.05
386	Science Applications International Corp	科学应用国际公司	SAIC UN	纽约证券交易所	美国	108	83,438.97	0.05

387	adidas AG	阿迪达斯公司	ADS GY	德国证券交易所	德国	88	83,258.81	0.05
388	Huntington Bancshares Inc/OH	杭庭顿银行	HBAN UW	纳斯达克证券交易所	美国	846	83,077.93	0.05
389	American Tower Corp	美国发射塔公司	AMT UN	纽约证券交易所	美国	56	82,629.13	0.05
390	Skechers USA Inc	斯凯奇美国公司	SKX UN	纽约证券交易所	美国	282	82,390.52	0.05
391	Dow Inc	陶氏公司	DOW UN	纽约证券交易所	美国	234	82,121.41	0.05
392	China Merchants Port Holdings Co Ltd	招商局港口	144 HK	香港证券交易所	中国香港	8,000	81,752.07	0.05
393	Ulta Beauty Inc	Ulta 美容产品公司	ULTA UW	纳斯达克证券交易所	美国	25	81,672.12	0.05
394	SAP SE	SAP 公司	SAP GY	德国证券交易所	德国	114	81,566.24	0.05
395	Phillips 66	Phillips 66	PSX UN	纽约证券交易所	美国	112	81,186.06	0.05
396	Kering SA	开云集团	KER FP	巴黎证券交易所	法国	23	81,180.55	0.05
397	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	309	81,132.71	0.05
398	DocuSign Inc	DocuSign 股份有限公司	DOCU UW	纳斯达克证券交易所	美国	210	81,055.41	0.05
399	Carrier Global	开利全球公司	CARR UN	纽约证券交易所	美国	280	80,441.13	0.05

	Corp			所				
400	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	16	80,398.23	0.05
401	FNB Corp/PA	FNB/宾州	FNB UN	纽约证券交易所	美国	883	80,254.13	0.05
402	Qorvo Inc	Qorvo 股份有限公司	QRVO UW	纳斯达克证券交易所	美国	127	80,171.46	0.05
403	Norsk Hydro ASA	挪威海德鲁公司	NHYDY UV	纽约证券交易所	美国	1,528	80,133.57	0.05
404	Liberty Global PLC	自由全球公司	LBTYA UW	纳斯达克证券交易所	美国	607	80,026.81	0.05
405	Jefferies Financial Group Inc	杰富瑞金融集团	JEF UN	纽约证券交易所	美国	334	79,741.33	0.05
406	Dexcom Inc	Dexcom 股份有限公司	DXCM UW	纳斯达克证券交易所	美国	100	78,867.13	0.05
407	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	32	78,808.07	0.05
408	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	301	78,319.43	0.05
409	London Stock Exchange Group PLC	伦敦证券交易所	LSEG LN	伦敦证券交易所	英国	129	77,271.38	0.05
410	MetLife Inc	大都会集团	MET UN	纽约证券交易所	美国	153	77,116.30	0.05
411	Intact Financial Corp	Intact 金融公司	IFC CT	加拿大证券交易所	加拿大	76	76,117.42	0.05
412	Toyota Motor Corp	丰田汽车	7203 JT	日本证券交易所	日本	800	75,919.10	0.05

413	Matador Resources Co	Matador 资源公司	MTDR UN	纽约证券交易所	美国	188	74,946.90	0.05
414	Trade Desk Inc/The	Trade Desk 股份有限公司	TTD UQ	纳斯达克证券交易所	美国	237	73,996.86	0.05
415	World Wrestling Entertainment Inc	世界摔角娱乐公司	WWE UN	纽约证券交易所	美国	155	73,968.23	0.05
416	XPeng Inc	小鹏汽车	XPEV UN	纽约证券交易所	美国	1,035	71,651.11	0.04
417	T Rowe Price Group Inc	普徠仕	TROW UW	纳斯达克证券交易所	美国	93	70,639.01	0.04
418	NN Group NV	NN 集团公众有限公司	NN NA	阿姆斯特丹交易所	荷兰	247	69,964.69	0.04
419	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	71	69,000.66	0.04
420	Marvell Technology Inc	美满电子科技公司	MRVL UW	纳斯达克证券交易所	美国	266	68,619.70	0.04
421	Molson Coors Beverage Co	莫尔森库尔斯饮料公司	TAP UN	纽约证券交易所	美国	191	68,533.89	0.04
422	Corteva Inc	科迪华公司	CTVA UN	纽约证券交易所	美国	167	68,366.32	0.04
423	Societe Generale SA	法国兴业银行	GLE FP	巴黎证券交易所	法国	385	67,101.53	0.04
424	JD Health International Inc	京东健康	6618 HK	香港证券交易所	中国香港	1,050	66,921.56	0.04
425	ArcelorMittal SA	安赛乐米塔尔	MT UN	纽约证券交易所	美国	364	66,470.70	0.04

