

嘉实全球价值机会股票型证券投资基金
(QDII)
2023 年年度报告

2023 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：2024 年 3 月 28 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 2024 年 03 月 22 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 2023 年 01 月 01 日起至 2023 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.....	8
3.3 其他指标.....	11
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	11
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
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.....	17
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	20
7.3 净资产变动表.....	21

7.4 报表附注.....	23
§8 投资组合报告.....	52
8.1 期末基金资产组合情况.....	52
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	52
8.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	53
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.....	53
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	105
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	108
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.....	108
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.....	108
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.....	109
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.....	109
8.11 投资组合报告附注.....	110
§9 基金份额持有人信息.....	110
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	110
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	111
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.....	111
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.....	112
§10 开放式基金份额变动.....	112
§11 重大事件揭示.....	112
11.1 基金份额持有人大会决议.....	112
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.....	112
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	113
11.4 基金投资策略的改变.....	113
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	113
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.....	113
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	113
11.8 其他重大事件.....	119
§12 备查文件目录.....	120
12.1 备查文件目录.....	120
12.2 存放地点.....	121
12.3 查阅方式.....	121

§ 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	160,736,013.30 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	160,486,513.62 份	249,499.68 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	任航
	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	100020	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	JP Morgan 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		383 Madison Avenue, New York, NY 10179-0001, U. S. A.
邮政编码		10179

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（2023 年 1 月 1 日 -2023 年 12 月 31 日）		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	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	-1,778,233.0	-27,666.32	-27,755,809.	-297,002.6	-1,091,938.3	-8,249.63

已实现收益	5		47	9	2	
本期利润	28,474,520.73	311,566.93	-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	0.1601	0.9546	-0.1555	-0.9825	-0.0082	-0.0522
本期加权平均净值利润率	17.24%	16.20%	-17.45%	-17.33%	-0.82%	-0.82%
本期基金份额净值增长率	19.62%	17.69%	-14.78%	-21.94%	-0.82%	-0.55%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
期末可供分配利润	-23,537,519.33	-234,149.39	-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	-0.1467	-0.9385	-0.1548	-0.9899	-0.0082	-0.0522
期末基金资产净值	162,255,492.12	1,614,511.38	159,142,205.38	2,410,339.23	236,014,369.08	1,783,098.35
期末基金份额	1.0110	0.9136	0.8452	0.7763	0.9918	0.9945

净值						
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
基金份额累计净值增长率	1.10%	-8.64%	-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	7.47%	0.60%	6.41%	0.53%	1.06%	0.07%
过去六个月	3.78%	0.63%	2.57%	0.55%	1.21%	0.08%
过去一年	19.62%	0.70%	12.20%	0.60%	7.42%	0.10%
自基金合同生效起至今	1.10%	0.85%	-8.39%	0.80%	9.49%	0.05%

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	8.94%	0.60%	6.41%	0.53%	2.53%	0.07%
过去六个月	5.88%	0.64%	2.57%	0.55%	3.31%	0.09%
过去一年	17.69%	0.70%	12.20%	0.60%	5.49%	0.10%
自基金合同生效 起至今	-8.64%	0.86%	-8.39%	0.80%	-0.25%	0.06%

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：

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

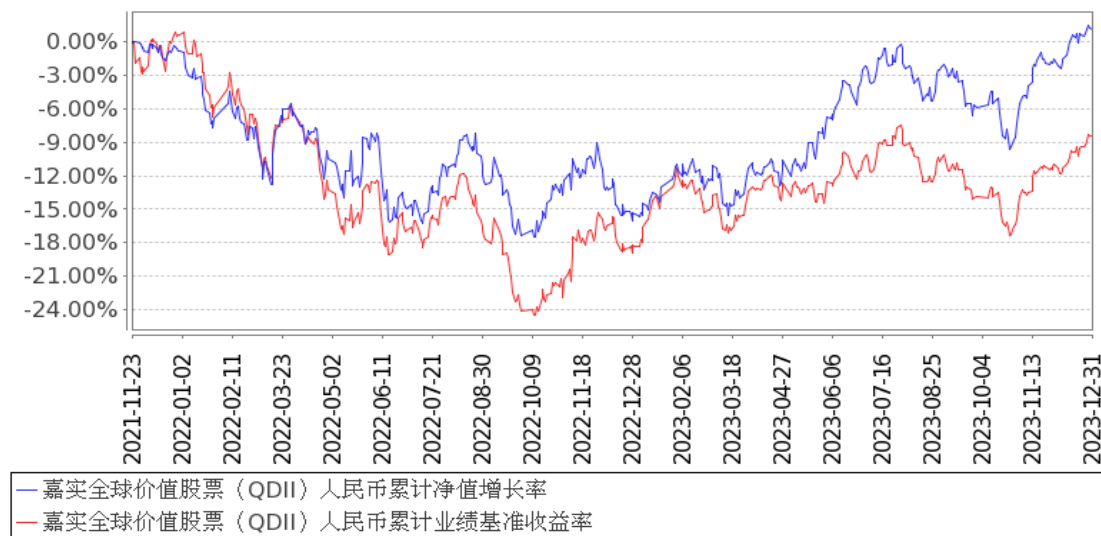
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

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

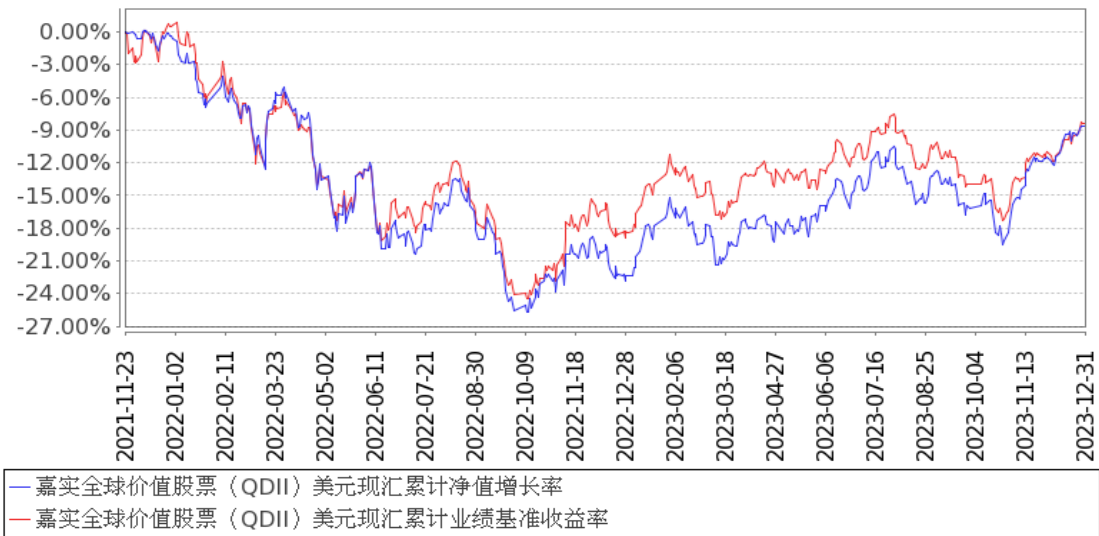
嘉实全球价值股票（QDII）人民币累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2021年11月23日至2023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

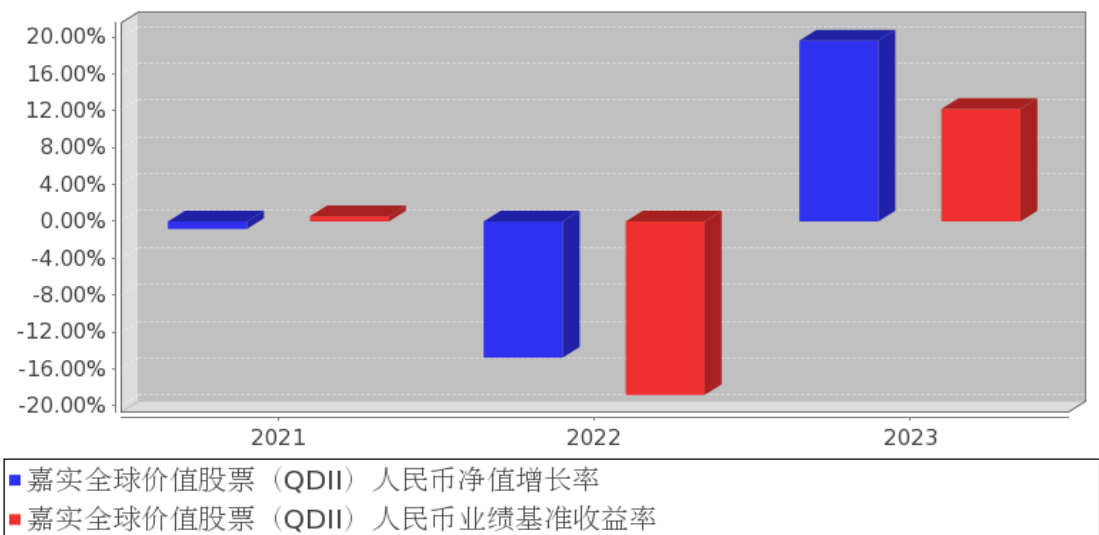
（2021年11月23日至2023年12月31日）



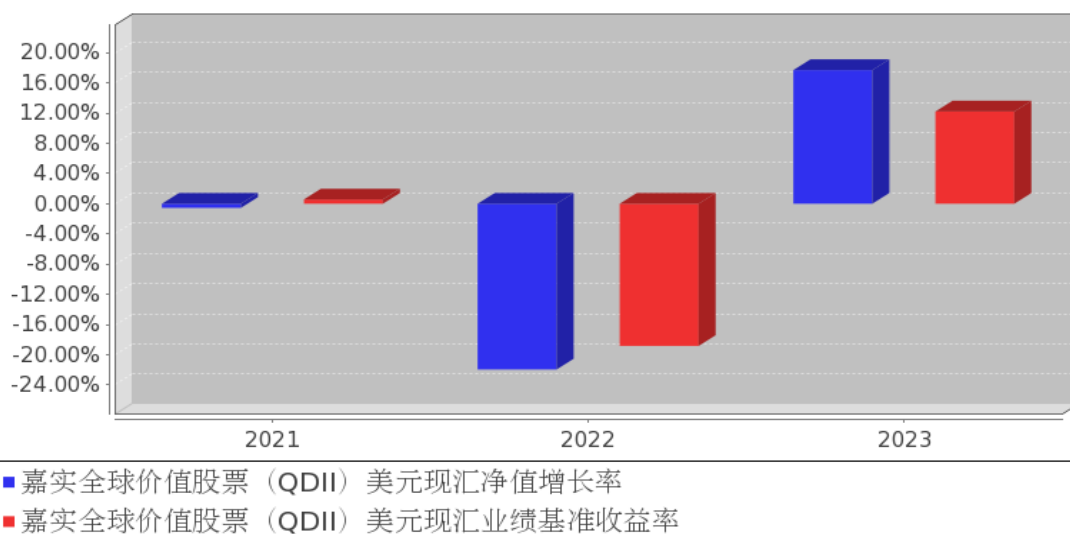
注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

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2023年12月31日，基金管理人共管理334只公募基金，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、基础设施基金等不同类别。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	-	27年	曾任美国世纪投资管理公司（American

力	嘉实美国 成长股票 （QDII） 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、人工智能投资部负责人，现任股票投研人工智能投资总监，博士后科研工作站导师。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，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门集中交易。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 13 次，均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

2023 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。

2023 年全年度，作为本基金参考基准中最大权重的美国股票市场，整体表现强劲并屡创新高。纳斯达克指数全年上涨 43%，标普 500 和道琼斯指数则上涨 24%和 14%，分别逼近和创下历史新高。美股盈利呈现出非常明显的滚动式特征，纳斯达克盈利修复明显领先标普与道琼斯，也成为支撑市场表现的主要动力，叠加 AI 产业趋势助推业务收入增长以及降本举措持续见效，全年盈利结构性走强。而财政发力下三季度增长再加速，助推了美股上市企业业绩，尤其是并不受益于 AI 趋势的传统企业，标普 500 非金融收入在此前连续四个季度持续回落后在三季度抬升并转正，盈利增速也是如此。因此，虽然美国国内面临高通胀、加息、衰退预期等扰动，美股依然能够一路高歌猛进。

就 A 股而言，市场在全年整体呈现结构性熊市走势，行业风格等表现分化较大。一方面，国内外经济走势偏离前期市场整体预判，市场整体信心不足并且资金面偏紧，全年 A 股前高后低、震荡回落。虽然宽基指数下跌较少，但核心资产回调严重，机构重仓股赚钱效应欠佳。另一方面，

面对高景气行业减少、赚钱效应欠佳、资金存量博弈，同时外部风险持续扰动的市场，投资者呈现哑铃型配置偏好：一边是高弹性、或有边际变化的主题性机会乃至小盘股微盘股；另一边是回归安全与底线思维，追求高股息、确定性强的红利资产；除此之外的其他风格策略表现欠佳。