				所				
42 6	Okta Inc	Okta Inc	OKTA UW	纳斯达克 证券交易 所	美国	139	66,148.87	0.04
42 7	Dassault Systemes SE	达索系 统公司	DSY FP	巴黎证 券交易 所	法国	266	66,135.59	0.04
42 8	Verbund AG	维邦电 力公司	VER AV	维也纳 证券交 易所	奥地 利	113	65,970.65	0.04
42 9	Bank of Nova Scotia/Th e	加拿大 丰业银 行	BNS CT	加拿大 证券交 易所	加拿 大	193	65,791.40	0.04
43 0	HEICO Corp	海科航 空公司	HEI UN	纽约证 券交易 所	美国	61	65,272.51	0.04
43 1	Weatherfo rd Internati onal PLC	威德福 国际公 共有限 公司	WFRD UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	182	64,544.01	0.04
43 2	National Australia Bank Ltd	澳大利 亚国民 银行有 限公司	NAB AT	澳大利 亚证券 交易所	澳大 利亚	455	64,472.06	0.04
43 3	Carnival Corp	嘉年华 公司	CCL UN	纽约证 券交易 所	美国	1,127	63,263.78	0.04
43 4	SITC Internati onal Holdings Co Ltd	海丰国 际	1308 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	4,000	62,028.67	0.04
43 5	Ford Motor Co	福特汽 车	F UN	纽约证 券交易 所	美国	753	60,991.72	0.04
43 6	Elia Group SA/NV	伊利亚 系统经 运商公 司	ELI BB	布鲁塞 尔证券 交易所	比利 时	60	59,145.67	0.04
43 7	Omnicom Group Inc	Omnico m集团	OMC UN	纽约证 券交易 所	美国	103	58,514.55	0.04
43	Alcoa	美国铝	AA UN	纽约证	美国	184	58,269.19	0.04

8	Corp	业公司		券交易 所				
43 9	MaxLinear Inc	美国 MaxLin ear 股 份有限 公司	MXL UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	243	57,456.91	0.04
44 0	InterCont inental Hotels Group PLC	洲际酒 店集团	IHG LN	伦敦证 券交易 所	英国	144	57,343.12	0.04
44 1	KeyCorp	KeyCor p 公司	KEY UN	纽约证 券交易 所	美国	466	56,536.67	0.03
44 2	Southern Copper Corp	南方铜 业公司	SCCO UN	纽约证 券交易 所	美国	133	55,938.76	0.03
44 3	Paychex Inc	Payche x 公司	PAYX UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	67	53,923.55	0.03
44 4	Colgate-P almolive Co	高露洁 棕榄	CL UN	纽约证 券交易 所	美国	98	53,776.60	0.03
44 5	Allianz SE	安联保 险有限 公司	ALV GY	德国证 券交易 所	德国	36	53,685.38	0.03
44 6	Restauran t Brands Internati onal Inc	Restau rant Brands Intern ationa l 股份 有限公 司	QSR UN	纽约证 券交易 所	美国	119	53,597.68	0.03
44 7	Chindata Group Holdings Ltd	秦淮数 据集团	CD UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	960	53,287.55	0.03
44 8	Fluor Corp	福陆	FLR UN	纽约证 券交易 所	美国	218	52,623.68	0.03
44 9	IDEX Corp	艺达思 集团	IEX UN	纽约证 券交易 所	美国	33	52,477.49	0.03