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，丹麦的创新药、日本的精细工业如半导体等。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，各国经济持续修复，企业盈利强劲，股市表现向好，德国 DAX、日经 225 等指数全年涨幅显著。

新兴市场部分，本组合紧密跟踪全球产业链变动、资源商品价格趋势以及美联储货币政策对新兴市场国家的影响，优化新兴市场头寸结构，本报告期内也有港股持仓。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 1.0110 元，本报告期基金份额净值增长率为 19.62%；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 0.9136 美元，本报告期基金份额净值增长率为 17.69%；业绩比较基准收益率为 12.20%。

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。随着美国经济增速保持稳健、通胀问题已被逐步减缓，尤其是市场对美联储利率政策的期待，带来资本市场对权益资产的偏好逐步加大。在此宏观背景下，我们除使用企业盈利增速等成长性外，还结合创新能力、新科技下的成长空间，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。

相对美股而言，国内资本市场经历了成长风格的持续调整以及去年后半段较显著的整体波动，一定程度上释放了部分估值空间，而在实体经济层面，结合积极的政策意愿与循序渐进的措施，实体经济中长期的预期逐步稳定向好，利好经济重启和市场预期。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、投资交易、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。全力支持新产品新业务新制度新客户新投资工具并进行合规性判断。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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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（2024）审字第 70022036_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 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的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）2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 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	嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）管理层对其其他信息负责。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。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。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，

	<p>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>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<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>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价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</p>

	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。	
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	贺耀	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	2024年3月25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：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	2,649,780.09	6,236,716.10
结算备付金		141,300.59	614,790.79
存出保证金		9,580.05	337,715.97
交易性金融资产	7.4.7.2	163,294,244.67	159,360,436.37
其中：股票投资		153,854,776.01	146,469,030.63
基金投资		1,498,128.93	2,869,247.52
债券投资		7,941,339.73	10,022,158.22
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		2,494,788.42	-
应收股利		75,430.39	162,494.97
应收申购款		362,676.40	380,406.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		169,027,800.61	167,092,560.83
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022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		0.49	304,129.97
应付赎回款		4,627,213.75	4,648,515.08
应付管理人报酬		257,293.38	258,615.20
应付托管费		50,029.26	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	7.4.7.9	223,260.23	278,469.68
负债合计		5,157,797.11	5,540,016.22
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	162,083,274.63	191,131,473.36
未分配利润	7.4.7.12	1,786,728.87	-29,578,928.75
净资产合计		163,870,003.50	161,552,544.61
负债和净资产总计		169,027,800.61	167,092,560.83

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，嘉实全球价值股票（QDII）人民币基金份额净值 1.0110 元，基金份额总额 160,486,513.62 份，嘉实全球价值股票（QDII）美元现汇基金份额净值 0.9136 美元，基金份额总额 249,499.68 份，基金份额总额合计为 160,736,013.30 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		32,569,031.48	-28,637,914.18
1. 利息收入		28,954.18	132,995.36
其中：存款利息收入	7.4.7.13	28,954.18	132,995.36
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,990,711.55	-23,900,757.20

其中：股票投资收益	7.4.7.14	-906,043.16	-26,604,616.80
基金投资收益	7.4.7.15	-89,123.65	-635,203.33
债券投资收益	7.4.7.16	133,938.65	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	170,247.95	-291,134.28
股利收益	7.4.7.20	2,681,691.76	3,518,262.09
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	30,591,987.03	-4,859,256.07
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-93,601.49	-111,507.08
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.22	50,980.21	100,610.81
减：二、营业总支出		3,782,943.82	4,274,154.05
1. 管理人报酬		3,006,443.12	3,413,660.60
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费		584,586.20	663,767.35
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		348.77	-
8. 其他费用	7.4.7.24	191,565.73	196,726.10
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		28,786,087.66	-32,912,068.23
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		28,786,087.66	-32,912,068.23
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		28,786,087.66	-32,912,068.23

7.3 净资产变动表

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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	191,131,473.36	-	-29,578,928.75	161,552,544.61
二、本期期初净资产	191,131,473.36	-	-29,578,928.75	161,552,544.61
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-29,048,198.73	-	31,365,657.62	2,317,458.89
（一）、综合收益总额	-	-	28,786,087.66	28,786,087.66
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-29,048,198.73	-	2,579,569.96	-26,468,628.77
其中：1. 基金申购款	29,972,161.56	-	-589,199.19	29,382,962.37
2. 基金赎回款	-59,020,360.29	-	3,168,769.15	-55,851,591.14
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	162,083,274.63	-	1,786,728.87	163,870,003.50
项目	上年度可比期间 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	239,756,122.79	-	-1,958,655.36	237,797,467.43
二、本期期初净资产	239,756,122.79	-	-1,958,655.36	237,797,467.43
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-48,624,649.43	-	-27,620,273.39	-76,244,922.82
（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净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-48,624,649.43	-	5,291,794.84	-43,332,854.59
其中：1. 基金申	8,507,994.37	-	-1,024,267.83	7,483,726.54

购款				
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净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	191,131,473.36	-	-29,578,928.75	161,552,544.61

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：

<u>经雷</u>	<u>梁凯</u>	<u>李袁</u>
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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	2,649,780.09	6,236,716.10
等于：本金	2,649,204.10	6,236,271.77
加：应计利息	575.99	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	2,649,780.09	6,236,716.10

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		129,138,697.52	-	153,854,776.01	24,716,078.49
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	7,878,846.76	57,139.73	7,941,339.73	5,353.24
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	7,878,846.76	57,139.73	7,941,339.73	5,353.24
资产支持证券		-	-	-	-
基金		1,345,297.11	-	1,498,128.93	152,831.82
其他		-	-	-	-
合计		138,362,841.39	57,139.73	163,294,244.67	24,874,263.55
项目		上年度末 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

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 2023年12月31日		
	合同/名义	公允价值	备注

	金额	资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-
项目	上年度末 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	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

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

无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	763.36	10,490.73
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	62,496.87	97,978.95
其中：交易所市场	62,496.87	97,978.95
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	160,000.00	170,000.00
合计	223,260.23	278,469.68

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
----	--

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	188,279,860.18	188,279,860.18
本期申购	29,701,860.15	29,701,860.15
本期赎回（以“-”号填列）	-57,495,206.71	-57,495,206.71
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	160,486,513.62	160,486,513.62

嘉实全球价值股票（QDII）美元现汇

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	445,785.86	2,851,613.18
本期申购	42,196.19	270,301.41
本期赎回（以“-”号填列）	-238,482.37	-1,525,153.58
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	249,499.68	1,596,761.01

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

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
上年度末	-25,959,648.40	-3,178,006.40	-29,137,654.80
本期期初	-25,959,648.40	-3,178,006.40	-29,137,654.80
本期利润	-1,778,233.05	30,252,753.78	28,474,520.73
本期基金份额交易产生的变动数	4,200,362.12	-1,768,249.55	2,432,112.57
其中：基金申购款	-4,402,671.19	3,838,227.69	-564,443.50
基金赎回款	8,603,033.31	-5,606,477.24	2,996,556.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-23,537,519.33	25,306,497.83	1,768,978.50

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
上年度末	-393,142.52	-48,131.43	-441,273.95
本期期初	-393,142.52	-48,131.43	-441,273.95

本期利润	-27,666.32	339,233.25	311,566.93
本期基金份额交易产生的变动数	186,659.45	-39,202.06	147,457.39
其中：基金申购款	-39,521.00	14,765.31	-24,755.69
基金赎回款	226,180.45	-53,967.37	172,213.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-234,149.39	251,899.76	17,750.37

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	25,710.01	36,507.99
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	3,009.54	96,337.81
其他	234.63	149.56
合计	28,954.18	132,995.36

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	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-906,043.16	-26,604,616.80
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	-906,043.16	-26,604,616.80

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	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	344,575,333.46	251,889,146.57

减：卖出股票成本总额	344,855,759.20	277,934,146.66
减：交易费用	625,617.42	559,616.71
买卖股票差价收入	-906,043.16	-26,604,616.80

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	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
卖出/赎回基金成交总额	2,644,131.72	3,322,369.61
减：卖出/赎回基金成本总额	2,732,382.58	3,951,888.31
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-1,895.29	-
减：交易费用	2,768.08	5,684.63
基金投资收益	-89,123.65	-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	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	181,120.46	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	-47,181.81	-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	133,938.65	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	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	17,935,422.47	20,702,921.99
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	17,660,799.85	20,444,177.39
减：应计利息总额	321,804.43	284,873.79
减：交易费用	-	28.41
买卖债券差价收入	-47,181.81	-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 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
股指期货投资收益	170,247.95	-291,134.28

7.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
股票投资产生的股利收益	2,663,467.47	3,464,274.59
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	18,224.29	53,987.50
合计	2,681,691.76	3,518,262.09

7.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
1. 交易性金融资产	30,619,827.03	-4,883,296.07
股票投资	30,352,897.24	-4,765,847.14
债券投资	37,964.85	-32,311.61
资产支持证券投资	-	-
基金投资	228,964.94	-85,137.32
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-27,840.00	24,040.00
权证投资	-	-
期货投资	-27,840.00	24,040.00
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	30,591,987.03	-4,859,256.07

7.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
基金赎回费收入	50,800.90	100,570.56

其他	179.31	40.25
合计	50,980.21	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 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
审计费用	40,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	6,098.00	6,481.81
债券托管账户维护费	18,000.00	13,500.00
其他	7,265.36	6,412.02
证券组合费	202.37	332.27
合计	191,565.73	196,726.10

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 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,006,443.12	3,413,660.60
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,330,734.18	1,423,449.68
应支付基金管理人的净管理费	1,675,708.94	1,990,210.92

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 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	584,586.20	663,767.35

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 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	1,979,031.05	25,710.01	5,365,043.19	36,507.99
摩根大通银行_活期	670,749.04	-	871,672.91	-

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(2023年1月1日至2023年12月31日),本基金未实施利润分配。

7.4.12 期末（2023 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	7,941,339.73	10,022,158.22
未评级	-	-
合计	7,941,339.73	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 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,649,780.09	-	-	-	2,649,780.09
结算备付金	141,300.59	-	-	-	141,300.59
存出保证金	9,580.05	-	-	-	9,580.05
交易性金融资产	7,941,339.73	-	-	-155,352,904.94	163,294,244.67
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	2,494,788.42	2,494,788.42
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	75,430.39	75,430.39
应收申购款	-	-	-	362,676.40	362,676.40
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	10,742,000.46	-	-	-158,285,800.15	169,027,800.61
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	-	-	-	0.49	0.49
应付赎回款	-	-	-	4,627,213.75	4,627,213.75
应付管理人报酬	-	-	-	257,293.38	257,293.38
应付托管费	-	-	-	50,029.26	50,029.26
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	-	-	-	223,260.23	223,260.23
负债总计	-	-	-	5,157,797.11	5,157,797.11
利率敏感度缺口	10,742,000.46	-	-	-153,128,003.04	163,870,003.50
上年度末 2022 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	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

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	市场利率上升25个基点	-11,171.60	-12,862.87
	市场利率下降25个基点	11,203.12	12,910.66

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 2023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				
货币资金	722,339.93	-	25,306.41	747,646.34
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	92,728,654.02	7,146,211.73	28,846,192.19	128,721,057.94
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	53,047.57	-	20,862.82	73,910.39
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	2,313,823.96	-	180,964.46	2,494,788.42
其他资产	-	-	-	-
资产合计	95,817,865.48	7,146,211.73	29,073,325.88	132,037,403.09
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	95,817,86 5.48	7,146,211.73	29,073,325.88	132,037,403.09
	上年度末 2022 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				
货币资金	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	95,871,307.55	11,897,007.81	21,894,482.75	129,662,798.11

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	所有外币相对人民币升值5%	6,601,870.15	6,483,139.91
	所有外币相对人民币贬值5%	-6,601,870.15	-6,483,139.91

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 2023年12月31日		上年度末 2022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	153,854,776.01	93.89	146,469,030.63	90.66
交易性金融资产—基金投资	1,498,128.93	0.91	2,869,247.52	1.78
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	155,352,904.94	94.80	149,338,278.15	92.44

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		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	8,591,088.21	7,775,814.20
	业绩比较基准下降5%	-8,591,088.21	-7,775,814.20

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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	155,352,904.94	149,338,278.15
第二层次	7,941,339.73	10,022,158.22
第三层次	-	-
合计	163,294,244.67	159,360,436.37

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

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

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	153,854,776.01	91.02
	其中：普通股	148,804,621.12	88.04
	存托凭证	4,511,539.08	2.67
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	538,615.81	0.32
2	基金投资	1,498,128.93	0.89
3	固定收益投资	7,941,339.73	4.70
	其中：债券	7,941,339.73	4.70
	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	2,791,080.68	1.65
8	其他各项资产	2,942,475.26	1.74
9	合计	169,027,800.61	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 2,225,458.83 元，占基金资产净值的比例为 1.36%。

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	91,255,986.03	55.69
中国	26,631,847.00	16.25
日本	8,434,860.07	5.15
中国香港	7,146,211.73	4.36
法国	4,499,353.63	2.75
英国	4,050,121.39	2.47
德国	2,998,957.14	1.83
意大利	1,550,973.74	0.95
瑞士	1,543,233.98	0.94
荷兰	1,539,148.78	0.94
丹麦	834,977.24	0.51

西班牙	663,069.86	0.40
加拿大	631,709.26	0.39
瑞典	551,840.60	0.34
墨西哥	549,017.77	0.34
澳大利亚	342,541.64	0.21
新加坡	334,470.45	0.20
巴西	92,413.50	0.06
比利时	76,216.32	0.05
葡萄牙	74,422.22	0.05
奥地利	53,403.66	0.03
合计	153,854,776.01	93.89

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(%)
信息技术	45,491,939.40	27.76
工业	28,623,227.81	17.47
金融	21,871,668.80	13.35
非必需消费品	16,637,404.03	10.15
原材料	11,852,949.19	7.23
通信服务	11,011,046.02	6.72
能源	6,031,199.42	3.68
医疗保健	5,595,186.23	3.41
必需消费品	3,833,043.06	2.34
公用事业	2,201,915.96	1.34
房地产	166,580.28	0.10
房地产信托通讯塔类	253,479.43	0.15
房地产信托数据中心类	191,561.54	0.12
房地产信托写字楼类	93,574.84	0.06
房地产信托工业类	-	-
房地产信托零售类	-	-
房地产信托医疗保健类	-	-
房地产信托抵押类	-	-
合计	153,854,776.01	93.89

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	Microsoft	微软公	MSFT UW	纳斯达	美国	3,287	8,754,525.16	5.34

	Corp	司		克证券 交易所				
2	Apple Inc	苹果公司	AAPL UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	6,025	8,215,884.19	5.01
3	NVIDIA Corp	英伟达	NVDA UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,629	5,713,708.86	3.49
4	Amazon.com Inc	亚马逊 公司	AMZN UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,823	4,114,104.01	2.51
5	Alphabet Inc	Alphabet 公司	GOOGL UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,720	3,680,502.39	2.25
6	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	1,205	3,020,925.95	1.84
7	Advanced Micro Devices Inc	AMD 公 司	AMD UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,654	2,770,937.38	1.69
8	Tesla Inc	特斯拉 公司	TSLA UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,279	2,250,923.99	1.37
9	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	台积电	TSM UN	纽约证 券交易 所	美国	2,629	1,936,523.50	1.18
10	Eli Lilly & Co	礼来	LLY UN	纽约证 券交易 所	美国	396	1,634,944.40	1.00
11	ASML Holding NV	阿斯麦 控股公 司	ASML UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	183	981,069.82	0.60
11	ASML Holding NV	阿斯麦 控股公 司	ASML NA	阿姆斯 特丹交 易所	荷兰	70	375,033.16	0.23
12	HSBC Holdings PLC	汇丰控 股	HSBA LN	伦敦证 券交易 所	英国	17,917	1,029,442.61	0.63
12	HSBC	汇丰控	5 HK	香港证	中国	4,800	274,040.93	0.17

	Holdings PLC	股		券交易所	香港			
13	Broadcom Inc	博通股份有限公司	AVGO UN	纳斯达克证券交易所	美国	150	1,185,909.58	0.72
14	Novo Nordisk A/S	诺和诺德公司	NVO UN	纽约证券交易所	美国	750	549,528.99	0.34
14	Novo Nordisk A/S	诺和诺德公司	NOVOB DC	哥本哈根交易所	丹麦	745	547,976.50	0.33
15	Applied Materials Inc	应用材料	AMAT UN	纳斯达克证券交易所	美国	917	1,052,618.05	0.64
16	Netflix Inc	奈飞公司	NFLX UN	纳斯达克证券交易所	美国	295	1,017,285.37	0.62
17	General Electric Co	通用电气	GE UN	纽约证券交易所	美国	1,005	908,484.83	0.55
18	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	4,112	900,055.25	0.55
19	PetroChina Co Ltd	中国石油天然气股份有限公司	857 HK	香港证券交易所	中国香港	188,000	879,105.90	0.54
20	Sichuan Golden Summit Group	四川金顶(集团)股份有限公司	600678 CH	上海证券交易所	中国	102,300	823,515.00	0.50
21	JPMorgan Chase & Co	摩根大通	JPM UN	纽约证券交易所	美国	675	813,217.91	0.50
22	Shell PLC	壳牌公共有限公司	SHEL LN	伦敦证券交易所	英国	3,483	809,769.29	0.49
23	ServiceNow Inc	ServiceNow 公司	NOW UN	纽约证券交易所	美国	150	750,578.51	0.46
24	Vertiv	维谛技	VRT UN	纽约证	美国	2,179	741,256.75	0.45

	Holdings Co	术		券交易所				
25	ABB Ltd	ABB 有限公司	ABBN SE	瑞士证券交易所	瑞士	1,687	529,728.66	0.32
25	ABB Ltd	ABB 有限公司	ABBNY UV	纽约证券交易所	美国	500	156,881.81	0.10
26	Mitsubishi Corp	三菱商事	8058 JT	日本证券交易所	日本	6,000	678,929.97	0.41
27	Berkshire Hathaway Inc	伯克希尔哈撒韦公司	BRK/B UN	纽约证券交易所	美国	268	676,999.03	0.41
28	Salesforce Inc	Salesforce 股份有限公司	CRM UN	纽约证券交易所	美国	359	669,083.26	0.41
29	KLA Corp	KLA 公司	KLAC UW	纳斯达克证券交易所	美国	152	625,810.37	0.38
30	Hubei Forbon Technology Co Ltd	湖北富邦科技股份有限公司	300387 CH	深圳证券交易所	中国	74,500	621,330.00	0.38
31	UBS Group AG	瑞银集团	UBSG SE	瑞士证券交易所	瑞士	2,819	619,391.36	0.38
32	Jiangyin Zhongnan Heavy Industries Co Ltd	中南红文化集团股份有限公司	002445 CH	深圳证券交易所	中国	257,600	610,512.00	0.37
33	Shanghai Guandong Electric Group Co Ltd	上海广电电气（集团）股份有限公司	601616 CH	上海证券交易所	中国	167,300	607,299.00	0.37
34	Qinghai Jinrui Mineral Development Co Ltd	青海金瑞矿业发展股份有限公司	600714 CH	上海证券交易所	中国	62,900	603,840.00	0.37

35	Liaoning Kelong Fine Chemical Co Ltd	辽宁科隆精细化工股份有限公司	300405 CH	深圳证券交易所	中国	93,300	602,718.00	0.37
36	China Construction Bank Corp	中国建设银行股份有限公司	939 HK	香港证券交易所	中国香港	143,000	602,590.99	0.37
37	Jiangsu Alcha Aluminum Group Co Ltd	江苏常铝铝业集团股份有限公司	002160 CH	深圳证券交易所	中国	143,200	600,008.00	0.37
38	COSCO SHIPPING Development Co Ltd	中远海运发展股份有限公司	601866 CH	上海证券交易所	中国	247,700	579,618.00	0.35
38	COSCO SHIPPING Development Co Ltd	中远海运发展股份有限公司	2866 HK	香港证券交易所	中国香港	19,000	13,774.54	0.01
39	Adobe Inc	奥多比	ADBE UW	纳斯达克证券交易所	美国	140	591,575.43	0.36
40	Hebei Jinniu Chemical Industry Co Ltd	河北金牛化工股份有限公司	600722 CH	上海证券交易所	中国	118,500	591,315.00	0.36
41	Guangxi Yuegui Guangye Holding Co Ltd	广西粤桂广业控股股份有限公司	000833 CH	深圳证券交易所	中国	95,200	589,288.00	0.36
42	Hunan Valin Wire & Cable Co Ltd	湖南华菱线缆股份有限公司	001208 CH	深圳证券交易所	中国	63,000	585,270.00	0.36
43	Sichuan Meifeng Chemical IND	四川美丰化工股份有限公司	000731 CH	深圳证券交易所	中国	79,000	584,600.00	0.36
44	CITIC	中信重	601608	上海证	中国	151,400	584,404.00	0.36

	Heavy Industries Co Ltd	工机械股份有限公司	CH	券交易所				
45	Costco Wholesale Corp	开市客	COST UW	纳斯达克证券交易所	美国	125	584,393.58	0.36
46	Gifore Agricultural Science & Technology Service Co Ltd	吉峰三农科技服务股份有限公司	300022 CH	深圳证券交易所	中国	118,500	584,205.00	0.36
47	Marubeni Corp	丸红株式会社	8002 JT	日本证券交易所	日本	5,200	581,878.29	0.36
48	Beihai Gofar Chuanshan Biological Co Ltd	北海国发川山生物股份有限公司	600538 CH	上海证券交易所	中国	125,400	581,856.00	0.36
49	Xuchang KETOP Testing Research Institute Co Ltd	许昌开普检测研究院股份有限公司	003008 CH	深圳证券交易所	中国	20,800	580,528.00	0.35
50	Yunnan Chihong Zinc&Germanium Co Ltd	云南驰宏锌锗股份有限公司	600497 CH	上海证券交易所	中国	114,500	578,225.00	0.35
51	Jiangsu Zhengdan Chemical Industry Co Ltd	江苏正丹化学工业股份有限公司	300641 CH	深圳证券交易所	中国	102,100	575,844.00	0.35
52	Xiamen Tungsten Co Ltd	厦门钨业股份有限公司	600549 CH	上海证券交易所	中国	33,500	575,530.00	0.35
53	Suzhou Electrical Apparatus	苏州电器科学研究院股份有	300215 CH	深圳证券交易所	中国	108,700	575,023.00	0.35

	Science Academy Co Ltd	有限公司						
54	Ruitai Materials Technology Co Ltd	瑞泰科技股份有限公司	002066 CH	深圳证券交易所	中国	51,600	573,276.00	0.35
55	China First Heavy Industries Co Ltd	中国第一重型机械股份公司	601106 CH	上海证券交易所	中国	199,000	573,120.00	0.35
56	Tongyu Heavy Industry Co Ltd	通裕重工股份有限公司	300185 CH	深圳证券交易所	中国	238,500	572,400.00	0.35
57	Taiyuan Heavy Industry Co Ltd	太原重工股份有限公司	600169 CH	上海证券交易所	中国	242,500	572,300.00	0.35
58	Lam Research Corp	泛林集团	LRCX UW	纳斯达克证券交易所	美国	103	571,402.35	0.35
59	Dalian Huarui Heavy Industry Group Co Ltd	大连华锐重工集团股份有限公司	002204 CH	深圳证券交易所	中国	124,900	570,793.00	0.35
60	China Railway Special Cargo Logistics Co Ltd	中铁特物流股份有限公司	001213 CH	深圳证券交易所	中国	135,800	570,360.00	0.35
61	Hubei Donper Electromechanical Group Co Ltd	湖北东贝机电集团股份有限公司	601956 CH	上海证券交易所	中国	95,500	570,135.00	0.35
62	Shandong Ruifeng Chemical Co Ltd	山东瑞丰高分子材料股份有	300243 CH	深圳证券交易所	中国	58,300	569,591.00	0.35

		限公司						
63	Guangdong Liantai Environmental Protection Co Ltd	广东联泰环保股份有限公司	603797 CH	上海证券交易所	中国	102,700	566,904.00	0.35
64	Suntront Technology Co Ltd	新天科技股份有限公司	300259 CH	深圳证券交易所	中国	156,000	566,280.00	0.35
65	Guangdong Meiyang Jixiang Hydropower Co Ltd	广东梅雁吉祥水电股份有限公司	600868 CH	上海证券交易所	中国	222,000	566,100.00	0.35
66	Harbin Jiuzhou Group Co Ltd	哈尔滨九洲集团股份有限公司	300040 CH	深圳证券交易所	中国	101,000	565,600.00	0.35
67	Shanghai Challenge Textile Co Ltd	上海嘉麟杰纺织品股份有限公司	002486 CH	深圳证券交易所	中国	193,000	563,560.00	0.34
68	Shanghai Environment Group Co Ltd	上海环境集团股份有限公司	601200 CH	上海证券交易所	中国	62,400	560,976.00	0.34
69	Hunan Junxin Environmental Protection Co Ltd	湖南军信环保股份有限公司	301109 CH	深圳证券交易所	中国	35,500	560,900.00	0.34
70	Jiangsu Changqing Agrochemical Co Ltd	江苏长青农化股份有限公司	002391 CH	深圳证券交易所	中国	88,800	559,440.00	0.34
71	Henan Communications Planning & Design	河南省交通规划设计研究院股份有	300732 CH	深圳证券交易所	中国	63,200	558,056.00	0.34