450	Xinyi Glass Holdings Ltd	信义玻璃	868 HK	香港证券交易所	中国香港	4,000	51,952.58	0.03
451	Johnson & Johnson	强生	JNJ UN	纽约证券交易所	美国	42	51,672.46	0.03
452	Moncler SpA	Moncler 股份有限公司	MONC IM	意大利证券交易所	意大利	139	51,073.26	0.03
453	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	146	50,821.24	0.03
454	Ferrari NV	法拉利	RACE UN	纽约证券交易所	美国	34	50,726.52	0.03
455	PNC Financial Services Group Inc/The	PNC 财务服务	PNC UN	纽约证券交易所	美国	46	50,599.49	0.03
456	Five Below Inc	Five Below 股份有限公司	FIVE UW	纳斯达克证券交易所	美国	41	50,504.98	0.03
457	Equinix Inc	Equinix 有限公司	EQIX UW	纳斯达克证券交易所	美国	11	50,182.24	0.03
458	Cameco Corp	Cameco 公司	CCO CT	加拿大证券交易所	加拿大	318	50,148.78	0.03
459	Veritiv Corp	Veritiv 有限公司	VRTV UN	纽约证券交易所	美国	59	50,012.03	0.03
460	Splunk Inc	Splunk 公司	SPLK UW	纳斯达克证券交易所	美国	83	49,765.34	0.03
461	Wyndham Hotels & Resorts Inc	温德姆酒店与度假村股份有限公司	WH UN	纽约证券交易所	美国	100	49,664.56	0.03

46 2	Mr Cooper Group Inc	Mr Cooper 集团股 份有限 公司	COOP UR	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	177	49,469.62	0.03
46 3	Genmab A/S	Genmab 股份 有限 公司	GMAB UW	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	166	48,996.52	0.03
46 4	Keppel Corp Ltd	吉宝 企 业 有 限 公 司	KEP SP	新加 坡 证 券 交 易 所	新加 坡	1,300	48,918.10	0.03
46 5	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	住友 金 属 矿 山 株 式 会 社	5713 JT	日 本 证 券 交 易 所	日本	200	48,912.84	0.03
46 6	Consolida ted Edison Inc	联合 爱 迪 生	ED UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	73	48,457.11	0.03
46 7	Invesco Ltd	景 顺 有 限 公 司	IVZ UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	384	48,112.57	0.03
46 8	Deutsche Post AG	德 国 邮 政 股 份 公 司	DPW GY	德 国 证 券 交 易 所	德国	183	47,788.18	0.03
46 9	Autohome Inc	汽 车 之 家	ATHM UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	222	47,311.92	0.03
47 0	Spirit Airlines Inc	Spirit 航 空 股 份 有 限 公 司	SAVE UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	335	45,449.59	0.03
47 1	PBF Energy Inc	PBF 能 源 股 份 有 限 公 司	PBF UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	160	45,442.62	0.03
47 2	Celsius Holdings Inc	Celsiu s 控 股 股 份 有 限 公 司	CELH UR	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	62	44,925.01	0.03
47 3	TAL Education Group	好 未 来 教 育 集 团	TAL UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	899	44,141.29	0.03
47	NatWest	国民 西	NWG LN	伦 敦 证	英国	1,867	41,561.54	0.03

4	Group PLC	敏寺银行集团公共有限公司		券交易所				
475	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	70	41,536.87	0.03
476	GSK PLC	葛兰素史克公共有限公司	GSK UN	纽约证券交易所	美国	169	41,360.39	0.03
477	Walt Disney Co/The	华特迪士尼公司	DIS UN	纽约证券交易所	美国	66	39,935.57	0.02
478	Datadog Inc	Datadog 股份有限公司	DDOG UW	纳斯达克证券交易所	美国	78	39,928.05	0.02
479	NIPPON EXPRESS HOLDINGS INC	NIPPON EXPRESS HOLDINGS INC	9147 JT	日本证券交易所	日本	100	39,477.93	0.02
480	Legal & General Group PLC	法通集团公共有限公司	LGEN LN	伦敦证券交易所	英国	1,883	39,436.24	0.02
481	China Jinmao Holdings Group Ltd	中国金茂	817 HK	香港证券交易所	中国香港	26,000	39,018.03	0.02
482	Assa Abloy AB	亚萨合莱集团	ASSAB SS	斯德哥尔摩证券交易所	瑞典	252	37,539.06	0.02
483	Brenntag SE	Brenntag	BNR GY	德国证券交易所	德国	81	35,906.94	0.02
484	Shopify Inc	Shopify 股份有限公司	SHOP UN	纽约证券交易所	美国	148	35,777.71	0.02
48	Neurocrin	Neurocrin	NBIX UW	纳斯达克	美国	43	35,769.63	0.02