	Institute Co Ltd	限公司						
72	Zhejiang Kaier New Materials Co Ltd	浙江开尔新材料股份有限公司	300234 CH	深圳证券交易所	中国	107,000	557,470.00	0.34
73	Jiangsu Jingyuan Environmental Protection Co Ltd	江苏京源环保股份有限公司	688096 CH	上海证券交易所	中国	59,200	554,704.00	0.34
74	Yongan Futures Co Ltd	永安期货股份有限公司	600927 CH	上海证券交易所	中国	35,300	554,563.00	0.34
75	Cheng De Lolo Co Ltd	承德露露股份有限公司	000848 CH	深圳证券交易所	中国	70,400	552,640.00	0.34
76	Tengda Construction Group Co Ltd	腾达建设集团股份有限公司	600512 CH	上海证券交易所	中国	222,800	552,544.00	0.34
77	Guizhou Transportation Planning Survey & Design Academic Co Ltd	贵州省交通规划勘察设计研究院股份有限公司	603458 CH	上海证券交易所	中国	64,000	552,320.00	0.34
78	Shanxi Guoxin Energy Corp Ltd	山西省国新能源股份有限公司	600617 CH	上海证券交易所	中国	141,800	547,348.00	0.33
79	CECEP Guozhen Environmental Protection Technology	中节能国祯环保科技股份有限公司	300388 CH	深圳证券交易所	中国	85,100	547,193.00	0.33

	y Co Ltd							
80	Visa Inc	维萨公司	V UN	纽约证券交易所	美国	293	540,286.42	0.33
81	Liaoning Cheng Da Co Ltd	辽宁成大股份有限公司	600739 CH	上海证券交易所	中国	45,700	538,346.00	0.33
82	Intel Corp	英特尔	INTC UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,508	536,705.76	0.33
83	Postal Savings Bank of China Co Ltd	中国邮政储蓄银行股份有限公司	1658 HK	香港证券交易所	中国香港	152,000	513,790.50	0.31
84	NEC Corp	日本电气(NEC)株式会社	6701 JT	日本证券交易所	日本	1,200	503,134.26	0.31
85	Chipotle Mexican Grill Inc	Chipotle Mexican Grill 股份有限公司	CMG UN	纽约证券交易所	美国	30	485,935.55	0.30
86	Mitsui & Co Ltd	三井物产	8031 JT	日本证券交易所	日本	1,800	478,851.25	0.29
87	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM UW	纳斯达克证券交易所	美国	465	476,332.47	0.29
88	Toyota Tsusho Corp	丰田通商	8015 JT	日本证券交易所	日本	1,100	458,886.56	0.28
89	Banco Santander SA	桑坦德	SAN SQ	西班牙证券交易所	西班牙	15,232	452,448.96	0.28
90	L'Oreal SA	欧莱雅	OR FP	巴黎证券交易所	法国	127	449,802.06	0.27
91	Deutsche Telekom	德国电信	DTE GY	德国证券交易所	德国	2,622	448,198.39	0.27

	AG			所				
92	China Railway Group Ltd	中国中铁股份有限公司	390 HK	香港证券交易所	中国香港	142,000	447,817.68	0.27
93	Eni SpA	埃尼集团	ENI IM	意大利证券交易所	意大利	3,232	389,853.57	0.24
93	Eni SpA	埃尼集团	E UN	纽约证券交易所	美国	224	53,957.71	0.03
94	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	2,296	443,268.63	0.27
95	KKR & Co Inc	KKR & Co Inc	KKR UN	纽约证券交易所	美国	749	439,514.47	0.27
96	Capital One Financial Corp	第一资本金融	COF UN	纽约证券交易所	美国	473	439,267.35	0.27
97	Zijin Mining Group Co Ltd	紫金矿业集团股份有限公司	2899 HK	香港证券交易所	中国香港	38,000	438,030.50	0.27
98	ASM International NV	ASM 国际有限公司	ASM NA	阿姆斯特丹交易所	荷兰	117	432,131.43	0.26
99	American International Group Inc	美国国际集团	AIG UN	纽约证券交易所	美国	890	427,069.10	0.26
100	PulteGroup Inc	Pulte 集团公司	PHM UN	纽约证券交易所	美国	584	426,948.56	0.26
101	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	221	426,334.41	0.26
102	Home Depot Inc/The	家得宝	HD UN	纽约证券交易所	美国	170	417,266.65	0.25

103	Moody's Corp	穆迪	MCO UN	纽约证券交易所	美国	148	409,400.46	0.25
104	Ameriprise Financial Inc	阿默普莱斯金融公司	AMP UN	纽约证券交易所	美国	146	392,772.40	0.24
105	Toyota Motor Corp	丰田汽车	7203 JT	日本证券交易所	日本	2,900	377,222.65	0.23
106	CNOOC Ltd	中国海洋石油有限公司	883 HK	香港证券交易所	中国香港	32,000	376,987.52	0.23
107	AXA SA	安盛集团	CS FP	巴黎证券交易所	法国	1,616	374,536.78	0.23
108	Blackstone Inc	黑石集团股份有限公司	BX UN	纽约证券交易所	美国	403	373,688.63	0.23
109	XPO Inc	XPO 股份有限公司	XPO UN	纽约证券交易所	美国	599	371,603.84	0.23
110	United Rentals Inc	联合租赁公司	URI UN	纽约证券交易所	美国	91	369,583.93	0.23
111	Onto Innovation Inc	Onto 创新股份有限公司	ONTO UN	纽约证券交易所	美国	341	369,284.19	0.23
112	Bank of Communications Co Ltd	交通银行股份有限公司	3328 HK	香港证券交易所	中国香港	83,000	366,303.18	0.22
113	Arista Networks Inc	Arista 网络股份有限公司	ANET UN	纽约证券交易所	美国	217	361,966.13	0.22
114	Pandora A/S	潘多拉公司	PNDORA DC	哥本哈根交易所	丹麦	202	198,615.95	0.12
114	Pandora A/S	潘多拉公司	PANDY UV	纽约证券交易所	美国	664	162,579.70	0.10

				所				
11 5	Regeneron Pharmaceu ticals 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	58	360,798.55	0.22
11 6	Hitachi Ltd	日立	6501 JT	日本证 券交易 所	日本	700	357,466.35	0.22
11 7	Ferrari NV	法拉利	RACE UN	纽约证 券交易 所	美国	146	349,961.73	0.21
11 8	Crowdstri ke Holdings Inc	CrowdS trike 控股股 份有限 公司	CRWD UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	192	347,204.15	0.21
11 9	Mitsubish i UFJ Financial Group Inc	三菱日 联金融 集团	8306 JT	日本证 券交易 所	日本	5,700	346,748.38	0.21
12 0	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	415	343,577.17	0.21
12 1	Sumitomo Corp	住友商 事有限 公司	8053 JT	日本证 券交易 所	日本	2,200	339,801.41	0.21
12 2	ING Groep NV	荷兰国 际集团	INGA NA	阿姆斯 特丹交 易所	荷兰	3,132	332,942.67	0.20
12 3	Wells Fargo & Co	富国银 行	WFC UN	纽约证 券交易 所	美国	945	329,436.92	0.20
12 4	Siemens AG	西门子	SIE GY	德国证 券交易 所	德国	244	325,846.20	0.20
12 5	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	349	320,081.45	0.20
12 6	Apollo Global Managemen	阿波罗 全球管 理股份	APO UN	纽约证 券交易 所	美国	484	319,457.82	0.19

	t Inc	有限公司						
127	China Communications Construction Co Ltd	中国交通建设股份有限公司	1800 HK	香港证券交易所	中国香港	100,000	315,364.56	0.19
128	Vinci SA	Vinci 股份有限公司	DG FP	巴黎证券交易所	法国	351	313,650.46	0.19
129	Keyence Corp	株式会社 KEYENCE	6861 JT	日本证券交易所	日本	100	311,923.16	0.19
130	Mercedes-Benz Group AG	梅赛德斯-奔驰集团	MBG GY	德国证券交易所	德国	631	310,195.16	0.19
131	Uber Technologies Inc	优步技术股份有限公司	UBER UN	纽约证券交易所	美国	705	307,437.70	0.19
132	TotalEnergies SE	道达尔集团	TTE FP	巴黎证券交易所	法国	625	302,579.20	0.18
133	Eaton Corp PLC	伊顿	ETN UN	纽约证券交易所	美国	172	293,372.80	0.18
134	Stellantis NV	Stellantis 集团	STLA UN	纽约证券交易所	美国	1,163	192,091.04	0.12
134	Stellantis NV	Stellantis 集团	STLAM IM	意大利证券交易所	意大利	605	100,564.36	0.06
135	Synopsys Inc	新思科技公司	SNPS UW	纳斯达克证券交易所	美国	79	288,109.29	0.18
136	Boeing Co/The	波音	BA UN	纽约证券交易所	美国	154	284,311.19	0.17
137	Metallurgical Corp of China Ltd	中国冶金科工股份有限公司	1618 HK	香港证券交易所	中国香港	201,000	276,868.33	0.17
13	Bayerisch	宝马汽	BMW GY	德国证	德国	349	276,425.51	0.17

8	e Motoren Werke AG	车股份公司		券交易所				
139	Gartner Inc	Gartner 公司	IT UN	纽约证券交易所	美国	86	274,776.60	0.17
140	NXP Semiconductors NV	恩智浦半导体公司	NXPI UW	纳斯达克证券交易所	美国	168	273,294.76	0.17
141	Cemex SAB de CV	西麦斯可变动资本额股份有限公司	CEMEX PO MF	墨西哥交易所	墨西哥	49,200	271,973.24	0.17
142	Hermes International SCA	爱马仕国际股份有限公司	RMS FP	巴黎证券交易所	法国	18	271,444.19	0.17
143	China Unicom Hong Kong Ltd	中国联通	762 HK	香港证券交易所	中国香港	60,000	266,428.68	0.16
144	Honda Motor Co Ltd	本田	7267 JT	日本证券交易所	日本	3,600	265,004.13	0.16
145	BAE Systems PLC	英国宇航系统	BA/ LN	伦敦证券交易所	英国	2,636	264,658.13	0.16
146	PDD Holdings Inc	拼多多	PDD UW	纳斯达克证券交易所	美国	250	259,067.46	0.16
147	Martin Marietta Materials Inc	Martin Marietta 材料股份有限公司	MLM UN	纽约证券交易所	美国	73	257,954.98	0.16
148	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	中国平安保险(集团)股份有限公司	2318 HK	香港证券交易所	中国香港	8,000	256,279.02	0.16
149	Tokyo Electron	东京电子	8035 JT	日本证券交易所	日本	200	253,625.86	0.15

	Ltd			所				
150	Safran SA	赛峰股份有限公司	SAF FP	巴黎证券交易所	法国	202	253,152.06	0.15
151	Aflac Inc	家庭人寿保险	AFL UN	纽约证券交易所	美国	431	251,843.11	0.15
152	Schneider Electric SE	施耐德电气有限公司	SU FP	巴黎证券交易所	法国	176	251,441.59	0.15
153	Keppel Corp Ltd	吉宝企业有限公司	KEP SP	新加坡证券交易所	新加坡	6,600	250,910.91	0.15
154	Mitsui OSK Lines Ltd	商船三井	9104 JT	日本证券交易所	日本	1,100	249,493.33	0.15
155	HubSpot Inc	HubSpot 公司	HUBS UN	纽约证券交易所	美国	60	246,707.44	0.15
156	Societe Generale SA	法国兴业银行	GLE FP	巴黎证券交易所	法国	1,290	243,574.29	0.15
157	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	三井住友金融集团	8316 JT	日本证券交易所	日本	700	241,825.81	0.15
158	New China Life Insurance Co Ltd	新华人寿保险股份有限公司	1336 HK	香港证券交易所	中国香港	17,500	241,371.70	0.15
159	Assurant Inc	安信龙集团	AIZ UN	纽约证券交易所	美国	202	241,059.55	0.15
160	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	信越化学工业	4063 JT	日本证券交易所	日本	800	237,688.26	0.15
161	Coca-Cola Consolidated Inc	可口可乐装瓶有限公司	COKE UW	纳斯达克证券交易所	美国	36	236,720.83	0.14
162	BNP Paribas SA	法国巴黎银行	BNP FP	巴黎证券交易所	法国	476	234,147.89	0.14
16	Panasonic	Panaso	6752 JT	日本证	日本	3,300	231,404.10	0.14

3	Holdings Corp	nic 株式会社		券交易所				
164	Progressive Corp/The	前进保险公司	PGR UN	纽约证券交易所	美国	200	225,626.49	0.14
165	Advanced Drainage Systems Inc	先进排水系统公司	WMS UN	纽约证券交易所	美国	226	225,121.07	0.14
166	Nintendo Co Ltd	任天堂	7974 JT	日本证券交易所	日本	600	221,710.48	0.14
167	Linde PLC	Linde PLC	LIN UW	纳斯达克证券交易所	美国	76	221,079.11	0.13
168	China CITIC Bank Corp Ltd	中信银行股份有限公司	998 HK	香港证券交易所	中国香港	65,000	216,767.82	0.13
169	Lennox International Inc	雷诺士国际有限公司	LII UN	纽约证券交易所	美国	68	215,536.19	0.13
170	Stryker Corp	史赛克	SYK UN	纽约证券交易所	美国	101	214,219.52	0.13
171	PNC Financial Services Group Inc/The	PNC 财务服务	PNC UN	纽约证券交易所	美国	195	213,867.44	0.13
172	Super Micro Computer Inc	Super Micro Computer 股份有限公司	SMCI UW	纳斯达克证券交易所	美国	106	213,412.80	0.13
173	Fomento Economico Mexicano SAB de CV	墨西哥经济促进公司	FEMSAU BD MF	墨西哥交易所	墨西哥	2,300	212,544.43	0.13
174	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	1,963	209,661.21	0.13

17 5	Axon Enterprise Inc	Axon Enterprise 股份有限 公司	AXON UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	114	208,582.82	0.13
17 6	CDW Corp/DE	特拉华 CDW 公 司	CDW UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	129	207,695.08	0.13
17 7	Fiserv Inc	Fiserv 公司	FI UN	纽约证 券交易 所	美国	220	206,990.49	0.13
17 8	Publicis Groupe SA	阳狮集 团股份 有限公 司	PUB FP	巴黎证 券交易 所	法国	312	205,973.91	0.13
17 9	Comcast Corp	康卡斯 特公司	CMCSA UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	659	204,669.84	0.12
18 0	Merck & Co Inc	默克	MRK UN	纽约证 券交易 所	美国	265	204,621.33	0.12
18 1	Heidelber g Materials AG	海德堡 材料股 份公司	HEI GY	德国证 券交易 所	德国	320	203,559.57	0.12
18 2	Sony Group Corp	索尼集 团公司	6758 JT	日本证 券交易 所	日本	300	202,006.90	0.12
18 3	Novartis AG	诺华	NOVN SE	瑞士证 券交易 所	瑞士	282	201,480.43	0.12
18 4	Continent al AG	德国大 陆集团	CON GY	德国证 券交易 所	德国	333	201,308.38	0.12
18 5	Booking Holdings Inc	Bookin g 控股 股份有 限公司	BKNG UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	8	200,991.16	0.12
18 6	Splunk Inc	Splunk 公司	SPLK UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	185	199,624.13	0.12
18 7	Parker-Ha nnifin Corp	派克汉 尼汾公 司	PH UN	纽约证 券交易 所	美国	61	199,042.99	0.12

188	Infinion Technologies AG	英飞凌技术有限公司	IFX GY	德国证券交易所	德国	669	198,745.02	0.12
189	SAP SE	SAP 公司	SAP GY	德国证券交易所	德国	181	198,412.42	0.12
190	Rolls-Royce Holdings PLC	罗尔斯·罗伊斯控股公司	RR/ LN	伦敦证券交易所	英国	7,216	195,525.99	0.12
191	American Tower Corp	美国发射塔公司	AMT UN	纽约证券交易所	美国	127	194,184.69	0.12
192	Viatis Inc	晖致	VTRS UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,527	193,835.15	0.12
193	S&P Global Inc	标普全球	SPGI UN	纽约证券交易所	美国	62	193,444.40	0.12
194	Advantest Corp	爱德万测试	6857 JT	日本证券交易所	日本	800	192,697.41	0.12
195	Bank of America Corp	美国银行公司	BAC UN	纽约证券交易所	美国	808	192,687.40	0.12
196	New York Times Co/The	纽约时报	NYT UN	纽约证券交易所	美国	551	191,186.79	0.12
197	Union Pacific Corp	联合太平洋	UNP UN	纽约证券交易所	美国	109	189,622.15	0.12
198	Fair Isaac Corp	费埃哲公司	FICO UN	纽约证券交易所	美国	23	189,619.67	0.12
199	Rambus Inc	Rambus 股份有限公司	RMBS UW	纳斯达克证券交易所	美国	392	189,490.56	0.12
200	Lululemon Athletica Inc	Lululemon Athletica 股份有限公司	LULU UW	纳斯达克证券交易所	美国	52	188,308.31	0.11
20	Charles	嘉信理	SCHW UN	纽约证	美国	384	187,119.27	0.11

1	Schwab Corp/The	财		券交易所				
20 2	Citigroup Inc	花旗集团	C UN	纽约证券交易所	美国	510	185,810.38	0.11
20 3	Rheinmetall AG	德国莱茵金属股份有限公司	RHM GY	德国证券交易所	德国	81	182,702.82	0.11
20 4	NetApp Inc	美国网域存储技术有限公司	NTAP UW	纳斯达克证券交易所	美国	291	181,703.55	0.11
20 5	Digital Realty Trust Inc	数字房地产信托有限公司	DLR UN	纽约证券交易所	美国	189	180,152.87	0.11
20 6	General Motors Co	通用汽车公司	GM UN	纽约证券交易所	美国	707	179,868.28	0.11
20 7	Cintas Corp	CINTAS 公司	CTAS UW	纳斯达克证券交易所	美国	42	179,275.32	0.11
20 8	McDonald's Corp	麦当劳	MCD UN	纽约证券交易所	美国	85	178,507.77	0.11
20 9	MercadoLibre Inc	MercadoLibre 股份有限公司	MELI UW	纳斯达克证券交易所	美国	16	178,091.94	0.11
21 0	InterDigital Inc	InterDigital 股份有限公司	IDCC UW	纳斯达克证券交易所	美国	231	177,582.70	0.11
21 1	Spotify Technology SA	Spotify 科技股份有限公司	SPOT UN	纽约证券交易所	美国	133	177,011.05	0.11
21 2	Intuitive Surgical Inc	直觉外科手术公司	ISRG UW	纳斯达克证券交易所	美国	74	176,817.06	0.11
21 3	Accenture PLC	埃森哲公司	ACN UN	纽约证券交易所	美国	71	176,462.71	0.11

21 4	Fast Retailing Co Ltd	迅销有 限公司	9983 JT	日本证 券交易 所	日本	100	175,695.29	0.11
21 5	Disco Corp	Disco 公司	6146 JT	日本证 券交易 所	日本	100	175,645.07	0.11
21 6	ITOCHU Corp	伊藤忠 商事	8001 JT	日本证 券交易 所	日本	600	173,747.02	0.11
21 7	elf Beauty Inc	elf Beauty 股份有 限公司	ELF UN	纽约证 券交易 所	美国	169	172,771.56	0.11
21 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	172,072.10	0.11
21 9	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	LVMH 集 团公司	MC FP	巴黎证 券交易 所	法国	29	167,199.76	0.10
21 9	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	LVMH 集 团公司	LVMUY UV	纽约证 券交易 所	美国	3	3,451.75	0.00
22 0	ConocoPhi llips	康菲石 油	COP UN	纽约证 券交易 所	美国	206	169,350.33	0.10
22 1	IDEXX Laborator ies Inc	爱德士 股份有 限公司	IDXX UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	43	169,043.86	0.10
22 2	Palantir Technolog ies Inc	Palant ir 科技 股份有 限公司	PLTR UN	纽约证 券交易 所	美国	1,383	168,186.57	0.10
22 3	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	360	167,736.71	0.10
22 4	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	166,845.01	0.10

22 5	Workday Inc	Workday 股份 有限公 司	WDAY UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	85	166,196.26	0.10
22 6	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	186	165,597.97	0.10
22 7	Prudentia Financial Inc	保德信 金融集 团	PRU UN	纽约证 券交易 所	美国	225	165,273.03	0.10
22 8	Cameco Corp	Cameco 公司	CCO CT	加拿大 证券交 易所	加 拿 大	529	162,209.31	0.10
22 9	ROBLOX Corp	Roblox 公司	RBLX UN	纽约证 券交易 所	美国	485	157,053.21	0.10
23 0	Intesa Sanpaolo SpA	意大利 联合圣 保罗银 行股份 有限公 司	ISP IM	意大利 证券交 易所	意 大 利	7,531	156,462.53	0.10
23 1	Philip Morris Internati onal Inc	菲利普 莫里斯 国际集 团公司	PM UN	纽约证 券交易 所	美国	234	155,923.66	0.10
23 2	Sempra	Sempra	SRE UN	纽约证 券交易 所	美国	294	155,611.31	0.09
23 3	CGN Power Co Ltd	中国广 核电力 股份有 限公司	1816 HK	香港证 券交易 所	中 国 香港	84,000	155,289.86	0.09
23 4	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	514	154,976.42	0.09
23 5	3M Co	3M 公司	MMM UN	纽约证 券交易 所	美国	198	153,307.59	0.09
23 6	FleetCor Technolog ies Inc	FleetC or 技术 股份有	FLT UN	纽约证 券交易 所	美国	76	152,124.78	0.09

		限公司						
23 7	PepsiCo Inc	百事可 乐	PEP UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	126	151,568.65	0.09
23 8	Qualys Inc	科力斯 公司	QLYS UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	108	150,140.77	0.09
23 9	Jiangxi Copper Co Ltd	江西铜 业股份 有限公 司	358 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	15,000	150,070.03	0.09
24 0	Comfort Systems USA Inc	美国舒 适系统 公司	FIX UN	纽约证 券交易 所	美国	103	150,039.99	0.09
24 1	Cie de Saint-Gob ain SA	法国圣 戈班公 司	SGO FP	巴黎证 券交易 所	法国	285	149,309.87	0.09
24 2	adidas AG	阿迪达 斯公司	ADS GY	德国证 券交易 所	德国	102	147,629.73	0.09
24 3	Boston Scientifi c Corp	波士顿 科学	BSX UN	纽约证 券交易 所	美国	359	146,992.87	0.09
24 4	Nucor Corp	纽柯公 司	NUE UN	纽约证 券交易 所	美国	119	146,688.10	0.09
24 5	China Shenhua Energy Co Ltd	中国神 华能源 股份有 限公司	1088 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	6,000	145,448.31	0.09
24 6	Bank of China Ltd	中国银 行股份 有限公 司	3988 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	53,000	143,128.39	0.09
24 7	Daiwa Securitie s Group Inc	大和证 券	8601 JT	日本证 券交易 所	日本	3,000	142,971.47	0.09
24 8	Intuit Inc	Intuit 股份有 限公司	INTU UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	32	141,660.80	0.09
24 9	China Everbrigh t Bank Co	中国光 大银行 股份有	6818 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	67,000	140,862.84	0.09

	Ltd	有限公司						
250	Allstate Corp/The	好事达 保险公司	ALL UN	纽约证 券交易 所	美国	140	138,801.09	0.08
251	Credit Agricole SA	法国农 业信贷 银行	ACA FP	巴黎证 券交易 所	法国	1,372	138,580.80	0.08
252	Carrefour SA	家乐福	CA FP	巴黎证 券交易 所	法国	1,063	138,389.51	0.08
253	Cboe Global Markets Inc	Cboe 环 球市场 公司	CBOE UF	芝加 哥期 权交 易所	美国	109	137,850.87	0.08
254	Industrial & Commercial Bank of China Ltd	中国工 商银行 股份有 限公司	1398 HK	香港证 券交易 所	中 国 香 港	39,000	135,008.66	0.08
255	Mizuho Financial Group Inc	瑞穗金 融集团	8411 JT	日本证 券交易 所	日本	1,100	133,252.75	0.08
256	Airbnb Inc	爱彼迎 股份有 限公司	ABNB UW	纳斯 达克证 券交易 所	美国	137	132,100.71	0.08
257	Assicurazioni Generali SpA	忠利保 险	G IM	意大利 证券交 易所	意 大 利	878	131,831.71	0.08
258	Cloudflare Inc	Cloudf lare 股 份有限 公司	NET UN	纽约证 券交易 所	美国	223	131,504.35	0.08
259	Atlas Copco AB	阿特拉 斯·科 普柯集 团	ATCOA SS	斯德哥 尔摩证 券交易 所	瑞典	1,060	130,794.88	0.08
260	Block Inc	Block 股份有 限公司	SQ UN	纽约证 券交易 所	美国	237	129,839.70	0.08
261	Expedia Group Inc	亿客行 集团股 份有限 公司	EXPE UW	纳斯 达克证 券交易 所	美国	120	129,009.96	0.08

26 2	Amgen Inc	安进公司	AMGN UW	纳斯达克 证券交易 所	美国	63	128,517.43	0.08
26 3	Broadridge Financial Solutions Inc	布罗德 里奇金 融解决 方案股 份有限 公司	BR UN	纽约证 券交易 所	美国	87	126,782.10	0.08
26 4	Gap Inc/The	Gap 股 份有限 公司	GPS UN	纽约证 券交易 所	美国	855	126,624.86	0.08
26 5	AT&T Inc	美国电 话电报 公司	T UN	纽约证 券交易 所	美国	1,062	126,216.26	0.08
26 6	Deutsche Post AG	DHL 集 团	DHL GY	德国证 券交易 所	德国	354	124,793.64	0.08
26 7	Koninklij ke Philips NV	飞利浦 公司	PHIA NA	阿姆斯特 丹交易 所	荷兰	747	123,786.33	0.08
26 8	DoorDash Inc	DoorDa sh 股 份有限 公司	DASH UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	173	121,170.62	0.07
26 9	James Hardie Industrie s PLC	James Hardie 工业有 限公司	JHX AT	澳大利 亚证券 交易所	澳大利 亚	441	120,783.78	0.07
27 0	National Grid PLC	英国国 家电网	NG/ LN	伦敦证 券交易 所	英国	1,258	120,333.79	0.07
27 1	China Railway Signal & Communica tion Corp Ltd	中国铁 路通信 信号股 份有限 公司	3969 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	51,000	120,164.77	0.07
27 2	Lloyds Banking Group PLC	劳埃德 银行集 团	LLOY LN	伦敦证 券交易 所	英国	27,422	118,285.07	0.07
27 3	Alleima AB	Alleim a AB	ALLEI SS	斯德哥 尔摩证 券交易 所	瑞典	2,170	118,212.16	0.07