5	e Biosciences Inc	erine 生物科学股份有限公司		克证券交易所				
486	Adtalem Global Education Inc	Adtalem 环球教育股份有限公司	ATGE UN	纽约证券交易所	美国	141	34,861.31	0.02
487	Norfolk Southern Corp	诺福克南方	NSC UN	纽约证券交易所	美国	20	34,324.33	0.02
488	Analog Devices Inc	亚德诺半导体	ADI UW	纳斯达克证券交易所	美国	30	34,272.10	0.02
489	Guidewire Software Inc	Guidewire 软件公司	GWRE UN	纽约证券交易所	美国	78	33,985.02	0.02
490	Thales SA	泰雷兹集团	HO FP	巴黎证券交易所	法国	38	33,650.97	0.02
491	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	66	32,737.24	0.02
492	ChampionX Corp	ChampionX 公司	CHX UW	纳斯达克证券交易所	美国	160	32,304.60	0.02
493	Coherent Corp	相干公司	COHR UW	纳斯达克证券交易所	美国	131	32,023.93	0.02
494	Southern Co/The	南方公司	SO UN	纽约证券交易所	美国	62	30,835.21	0.02
495	Sea Ltd	Sea 有限公司	SE UN	纽约证券交易所	美国	85	30,801.29	0.02
496	St James's Place PLC	圣占姆士财富管理有限公司	STJ LN	伦敦证券交易所	英国	326	29,964.42	0.02
497	BHP Group Ltd	必和必拓集团	BHP AT	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	135	29,037.24	0.02

498	Wolters Kluwer NV	威科集团	WKL NA	阿姆斯特丹交易所	荷兰	40	29,026.51	0.02
499	Nintendo Co Ltd	任天堂	7974 JT	日本证券交易所	日本	100	28,964.45	0.02
500	HeidelbergCement AG	海德堡水泥股份有限公司	HEI GY	德国证券交易所	德国	73	28,870.92	0.02
501	PerkinElmer Inc	珀金埃尔默	PKI UN	纽约证券交易所	美国	29	28,320.71	0.02
502	Getinge AB	洁定集团	GETIB SS	斯德哥尔摩证券交易所	瑞典	195	28,087.17	0.02
503	NextEra Energy Inc	新纪元能源公司	NEE UN	纽约证券交易所	美国	46	26,783.07	0.02
504	Freshpet Inc	Freshpet 公司	FRPT UQ	纳斯达克证券交易所	美国	72	26,461.58	0.02
505	UniCredit SpA	裕信银行公共有限公司	UCG IM	意大利证券交易所	意大利	266	26,205.44	0.02
506	Charter Communications Inc	Charter 通信公司	CHTR UW	纳斯达克证券交易所	美国	11	25,978.65	0.02
507	Newmont Corp	纽蒙黄金公司	NEM UN	纽约证券交易所	美国	79	25,969.60	0.02
508	Ivanhoe Mines Ltd	艾芬豪矿业有限公司	IVN CT	加拿大证券交易所	加拿大	472	25,951.48	0.02
509	RELX PLC	励讯集团	REL LN	伦敦证券交易所	英国	129	24,775.35	0.02
510	Wilmar International Ltd	丰益国际有限公司	WIL SP	新加坡证券交易所	新加坡	1,100	23,774.88	0.01
511	Laboratory Corp of	美国实验控股	LH UN	纽约证券交易所	美国	14	22,960.34	0.01

	America Holdings			所				
512	Albemarle Corp	雅保公司	ALB UN	纽约证券交易所	美国	15	22,655.15	0.01
513	WuXi AppTec Co Ltd	药明康德	2359 HK	香港证券交易所	中国香港	300	22,095.03	0.01
514	British American Tobacco PLC	英美烟草	BATS LN	伦敦证券交易所	英国	77	21,209.88	0.01
515	Standard Chartered PLC	渣打集团	STAN LN	伦敦证券交易所	英国	378	19,748.55	0.01
516	Scotts Miracle-Gro Co/The	Scotts Miracle-Gro 公司	SMG UN	纽约证券交易所	美国	57	19,289.37	0.01
517	Westlake Corp	Westlake 公司	WLK UN	纽约证券交易所	美国	27	19,282.05	0.01
518	Aon PLC	怡安集团	AON UN	纽约证券交易所	美国	8	16,722.84	0.01
519	KKR & Co Inc	KKR & Co Inc	KKR UN	纽约证券交易所	美国	46	14,871.65	0.01
520	First Interstate BancSystem Inc	第一州际银行系统股份有限公司	FIBK UW	纳斯达克证券交易所	美国	54	14,535.82	0.01
521	SM Energy Co	SM 能源公司	SM UN	纽约证券交易所	美国	56	13,584.31	0.01
522	GrainCorp Ltd	GrainCorp 有限公司	GNC AT	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	377	13,186.10	0.01
523	Unum Group	尤纳姆集团	UNM UN	纽约证券交易所	美国	44	12,573.33	0.01
524	Inspire Medical	Inspire 医疗	INSP UN	纽约证券交易所	美国	7	12,279.70	0.01

	Systems Inc	系统股份有限公司		所				
525	Centene Corp	Centene 公司	CNC UN	纽约证券交易所	美国	20	11,423.34	0.01
526	Autodesk Inc	欧特克	ADSK UW	纳斯达克证券交易所	美国	8	10,411.80	0.01
527	Kraft Heinz Co/The	卡夫亨氏公司	KHC UW	纳斯达克证券交易所	美国	36	10,207.04	0.01
528	Sonova Holding AG	索诺瓦控股公司	SOON SE	瑞士证券交易所	瑞士	6	9,925.34	0.01
529	LyondellBasell Industries NV	利安德巴塞尔工业公司	LYB UN	纽约证券交易所	美国	17	9,830.60	0.01
530	Novocure Ltd	Novocure 有限公司	NVCR UW	纳斯达克证券交易所	美国	18	9,195.36	0.01
531	FleetCor Technologies Inc	FleetCor 技术股份有限公司	FLT UN	纽约证券交易所	美国	7	8,954.80	0.01
532	Accellero Industries AG	Accellero Industries AG	ACLN SE	瑞士证券交易所	瑞士	34	4,910.10	0.00
532	Accellero Industries AG	Accellero Industries AG	ACLLY UV	纽约证券交易所	美国	25	3,551.95	0.00
533	Sika AG	瑞士西卡股份公司	SIKA SE	瑞士证券交易所	瑞士	5	8,361.64	0.01
534	Atlas Air Worldwide Holdings Inc	阿特拉斯航空全球控股有限公司	AAWW UW	纳斯达克证券交易所	美国	11	7,722.35	0.00
535	Hilton Worldwide	希尔顿全球控	HLT UN	纽约证	美国	8	7,040.37	0.00

	Holdings Inc	股股份有限公司		所				
536	Carlisle Cos Inc	卡莱股份有限公司	CSL UN	纽约证券交易所	美国	4	6,564.83	0.00
537	Brookfield Infrastructure Corp	Brookfield Infrastructure Corp	BIPC UN	纽约证券交易所	美国	23	6,231.23	0.00
538	Discover Financial Services	Discover 金融服务公司	DFS UN	纽约证券交易所	美国	8	5,450.77	0.00
539	Jinmao Property Services Co Ltd	金茂服务	816 HK	香港证券交易所	中国香港	1,480	5,407.14	0.00
540	Alleima AB	Alleima AB	ALLEISS	斯德哥尔摩证券交易所	瑞典	208	5,321.54	0.00
541	Crown Holdings Inc	Crown 控股股份有限公司	CCK UN	纽约证券交易所	美国	9	5,153.04	0.00
542	Sonic Healthcare Ltd	Sonic 医疗保健有限公司	SHL AT	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	36	5,085.81	0.00
543	Aspen Technology Inc	艾斯本技术有限公司	AZPN UW	纳斯达克证券交易所	美国	3	4,291.59	0.00
544	Airbnb Inc	爱彼迎股份有限公司	ABNB UW	纳斯达克证券交易所	美国	7	4,168.31	0.00
545	TC Energy Corp	TC 能源公司	TRP CT	加拿大证券交易所	加拿大	13	3,605.89	0.00
546	Tyson Foods Inc	泰森食品公司	TSN UN	纽约证券交易所	美国	8	3,468.37	0.00
54	Infineon	英飞凌	IFX GY	德国证	德国	16	3,376.53	0.00

7	Technologies AG	科技有限公司		券交易所				
548	Embecta Corp	Embecta Corp	EMBC UW	纳斯达克证券交易所	美国	13	2,289.75	0.00
549	Auto Trader Group PLC	Auto Trader 集团公共有限公司	AUTO LN	伦敦证券交易所	英国	34	1,471.49	0.00
550	Epiroc AB	安百拓集团	EPIA SS	斯德哥尔摩证券交易所	瑞典	5	632.12	0.00
551	Goodman Group	嘉民集团	GMG AT	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	1	81.83	0.00