				所				
27 4	Coca-Cola Co/The	可口可 乐	KO UN	纽约证 券交易 所	美国	283	118,119.53	0.07
27 5	Valero Energy Corp	Valero 能源	VLO UN	纽约证 券交易 所	美国	128	117,856.13	0.07
27 6	Spirit AeroSyste ms Holdings Inc	势必锐 航空系 统控股 有限公司	SPR UN	纽约证 券交易 所	美国	517	116,370.60	0.07
27 7	Crane Co	Crane Co	CR UN	纽约证 券交易 所	美国	139	116,308.27	0.07
27 8	Hilton Worldwide Holdings Inc	希尔顿 全球控 股股份 有限公司	HLT UN	纽约证 券交易 所	美国	90	116,072.00	0.07
27 9	Idemitsu Kosan Co Ltd	出光兴 产株式 会社	5019 JT	日本证 券交易 所	日本	3,000	115,615.43	0.07
28 0	BlackRock Inc	贝莱德 有限公司	BLK UN	纽约证 券交易 所	美国	20	114,994.72	0.07
28 1	Kunlun Energy Co Ltd	昆仑能 源	135 HK	香港证 券交易 所	中 国 香港	18,000	114,836.20	0.07
28 2	Owens Corning	欧文斯 科宁公 司	OC UN	纽约证 券交易 所	美国	109	114,435.68	0.07
28 3	A O Smith Corp	AO 史 密斯公 司	AOS UN	纽约证 券交易 所	美国	195	113,860.07	0.07
28 4	Copart Inc	Copart 股份有 限公司	CPRT UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	328	113,833.15	0.07
28 5	Mastercar d Inc	万事达 股份有 限公司	MA UN	纽约证 券交易 所	美国	37	111,771.17	0.07
28 6	McKesson Corp	McKess on 公 司	MCK UN	纽约证 券交易 所	美国	34	111,491.05	0.07

287	US Bancorp	美国合众银行	USB UN	纽约证券交易所	美国	363	111,273.75	0.07
288	Abercrombie & Fitch Co	阿贝克隆比&费奇公司	ANF UN	纽约证券交易所	美国	178	111,220.77	0.07
289	Komatsu Ltd	小松制作所	6301 JT	日本证券交易所	日本	600	111,111.33	0.07
290	First Citizens BancShares Inc/NC	第一公民银行（北卡）	FCNCA UW	纳斯达克证券交易所	美国	11	110,551.53	0.07
291	Volvo AB	沃尔沃集团	VOLVB SS	斯德哥尔摩证券交易所	瑞典	594	110,522.43	0.07
292	Lockheed Martin Corp	洛克希德马丁	LMT UN	纽约证券交易所	美国	34	109,145.54	0.07
293	DR Horton Inc	霍顿房屋公司	DHI UN	纽约证券交易所	美国	101	108,719.30	0.07
294	Carrier Global Corp	开利全球公司	CARR UN	纽约证券交易所	美国	266	108,235.70	0.07
295	London Stock Exchange Group PLC	伦敦证券交易所	LSEG LN	伦敦证券交易所	英国	129	108,162.84	0.07
296	Industria de Diseno Textil SA	爱特思集团	ITX SQ	西班牙证券交易所	西班牙	349	108,151.00	0.07
297	Air Liquide SA	液化空气集团	AI FP	巴黎证券交易所	法国	78	107,964.66	0.07
298	Zions Bancorp NA	锡安银行	ZION UW	纳斯达克证券交易所	美国	346	107,508.44	0.07
299	Sage Group PLC/The	塞奇集团	SGE LN	伦敦证券交易所	英国	1,014	107,490.99	0.07
30	Western	Wester	WAL UN	纽约证	美国	229	106,707.32	0.07

0	Alliance Bancorp	n Alliance Bancorp		券交易所				
301	Phillips 66	Phillips 66	PSX UN	纽约证券交易所	美国	112	105,614.96	0.06
302	Fifth Third Bancorp	五三银行	FITB UW	纳斯达克证券交易所	美国	432	105,529.96	0.06
303	J Sainsbury PLC	桑斯博里	SBRY LN	伦敦证券交易所	英国	3,839	105,028.74	0.06
304	Fairfax Financial Holdings Ltd	枫信金融控股 责任有限公司	FFH CT	加拿大证券交易所	加拿大	16	104,985.25	0.06
305	China Railway Construction Corp Ltd	中国铁路股份 有限公司	1186 HK	香港证券交易所	中国香港	25,000	104,894.97	0.06
306	Alimentation Couche-Tard Inc	Alimentation Couche-Tard 公司	ATD CT	加拿大证券交易所	加拿大	250	104,702.60	0.06
307	China Energy Engineering Corp Ltd	中国能源建设股份 有限公司	3996 HK	香港证券交易所	中国香港	148,000	104,614.04	0.06
308	Fastenal Co	法思诺公司	FAST UW	纳斯达克证券交易所	美国	228	104,594.20	0.06
309	Manhattan Associates Inc	曼哈顿联合软件 公司	MANH UW	纳斯达克证券交易所	美国	68	103,703.19	0.06
310	Redfin Corp	Redfin Corp	RDFN UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,415	103,427.25	0.06
311	Banco Bilbao Vizcaya	西班牙对外 银行	BBVA SQ	西班牙证券交易所	西班牙	1,585	102,469.90	0.06

	Argentaria SA							
31 2	Renesas Electronics Corp	瑞萨电子株式会社	6723 JT	日本证券交易所	日本	800	102,394.35	0.06
31 3	Lennar Corp	Lennar 公司	LEN UN	纽约证券交易所	美国	97	102,393.74	0.06
31 4	West Pharmaceutical Services Inc	西氏医药服务公司	WST UN	纽约证券交易所	美国	41	102,252.37	0.06
31 5	UWM Holdings Corp	UWM 控股公司	UWMC UN	纽约证券交易所	美国	2,016	102,092.87	0.06
31 6	Ryder System Inc	莱德系统股份有限公司	R UN	纽约证券交易所	美国	125	101,866.93	0.06
31 7	Alkami Technology Inc	Alkami Technology Inc	ALKT UW	纳斯达克证券交易所	美国	588	100,992.22	0.06
31 8	Trex Co Inc	Trex 公司	TREX UN	纽约证券交易所	美国	172	100,856.80	0.06
31 9	Tradeweb Markets Inc	Tradeweb Markets 股份有限公司	TW UW	纳斯达克证券交易所	美国	156	100,413.42	0.06
32 0	TransDigm Group Inc	TransDigm 集团公司	TDG UN	纽约证券交易所	美国	14	100,308.03	0.06
32 1	Jefferies Financial Group Inc	杰富瑞金融集团	JEF UN	纽约证券交易所	美国	349	99,887.96	0.06
32 2	Coinbase Global Inc	Coinbase 全球股份有限公司	COIN UW	纳斯达克证券交易所	美国	81	99,777.68	0.06
32	Vistra	Vistra	VST UN	纽约证	美国	365	99,581.35	0.06

3	Corp	公司		券交易所				
324	Builders FirstSource Inc	Builders FirstSource 股份有限公司	BLDR UN	纽约证券交易所	美国	84	99,320.42	0.06
325	NiSource Inc	NiSource 公司	NI UN	纽约证券交易所	美国	527	99,100.08	0.06
326	Zscaler Inc	Zscaler 股份有限公司	ZS UW	纳斯达克证券交易所	美国	63	98,862.31	0.06
327	Capgemini SE	凯捷咨询公司	CAP FP	巴黎证券交易所	法国	66	97,905.98	0.06
328	SkyWest Inc	SkyWest 股份有限公司	SKYW UW	纳斯达克证券交易所	美国	264	97,605.27	0.06
329	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	107	96,936.45	0.06
330	Eurazeo SE	欧瑞泽有限公司	RF FP	巴黎证券交易所	法国	169	95,431.51	0.06
331	Global Payments Inc	环汇有限公司	GPN UN	纽约证券交易所	美国	106	95,347.31	0.06
332	Freshpet Inc	Freshpet 公司	FRPT UQ	纳斯达克证券交易所	美国	155	95,246.73	0.06
333	Science Applications International Corp	科学应用国际公司	SAIC UN	纽约证券交易所	美国	108	95,096.30	0.06
334	WD-40 Co	WD-40 公司	WDFC UW	纳斯达克证券交易所	美国	56	94,822.62	0.06

335	AppLovin Corp	AppLovin 公司	APP UW	纳斯达克证券交易所	美国	335	94,552.27	0.06
336	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	146	93,252.81	0.06
337	Group 1 Automotive Inc	第一汽车集团公司	GPI UN	纽约证券交易所	美国	43	92,810.43	0.06
338	GXO Logistics Inc	GXO Logistics 股份有限公司	GXO UN	纽约证券交易所	美国	214	92,700.08	0.06
339	KeyCorp	KeyCorp 公司	KEY UN	纽约证券交易所	美国	907	92,505.73	0.06
340	Petroleo Brasileiro SA	巴西石油公司	PETR4 BS	巴西交易所	巴西	1,700	92,413.50	0.06
341	Pioneer Natural Resources Co	Pioneer 自然资源公司	PXD UN	纽约证券交易所	美国	58	92,379.94	0.06
342	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	44	91,896.05	0.06
343	Mazda Motor Corp	马自达	7261 JT	日本证券交易所	日本	1,200	91,799.41	0.06
344	Trane Technologies PLC	特灵科技公共有限公司	TT UN	纽约证券交易所	美国	53	91,555.94	0.06
345	Amphenol Corp	安费诺公司	APH UN	纽约证券交易所	美国	130	91,274.05	0.06
346	Cars.com Inc	Cars.com 股份有限公司	CARS UN	纽约证券交易所	美国	678	91,095.28	0.06

347	CME Group Inc	芝加哥商业交易所	CME UW	纳斯达克证券交易所	美国	61	90,988.61	0.06
348	Primerica Inc	Primerica 股份有限公司	PRI UN	纽约证券交易所	美国	62	90,354.85	0.06
349	Toll Brothers Inc	托尔兄弟公司	TOL UN	纽约证券交易所	美国	124	90,275.81	0.06
350	Japan Exchange Group Inc	日本交易所集团	8697 JT	日本证券交易所	日本	600	89,871.23	0.05
351	Chevron Corp	雪佛龙	CVX UN	纽约证券交易所	美国	85	89,798.72	0.05
352	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	206	89,599.41	0.05
353	Cigna Group/The	信诺集团	CI UN	纽约证券交易所	美国	42	89,078.41	0.05
354	RWE AG	莱茵集团	RWE GY	德国证券交易所	德国	275	89,001.51	0.05
355	Comerica Inc	Comerica 公司	CMA UN	纽约证券交易所	美国	225	88,939.23	0.05
356	Royal Bank of Canada	加拿大皇家银行	RY CT	加拿大证券交易所	加拿大	123	88,463.84	0.05
357	Danske Bank A/S	丹斯克银行股份公司	DANSKE DC	哥本哈根交易所	丹麦	465	88,384.79	0.05
358	Cheniere Energy Inc	Cheniere 能源公司	LNG UA	纽约证券交易所	美国	73	88,263.40	0.05
359	Nippon Yusen KK	日本邮船株式会社	9101 JT	日本证券交易所	日本	400	87,792.41	0.05
360	Boston Properties Inc	波士顿地产公司	BXP UN	纽约证券交易所	美国	175	86,973.79	0.05

361	Mitsubishi Chemical Group Corp	三菱化学控股	4188 JT	日本证券交易所	日本	2,000	86,768.06	0.05
362	FNB Corp/PA	FNB/宾州	FNB UN	纽约证券交易所	美国	883	86,117.91	0.05
363	Commerzbank AG	德国商业银行股份公司	CBK GY	德国证券交易所	德国	1,018	86,087.16	0.05
364	Inpex Corp	国际石油开发帝石控股	1605 JT	日本证券交易所	日本	900	86,067.59	0.05
365	Encompass Health Corp	南方保健公司	EHC UN	纽约证券交易所	美国	181	85,532.95	0.05
366	Accor SA	雅高股份公司	AC FP	巴黎证券交易所	法国	314	85,385.49	0.05
367	Principal Financial Group Inc	信安金融	PFG UW	纳斯达克证券交易所	美国	151	84,136.60	0.05
368	AES Corp/The	爱伊斯科公司	AES UN	纽约证券交易所	美国	616	83,986.66	0.05
369	Poste Italiane SpA	意大利邮政集团	PST IM	意大利证券交易所	意大利	1,011	81,641.61	0.05
370	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	81,636.90	0.05
371	MongoDB Inc	MongoDB 股份有限公司	MDB UQ	纳斯达克证券交易所	美国	28	81,081.33	0.05
372	Kinder Morgan Inc	特拉华州金德摩根公司	KMI UN	纽约证券交易所	美国	647	80,835.42	0.05