注：本表所使用的证券代码为彭博代码。

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：人民币元

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	Berkshire Hathaway Inc	BRK/B UN	5,364,953.13	2.26
2	Teck Resources Ltd	TECK UN	4,535,860.43	1.91
3	Beijing United Information Technology Co Ltd	603613 SH	3,183,250.00	1.34
4	Amazon.com Inc	AMZN UW	2,590,655.36	1.09
5	Huaneng Lancang River Hydropower Inc	600025 SH	2,564,512.61	1.08
6	Verbund AG	VER AV	2,378,438.49	1.00
7	Bank of Montreal	BMO CT	2,358,279.42	0.99
8	Royal Bank of Canada	RY CT	2,353,010.18	0.99
9	Raytheon Technologies Corp	RTX UN	2,344,582.30	0.99
10	Steel Dynamics Inc	STLD UW	2,341,544.78	0.98
11	Canadian Natural Resources Ltd	CNQ CT	2,289,411.56	0.96
12	Dollarama Inc	DOL CT	2,254,623.61	0.95

13	Exxon Mobil Corp	XOM UN	2,241,777.54	0.94
14	Bank of Nova Scotia/The	BNS CT	2,226,988.89	0.94
15	Check Point Software Technologies Ltd	CHKP UW	2,219,153.84	0.93
16	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	TSM UN	2,056,464.85	0.86
17	Bank of Chengdu Co Ltd	601838 SH	2,033,695.00	0.86
18	Yangling Metron New Material Inc	300861 SZ	2,029,699.42	0.85
19	Tesla Inc	TSLA UW	2,029,529.93	0.85
20	Bank of Jiangsu Co Ltd	600919 SH	1,952,286.00	0.82

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：人民币元

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	Apple Inc	AAPL UW	4,453,167.57	1.87
2	Microsoft Corp	MSFT UW	3,347,286.77	1.41
3	Alphabet Inc	GOOGL UW	3,300,028.79	1.39
4	Beijing United Information Technology Co Ltd	603613 SH	3,049,461.00	1.28
5	Teck Resources Ltd	TECK UN	2,722,409.80	1.14
6	Huaneng Lancang River Hydropower Inc	600025 SH	2,409,985.00	1.01
7	Verbund AG	VER AV	2,401,219.76	1.01
8	Berkshire Hathaway Inc	BRK/B UN	2,197,698.71	0.92
9	Bank of Nova Scotia/The	BNS CT	2,146,510.78	0.90
10	Check Point Software Technologies Ltd	CHKP UW	2,105,068.45	0.89
11	Bank of Montreal	BMO CT	2,102,286.31	0.88
12	Anhui Jinhe Industrial Co Ltd	002597 SZ	2,101,096.00	0.88
13	NVIDIA Corp	NVDA UW	2,070,204.58	0.87

14	LONGi Green Energy Technology Co Ltd	601012 SH	2,050,517.20	0.86
15	Bank of Jiangsu Co Ltd	600919 SH	2,024,510.00	0.85
16	Dollarama Inc	DOL CT	1,957,056.76	0.82
17	Yangling Metron New Material Inc	300861 SZ	1,902,910.00	0.80
18	Bank of Chengdu Co Ltd	601838 SH	1,888,181.00	0.79
19	Royal Bank of Canada	RY CT	1,866,028.15	0.78
20	Yealink Network Technology Corp Ltd	300628 SZ	1,823,846.00	0.77

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	327,329,200.48
卖出收入（成交）总额	251,889,146.57

注：8.5.1 项“买入金额”、8.5.2 项“卖出金额”及 8.5.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（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

金额单位：人民币元

债券信用等级	公允价值	占基金资产净值比例（%）
AAA	-	-
AA-	-	-
A+	10,022,158.22	6.20
A	-	-
A-	-	-
BBB+	-	-
BBB	-	-
BBB-	-	-
BB+	-	-
BB	-	-
BB-	-	-
B+	-	-
B	-	-
B-	-	-
CCC+	-	-
CCC	-	-
CCC-	-	-

注：本基金持有的债券主要采用国际权威评级机构（标普、惠誉、穆迪等）提供的债券信用评级信息，上述机构未提供评级信息的债券采用内部评级。

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019663	21 国债 15	57,000	5,747,594.22	3.56
2	019666	22 国债 01	28,000	2,856,586.85	1.77
3	019674	22 国债 09	14,000	1,417,977.15	0.88

注：报告期末，本基金仅持有上述 3 支债券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

无。

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

无。

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

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	Invesco Golden Dragon China ETF	ETF	交易型开放式	Invesco Capital Management LLC	1,295,851.86	0.80
2	Invesco QQ Trust Series 1	ETF	交易型开放式	Invesco Capital Management LLC	554,505.57	0.34
3	iShares CORE S&P /ASX 200 ETF	ETF	交易型开放式	BlackRock Investment Management Australia Ltd/Australia	265,637.81	0.16
4	SPDR Gold Shares	ETF	交易型开放式	State Street Global Advisors Inc	259,924.44	0.16
5	VanEck Gold Mine	ETF	交易型开放式	Van Eck Associates	170,063.83	0.11

	rs ETF/USA			Corp		
6	iShares 20+ Year Treasury Bond ETF	ETF	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	169,881.92	0.11
7	ARK Innovation ETF	ETF	交易型开放式	ARK Investment Management LLC	51,129.91	0.03
8	iShares Russell 1000 Value ETF	ETF	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	46,471.99	0.03
9	iShares MSCI Brazil ETF	ETF	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	20,453.99	0.01
10	iShares MSCI UAE ETF	ETF	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	17,260.93	0.01

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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 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

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

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
1	存出保证金	337,715.97
2	应收清算款	-
3	应收股利	162,494.97
4	应收利息	-
5	应收申购款	380,406.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	880,617.57

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
嘉实全球价值股票（QDII）人民币	5,930	31,750.40	23,027,126.71	12.23	165,252,733.47	87.77
嘉实全球价值股票（QDII）美元现汇	27	16,510.59	-	-	445,785.86	100.00
合计	5,955	31,691.96	23,027,126.71	12.20	165,698,519.33	87.80

注：(1) 嘉实全球价值股票（QDII）人民币：机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实全球价值股票（QDII）人民币份额占嘉实全球价值股票（QDII）人民币总份额比例、个人投资者持有嘉实全球价值股票（QDII）人民币份额占嘉实全球价值股票（QDII）人民币总份额比例；

(2) 嘉实全球价值股票（QDII）美元现汇：机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实全球价值股票（QDII）美元现汇份额占嘉实全球价值股票（QDII）美元现汇总份额比例、个人投资者持有嘉实全球价值股票（QDII）美元现汇份额占嘉实全球价值股票（QDII）美元现汇总份额比例。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从	嘉实全球价值股票（QDII）人民币	193,878.26	0.10

业人员持有本基金	嘉实全球价值股票（QDII）美元现汇	-	-
	合计	193,878.26	0.10

9.3 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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	嘉实全球价值股票（QDII）人民币	0
	嘉实全球价值股票（QDII）美元现汇	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实全球价值股票（QDII）人民币	0
	嘉实全球价值股票（QDII）美元现汇	0
	合计	0

9.4 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情况

无。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实全球价值股票（QDII）人民币	嘉实全球价值股票（QDII）美元现汇
基金合同生效日（2021年11月23日）基金份额总额	237,958,337.73	281,215.89
本报告期期初基金份额总额	237,958,337.73	281,215.89
本报告期基金总申购份额	7,303,115.44	188,164.58
减：本报告期基金总赎回份额	56,981,592.99	23,594.61
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	188,279,860.18	445,785.86

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

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

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

2022 年 5 月 12 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，龚康先生因工作分工不再担任公司副总经理职务，转任嘉实资本管理有限公司总经理。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金基金合同生效日为 2021 年 11 月 23 日。报告年度应支付安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费 50,000.00 元，该审计机构第 1 年提供审计服务。

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 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2022 年 6 月 2 日
采取稽查或处罚等措施的机构	北京证监局
受到的具体措施类型	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	对子公司管控不严格
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已完成整改并通过北京证监局验收
其他	-
措施 2	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2022 年 6 月 14 日
采取稽查或处罚等措施的机构	北京证监局
受到的具体措施类型	警示函

受到稽查或处罚等措施的原因	对子公司管控不严格
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	-
其他	-
措施 3	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2022 年 12 月 26 日
采取稽查或处罚等措施的机构	北京证监局
受到的具体措施类型	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	内控管理不完善
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已完成整改并通过北京证监局验收
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

本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

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 (%)	
中信证券股份有限公司 Citic Securities Company Limited	-	286,588,711.34	49.54	181,220.36	53.08	-
瑞银集团 Union Bank of Switzerland	-	95,943,227.99	16.59	57,555.61	16.86	-
华兴证券有限公司 China Renaissance Security	-	66,876,473.15	11.56	39,124.98	11.46	-