373	Extreme Networks Inc	Extreme Networks 股份有限公司	EXTR UW	纳斯达克证券交易所	美国	643	80,335.67	0.05
374	EssilorLuxottica SA	EssilorLuxottica 股份公司	EL FP	巴黎证券交易所	法国	56	79,924.92	0.05
375	Antero Midstream Corp	Antero 中游公司	AM UN	纽约证券交易所	美国	900	79,871.61	0.05
376	Halliburton Co	哈利伯顿	HAL UN	纽约证券交易所	美国	309	79,116.24	0.05
377	PACCAR Inc	帕卡	PCAR UW	纳斯达克证券交易所	美国	114	78,845.32	0.05
378	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	117	78,773.93	0.05
379	Sanofi SA	赛诺菲	SAN FP	巴黎证券交易所	法国	111	78,304.04	0.05
380	Verisk Analytics Inc	Verisk 分析公司	VRSK UW	纳斯达克证券交易所	美国	46	77,821.59	0.05
381	Marathon Petroleum Corp	马拉松石油公司	MPC UN	纽约证券交易所	美国	74	77,758.41	0.05
382	NRG Energy Inc	NRG 能源股份有限公司	NRG UN	纽约证券交易所	美国	212	77,629.23	0.05
383	Take-Two Interactive Software Inc	Take-Two 互动软件股份有限公司	TTWO UW	纳斯达克证券交易所	美国	68	77,517.32	0.05
384	Old Dominion Freight Line Inc	Old Dominion Freight	ODFL UW	纳斯达克证券交易所	美国	27	77,512.43	0.05

		t Line 股份有 限公司						
38 5	RTX Corp	RTX 公 司	RTX UN	纽约证 券交易 所	美国	130	77,471.99	0.05
38 6	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	77,137.45	0.05
38 7	IQVIA Holdings Inc	艾昆纬	IQV UN	纽约证 券交易 所	美国	47	77,023.37	0.05
38 8	Anheuser- Busch InBev SA/NV	百威英 博股份 公司	ABI BB	布鲁塞 尔证券 交易所	比 利 时	166	76,216.32	0.05
38 9	Nippon Sanso Holdings Corp	日酸控 股株式 会社	4091 JT	日本证 券交易 所	日本	400	75,841.72	0.05
39 0	Jeronimo Martins SGPS SA	Jeroni mo Martin s SGPS SA	JMT PL	里斯本 交易所	葡 萄 牙	411	74,422.22	0.05
39 1	Konami Group Corp	科乐美 控股株 式会社	9766 JT	日本证 券交易 所	日本	200	74,144.52	0.05
39 2	Enel SpA	意大利 国家电 力公司	ENEL IM	意大利 证券交 易所	意 大 利	1,401	74,102.27	0.05
39 3	Hess Corp	赫斯公 司	HES UN	纽约证 券交易 所	美国	72	73,515.03	0.04
39 4	Elastic NV	Elasti c 公共 有限责任 公司	ESTC UN	纽约证 券交易 所	美国	92	73,436.27	0.04
39 5	Canon Inc	佳能	7751 JT	日本证 券交易 所	日本	400	72,708.42	0.04
39	NIKE Inc	耐克公	NKE UN	纽约证	美国	94	72,283.06	0.04

6		司		券交易 所				
39 7	GMS Inc	GMS 股 份有限 公司	GMS UN	纽约证 券交易 所	美国	123	71,810.72	0.04
39 8	Danone SA	达能股 份有限 公司	BN FP	巴黎证 券交易 所	法国	154	71,021.39	0.04
39 9	UnitedHea lth Group Inc	联合健 康集团	UNH UN	纽约证 券交易 所	美国	19	70,847.75	0.04
40 0	Oversea-C hinese Banking Corp Ltd	华侨银 行有限 公司	OCBC SP	新加坡 证券交 易所	新加 坡	1,000	69,903.60	0.04
40 1	Duolingo Inc	多邻国	DUOL UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	43	69,088.55	0.04
40 2	Allianz SE	安联保 险有限 公司	ALV GY	德国证 券交易 所	德国	36	68,455.20	0.04
40 3	Shift4 Payments Inc	Shift4 Paymen ts 股份 有限公 司	FOUR UN	纽约证 券交易 所	美国	129	67,922.10	0.04
40 4	Wendel SE	温德尔 集团	MF FP	巴黎证 券交易 所	法国	106	67,187.51	0.04
40 5	EMCOR Group Inc	埃姆科 集团公 司	EME UN	纽约证 券交易 所	美国	44	67,136.35	0.04
40 6	Akamai Technolog ies Inc	阿卡迈 技术公 司	AKAM UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	80	67,059.00	0.04
40 7	Engie SA	Engie 公司	ENGI FP	巴黎证 券交易 所	法国	535	66,929.97	0.04
40 8	Restauran t Brands Internati onal Inc	Restau rant Brands Internati onal 股份	QSR UN	纽约证 券交易 所	美国	119	65,851.19	0.04

		有限公司						
409	Roku Inc	Roku 股份有限公司	ROKU UW	纳斯达克证券交易所	美国	101	65,569.23	0.04
410	Airbus SE	空中客车有限公司	AIR FP	巴黎证券交易所	法国	59	64,814.98	0.04
411	Carnival Corp	嘉年华公司	CCL UN	纽约证券交易所	美国	493	64,737.44	0.04
412	Tapestry Inc	TPR-DR S-RS	TPR UN	纽约证券交易所	美国	248	64,657.12	0.04
413	WW Grainger Inc	固安捷股份有限公司	GWV UN	纽约证券交易所	美国	11	64,562.99	0.04
414	America Movil SAB de CV	美洲电信可变动资本额股份有限公司	AMXB MF	墨西哥交易所	墨西哥	9,800	64,500.10	0.04
415	STMicroelectronics NV	意法半导体有限公司	STMPA FP	巴黎证券交易所	法国	180	64,006.11	0.04
416	ON Semiconductor Corp	安森美半导体公司	ON UW	纳斯达克证券交易所	美国	106	62,711.50	0.04
417	Altair Engineering Inc	Altair Engineering 股份有限公司	ALTR UW	纳斯达克证券交易所	美国	105	62,580.97	0.04
418	Marriott International Inc/MD	万豪国际	MAR UW	纳斯达克证券交易所	美国	39	62,291.57	0.04
419	Watts Water Technologies Inc	沃茨水工业公司	WTS UN	纽约证券交易所	美国	42	61,975.61	0.04
420	Moncler SpA	Moncler 股份	MONC IM	意大利证券交易所	意大利	139	60,848.28	0.04

		有限公司		易所				
42 1	SPS Commerce Inc	SPS 商 业股份 有限公 司	SPSC UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	44	60,408.06	0.04
42 2	BellRing Brands Inc	BellRi ng Brands Inc	BRBR UN	纽约证 券交易 所	美国	152	59,674.30	0.04
42 3	SBA Communica tions Corp	SBA 通 信公司	SBAC UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	33	59,294.74	0.04
42 4	Analog Devices Inc	亚德诺 半导体	ADI UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	42	59,066.32	0.04
42 5	Next PLC	Next 公 司	NXT LN	伦敦证 券交易 所	英国	80	58,716.52	0.04
42 6	Scout24 SE	Scout2 4 股份 公司	G24 GY	德国证 券交易 所	德国	113	56,979.83	0.03
42 7	Manulife Financial Corp	宏利金 融	MFC UN	纽约证 券交易 所	美国	364	56,976.07	0.03
42 8	Shanghai Pharmaceu ticals Holding Co Ltd	上海医 药集团 股份有 限公司	2607 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	5,500	56,919.68	0.03
42 9	MACOM Technolog y Solutions Holdings Inc	MACOM 技术解 决方案 控股股 份有限 公司	MTSI UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	86	56,616.98	0.03
43 0	Occidenta l Petroleum Corp	西方石 油	OXY UN	纽约证 券交易 所	美国	133	56,246.77	0.03
43 1	Brown & Brown Inc	Brown & Brown 股份有 限公司	BRO UN	纽约证 券交易 所	美国	111	55,905.24	0.03

43 2	Dynatrace Inc	Dynatrace 股份有限公司	DT UN	纽约证 券交易 所	美国	144	55,778.81	0.03
43 3	Garmin Ltd	佳明有 限公司	GRMN UN	纽约证 券交易 所	美国	61	55,535.03	0.03
43 4	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	128	55,492.10	0.03
43 5	Lowe's Cos Inc	劳氏	LOW UN	纽约证 券交易 所	美国	35	55,168.92	0.03
43 6	Mediobanc a Banca di Credito Finanziar io SpA	Mediobanca 公 共有限 公司	MB IM	意大利 证券交 易所	意大利	626	55,127.02	0.03
43 7	Brunello Cucinelli SpA	布鲁内 诺库奇 内利公 共有限 公司	BC IM	意大利 证券交 易所	意大利	79	55,009.68	0.03
43 8	Morningstar Inc	晨星公 司	MORN UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	27	54,738.51	0.03
43 9	Zillow Group Inc	Zillow 集团股 份有限 公司	Z UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	133	54,504.07	0.03
44 0	Chubb Ltd	邱博保 险集团	CB UN	纽约证 券交易 所	美国	34	54,423.47	0.03
44 1	Ares Managem ent Corp	阿瑞斯 管理有 限合伙 企业	ARES UN	纽约证 券交易 所	美国	64	53,905.58	0.03
44 2	Macy's Inc	梅西百 货股份 有限公 司	M UN	纽约证 券交易 所	美国	377	53,723.98	0.03
44 3	Erste Group Bank AG	奥地利 第一储 蓄银行	EBS AV	维也纳 证券交 易所	奥地利	185	53,403.66	0.03

		股份公 司						
44 4	Citizens Financial Group Inc	公民金 融集团 股份有 限公司	CFG UN	纽约证 券交易 所	美国	227	53,281.59	0.03
44 5	Carlisle Cos Inc	卡莱股 份有限 公司	CSL UN	纽约证 券交易 所	美国	24	53,108.35	0.03
44 6	Gitlab Inc	Gitlab 股份有 限公司	GTLB UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	119	53,065.29	0.03
44 7	Brenntag SE	Brennt ag	BNR GY	德国证 券交易 所	德国	81	52,977.45	0.03
44 8	Asahi Group Holdings Ltd	朝日集 团控股 株式会 社	2502 JT	日本证 券交易 所	日本	200	52,803.99	0.03
44 9	Oriental Land Co Ltd/Japan	东方地 产	4661 JT	日本证 券交易 所	日本	200	52,733.69	0.03
45 0	Atmos Energy Corp	Atmos 能源公 司	ATO UN	纽约证 券交易 所	美国	64	52,536.64	0.03
45 1	Caterpill ar Inc	卡特彼 勒	CAT UN	纽约证 券交易 所	美国	25	52,353.55	0.03
45 2	Coca-Cola Europacif ic Partners PLC	可口可 乐欧洲 合伙公 开股份 公司	CCEP UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	110	51,996.93	0.03
45 3	Simpson Manufactu ring Co Inc	辛普森 制造有 限公司	SSD UN	纽约证 券交易 所	美国	37	51,882.62	0.03
45 4	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	790	51,525.77	0.03
45 5	Coursera Inc	Course ra Inc	COUR UN	纽约证 券交易	美国	375	51,446.96	0.03

				所				
45 6	Fabrinet	Fabrinet 公司	FN UN	纽约证券交易所	美国	38	51,225.91	0.03
45 7	Bentley Systems Inc	Bentley 系统公司	BSY UW	纳斯达克证券交易所	美国	135	49,892.66	0.03
45 8	SEB SA	赛博股份有限公司	SK FP	巴黎证券交易所	法国	56	49,733.02	0.03
45 9	Campbell Soup Co	金宝汤	CPB UN	纽约证券交易所	美国	162	49,601.99	0.03
46 0	T Rowe Price Group Inc	普徠仕	TROW UW	纳斯达克证券交易所	美国	65	49,577.84	0.03
46 1	Walt Disney Co/The	华特迪士尼公司	DIS UN	纽约证券交易所	美国	77	49,241.27	0.03
46 2	Exxon Mobil Corp	埃克森美孚石油公司	XOM UN	纽约证券交易所	美国	69	48,860.86	0.03
46 3	InterContinental Hotels Group PLC	洲际酒店集团	IHG LN	伦敦证券交易所	英国	76	48,717.06	0.03
46 4	Pure Storage Inc	Pure 储存股份有限公司	PSTG UN	纽约证券交易所	美国	189	47,735.56	0.03
46 5	Consolidated Edison Inc	联合爱迪生	ED UN	纽约证券交易所	美国	73	47,034.86	0.03
46 6	Koninklijke 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	226	46,207.30	0.03
46 7	Quanta Services Inc	Quanta 服务股份有限公司	PWR UN	纽约证券交易所	美国	30	45,853.40	0.03
46 8	Zoom Video	Zoom 视频通信	ZM UW	纳斯达克证券	美国	89	45,329.21	0.03