摩根大通 证券(亚 太)有限 公司 J.P.Morga n Secu rities (Asia Pa cific) L imited	-	63,715,122.6 7	11.01	24,937.38	7.30	-
瑞士信贷 (香港)有 限公司 Credit Suisse (Hong Ko ng) Limi ted	-	24,672,626.6 5	4.27	4,713.79	1.38	-
花旗环球 金融亚洲 有限公司 Citigroup Glo bal Market s Asia Limited	-	13,673,963.9 7	2.36	14,898.13	4.36	-
中国国际 金融香港 证券有限 公司 China Internati onal Cap ital Cor poration Hong K ong Secu rities L imited	-	8,787,326.45	1.52	4,138.23	1.21	-
野村证券 NOMURA	-	7,145,850.81	1.24	1,937.43	0.57	-
极讯欧洲 有限公司 Instinet Europ	-	5,488,031.89	0.95	4,696.29	1.38	-

e Limited						
香港上海 汇丰银行 有限公司 The Hongkong and Shanghai Banking Corporati on Limited	-	1,824,374.16	0.32	660.24	0.19	-
招商证券 (香港)有 限公司 China Me rchants Securit ies (HK) Co. , Ltd.	-	1,614,914.17	0.28	3,229.83	0.95	-
法国巴黎 兴业银行 SOCIETE GENERALE Corporate and Investmen t Bankin g	-	1,197,072.70	0.21	2,394.16	0.70	-
元大证券 (香港)有 限公司 Yuanta S ecurities (Hong Ko ng) Comp any Limi ted	-	896,987.11	0.16	1,793.99	0.53	-
信达国际 证券有限 公司 CINDA INTERNATI	-	42,095.50	0.01	84.19	0.02	-

ONAL SECURITIES LIMITED						
中国银河证券股份有限公司 China Galaxy International Financial Holdings	-	-	-	-	-	-

注：1. 本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

2. 交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范；
- (2) 财务状况良好；
- (3) 研究能力较强；

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)

中信证券股份有限公司 Citic Securities Company Limited	40,912,067.20	100.00	-	-	-	-	-	-	-
瑞银集团 Union Bank of Switzerland	-	-	-	-	-	-	2,107,224.57	28.60	
摩根大通证券 (亚太) 有限公司 J.P.Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-	1,889,281.08	25.64	
花旗环球金融亚洲有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited	-	-	-	-	-	-	1,309,500.78	17.77	
华兴证券有限公司 China Renaissance Security	-	-	-	-	-	-	1,309,158.53	17.77	
瑞士信贷 (香港) 有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	375,349.24	5.09	
野村证券 NOMURA	-	-	-	-	-	-	214,323.86	2.91	
香港上海汇丰银行有限公司 The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	-	-	-	-	-	-	163,373.25	2.22	
极讯欧洲有限公司 Instinet Europe Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	
信达国际证券有限公司 CINDA INTERNATIONAL SECURITIES LIMITED	-	-	-	-	-	-	-	-	
招商证券 (香港) 有限公司 China Merchants Securities (HK) Co., Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-	
中国国际金融香港证券有限公司 China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	
中国银河证券股份有限公司 China Galaxy International Financials Holdings	-	-	-	-	-	-	-	-	
法国巴黎兴业银行 SOCIETE GENERALE Corporate and Investment Banking	-	-	-	-	-	-	-	-	
元大证券 (香港) 有限公司 Yuanta Securities (Hong Kong) Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	

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	关于嘉实全球价值机会股票型证券投资基金 (QDII) 开放日常申购、赎回	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基	2022 年 2 月 18 日

	及定投业务的公告	金电子披露网站	
2	关于嘉实全球价值股票（QDII）2022年4月15日、4月18日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年4月13日
3	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年5月12日
4	关于嘉实全球价值股票（QDII）2022年5月30日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年5月26日
5	关于嘉实全球价值股票（QDII）2022年6月2日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年5月31日
6	关于嘉实全球价值股票（QDII）2022年6月20日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年6月16日
7	关于嘉实全球价值股票（QDII）2022年7月4日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年6月30日
8	关于嘉实全球价值股票（QDII）2022年8月29日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年8月25日
9	关于嘉实全球价值股票（QDII）2022年9月5日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年9月1日
10	嘉实基金管理有限公司住所变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年11月10日
11	关于嘉实全球价值股票（QDII）2022年11月24日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年11月22日
12	嘉实基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善客户身份信息的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年12月21日
13	关于嘉实全球价值股票（QDII）2022年12月26日、12月27日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年12月22日

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）注册的批复文件。
- (2) 《嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）基金合同》；

- (3) 《嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）托管协议》；
- (4) 《嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）公告的各项原稿。

12.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

12.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2023 年 3 月 30 日