	Communications Inc	股份有限公司		交易所				
469	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	10	44,676.26	0.03
470	Marathon Digital Holdings Inc	Marathon 数字控股股份有限公司	MARA UR	纳斯达克证券交易所	美国	268	44,587.86	0.03
471	MSCI Inc	MSCI 明晟	MSCI UN	纽约证券交易所	美国	11	44,069.62	0.03
472	Wix.com Ltd	Wix.com 有限公司	WIX UW	纳斯达克证券交易所	美国	50	43,565.69	0.03
473	Eagle Materials Inc	鹰牌材料有限公司	EXP UN	纽约证券交易所	美国	30	43,099.65	0.03
474	CVS Health Corp	CVS 健康公司	CVS UN	纽约证券交易所	美国	77	43,062.25	0.03
475	Cincinnati Financial Corp	辛辛那提金融	CINF UW	纳斯达克证券交易所	美国	58	42,501.02	0.03
476	Melrose Industries PLC	Melrose 工业公共有限公司	MRO LN	伦敦证券交易所	英国	810	41,552.35	0.03
477	Yankuang Energy Group Co Ltd	兖矿能源集团股份有限公司	1171 HK	香港证券交易所	中国香港	3,000	40,344.91	0.02
478	Williams-Sonoma Inc	Williams-Sonoma 股份有限公司	WSM UN	纽约证券交易所	美国	28	40,016.12	0.02
479	Thales SA	泰雷兹集团	HO FP	巴黎证券交易所	法国	38	40,004.11	0.02
48	Cognizant	高知特	CTSH UW	纳斯达克	美国	74	39,586.77	0.02

0	Technology Solutions Corp	科技公司		克证券交易所				
481	Yelp Inc	Yelp 公司	YELP UN	纽约证券交易所	美国	118	39,564.81	0.02
482	Dollar Tree Inc	美元树公司	DLTR UW	纳斯达克证券交易所	美国	39	39,237.80	0.02
483	Albemarle Corp	雅保公司	ALB UN	纽约证券交易所	美国	38	38,885.72	0.02
484	Itron Inc	爱拓利公司	ITRI UW	纳斯达克证券交易所	美国	71	37,971.84	0.02
485	Etsy Inc	Etsy 股份有限公司	ETSY UW	纳斯达克证券交易所	美国	65	37,313.43	0.02
486	BP PLC	BP 公司	BP/ LN	伦敦证券交易所	英国	874	36,834.80	0.02
487	Huntington Bancshares Inc/OH	俄亥俄州亨廷顿银行控股公司	HBAN UW	纳斯达克证券交易所	美国	408	36,757.51	0.02
488	Targa Resources Corp	Targa 资源公司	TRGP UN	纽约证券交易所	美国	58	35,685.90	0.02
489	Clorox Co/The	高乐氏公司	CLX UN	纽约证券交易所	美国	35	35,347.28	0.02
490	AvePoint Inc	AvePoint Inc	AVPT UW	纳斯达克证券交易所	美国	606	35,238.27	0.02
491	Snap Inc	Snap 股份有限公司	SNAP UN	纽约证券交易所	美国	290	34,773.93	0.02
492	Vertex Pharmaceuticals Inc	福泰制药	VRTX UW	纳斯达克证券交易所	美国	12	34,582.56	0.02
49	DCC PLC	DCC 公	DCC LN	伦敦证	英国	66	34,478.05	0.02

3		共有限公司		券交易所				
494	Aptiv PLC	Aptiv 公共有限公司	APTV UN	纽约证券交易所	美国	54	34,314.83	0.02
495	Herc Holdings Inc	Herc 控股公司	HRI UN	纽约证券交易所	美国	32	33,745.38	0.02
496	Exelixis Inc	Exelixis 股份有限公司	EXEL UW	纳斯达克证券交易所	美国	198	33,642.97	0.02
497	Pegasystems Inc	Pegasystems 股份有限公司	PEGA UW	纳斯达克证券交易所	美国	97	33,567.89	0.02
498	Starbucks Corp	星巴克公司	SBUX UW	纳斯达克证券交易所	美国	47	31,960.47	0.02
499	Arthur J Gallagher & Co	亚瑟加拉格尔有限公司	AJG UN	纽约证券交易所	美国	20	31,855.15	0.02
500	Paramount Global	派拉蒙全球	PARA UW	纳斯达克证券交易所	美国	286	29,959.40	0.02
501	Qurate Retail Inc	Qurate 零售股份有限公司	QRTEA UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,726	29,305.45	0.02
502	Commonwealth 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	54	29,270.76	0.02
503	COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd	中远海运控股股份有限公司	1919 HK	香港证券交易所	中国香港	4,000	28,455.31	0.02
504	Pentair PLC	Pentair 公共有限公司	PNR UN	纽约证券交易所	美国	55	28,324.07	0.02
505	News Corp	新闻集团	NWS UW	纳斯达克证券	美国	154	28,053.72	0.02

				交易所				
506	Westlake Corp	Westlake 公司	WLK UN	纽约证券交易所	美国	27	26,764.96	0.02
507	H&R Block Inc	H&R Block 股份有限公司	HRB UN	纽约证券交易所	美国	78	26,722.04	0.02
508	Sherwin-Williams Co/The	宣伟公司	SHW UN	纽约证券交易所	美国	12	26,509.13	0.02
509	Skechers USA Inc	斯凯奇美国公司	SKX UN	纽约证券交易所	美国	58	25,609.06	0.02
510	Renault SA	雷诺汽车公司	RNO FP	巴黎证券交易所	法国	82	23,783.59	0.01
511	Vipshop Holdings Ltd	唯品会控股有限公司	VIPS UN	纽约证券交易所	美国	188	23,648.29	0.01
512	Textron Inc	德事隆	TXT UN	纽约证券交易所	美国	41	23,353.22	0.01
513	CRRC Corp Ltd	中国中车股份有限公司	1766 HK	香港证券交易所	中国香港	7,000	21,821.78	0.01
514	Korn Ferry	光辉国际	KFY UN	纽约证券交易所	美国	51	21,438.27	0.01
515	E.ON SE	E.ON 有限公司	EOAN GY	德国证券交易所	德国	204	19,479.81	0.01
516	NN Group NV	NN 集团公众有限公司	NN NA	阿姆斯特丹交易所	荷兰	69	19,386.68	0.01
517	Avis Budget Group Inc	安飞士百捷乐集团股份有限公司	CAR UW	纳斯达克证券交易所	美国	15	18,832.19	0.01
518	Dow Inc	陶氏公司	DOW UN	纽约证券交易所	美国	47	18,255.52	0.01

519	China National Building Material Co Ltd	中国建材	3323 HK	香港证券交易所	中国香港	6,000	18,160.65	0.01
520	Zebra Technologies Corp	斑马技术公司	ZBRA UN	纳斯达克证券交易所	美国	9	17,423.23	0.01
521	XPeng Inc	小鹏汽车	XPEV UN	纽约证券交易所	美国	167	17,257.21	0.01
522	China Taiping Insurance Holdings Co Ltd	中国太平	966 HK	香港证券交易所	中国香港	2,800	17,051.44	0.01
523	Steel Dynamics Inc	Steel Dynamics 股份有限公司	STLD UN	纳斯达克证券交易所	美国	20	16,729.34	0.01
524	Las Vegas Sands Corp	拉斯维加斯金沙集团	LVS UN	纽约证券交易所	美国	45	15,684.29	0.01
525	Procter & Gamble Co/The	宝洁	PG UN	纽约证券交易所	美国	15	15,568.48	0.01
526	China Water Affairs Group Ltd	中国水务	855 HK	香港证券交易所	中国香港	4,000	15,550.74	0.01
527	NextEra Energy Inc	新纪元能源公司	NEE UN	纽约证券交易所	美国	36	15,487.32	0.01
528	TriNet Group Inc	TriNet 集团	TNET UN	纽约证券交易所	美国	18	15,162.22	0.01
529	Sinopharm Group Co Ltd	国药控股	1099 HK	香港证券交易所	中国香港	800	14,825.76	0.01
530	Sinotrans Ltd	中国外运股份有限公司	598 HK	香港证券交易所	中国香港	5,000	14,816.70	0.01

531	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	19	14,545.81	0.01
532	CITIC Securities Co Ltd	中信证券股份有限公司	6030 HK	香港证券交易所	中国香港	1,000	14,445.15	0.01
533	Southern Copper Corp	南方铜业公司	SCCO UN	纽约证券交易所	美国	23	14,020.98	0.01
534	Weatherford International 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	19	13,165.11	0.01
535	Accellero n Industries AG	Accellero n Industries AG	ACLN SE	瑞士证券交易所	瑞士	34	7,516.28	0.00
535	Accellero n Industries AG	Accellero n Industries AG	ACLLY UV	纽约证券交易所	美国	25	5,520.11	0.00
536	Kraft Heinz Co/The	卡夫亨氏公司	KHC UW	纳斯达克证券交易所	美国	49	12,833.99	0.01
537	Assa Abloy AB	亚萨合莱集团	ASSAB SS	斯德哥尔摩证券交易所	瑞典	59	12,177.53	0.01
538	Cardinal Health Inc	嘉德诺健康集团	CAH UN	纽约证券交易所	美国	17	12,136.91	0.01
539	Rio Tinto PLC	力拓公司	RIO UN	纽约证券交易所	美国	22	11,602.31	0.01
540	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	11,448.19	0.01
541	Equinix Inc	Equinix 有限公司	EQIX UW	纳斯达克证券交易所	美国	2	11,408.67	0.01

54 2	NetEase Inc	网易	NTES UW	纳斯达克 证券交易 所	美国	17	11,217.01	0.01
54 3	Zoetis Inc	硕腾股 份有限 公司	ZTS UN	纽约证 券交易 所	美国	8	11,183.30	0.01
54 4	WEX Inc	WEX 股 份有限 公司	WEX UN	纽约证 券交易 所	美国	8	11,023.51	0.01
54 5	Goldman Sachs Group Inc/The	高盛	GS UN	纽约证 券交易 所	美国	4	10,929.17	0.01
54 6	Sonic Healthcar e 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	69	10,732.03	0.01
54 7	Deckers Outdoor Corp	德克斯 户外用 品公司	DECK UN	纽约证 券交易 所	美国	2	9,468.58	0.01
54 8	Kering SA	开云集 团	KER FP	巴黎证 券交易 所	法国	3	9,407.46	0.01
54 9	Sika AG	瑞士西 卡股份 公司	SIKA SE	瑞士证 券交易 所	瑞士	4	9,216.46	0.01
55 0	China Pacific Insurance Group Co Ltd	中国太 平洋保 险(集 团)股 份有限 公司	2601 HK	香港证 券交易 所	中 国 香 港	600	8,569.22	0.01
55 1	Standard Chartered PLC	渣打集 团	STAN LN	伦敦证 券交易 所	英国	136	8,196.48	0.01
55 2	Deutsche Lufthansa AG	德国汉 莎航空 公司	LHA GY	德国证 券交易 所	德国	129	8,159.34	0.00
55 3	Skyworks Solutions Inc	思佳讯 解决方 案公司	SWKS UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	10	7,962.37	0.00
55 4	Align Technolog y Inc	Align 科技股 份有限	ALGN UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	4	7,762.64	0.00

		公司						
55 5	Evolution AB	Evolu tion 集 团	EVO SS	斯德哥 尔摩证 券交易 所	瑞典	9	7,692.71	0.00
55 6	HealthEqu ity Inc	Health equity 有限公 司	HQY UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	16	7,513.33	0.00
55 7	Ball Corp	波尔	BALL UN	纽约证 券交易 所	美国	18	7,333.14	0.00
55 8	BHP Group Ltd	必和必 拓集团	BHP AT	澳大利 亚证券 交易所	澳大 利亚	30	7,332.24	0.00
55 9	CF Industrie s Holdings Inc	CF 工业 控股股 份有限 公司	CF UN	纽约证 券交易 所	美国	13	7,319.97	0.00
56 0	Qorvo Inc	Qorvo 股份有 限公司	QRVO UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	9	7,178.25	0.00
56 1	Singapore Airlines Ltd	新加坡 航空公 司	SIA SP	新加坡 证券交 易所	新加 坡	200	7,054.89	0.00
56 2	PVH Corp	PVH 公 司	PVH UN	纽约证 券交易 所	美国	8	6,919.51	0.00
56 3	Juniper Networks Inc	瞻博网 络股份 有限公 司	JNPR UN	纽约证 券交易 所	美国	33	6,890.33	0.00
56 4	Northrop Grumman Corp	诺斯洛 普格鲁 门公司	NOC UN	纽约证 券交易 所	美国	2	6,631.39	0.00
56 5	MP Materials Corp	MP Materi als 公 司	MP UN	纽约证 券交易 所	美国	47	6,607.80	0.00
56 6	Keppel REIT	吉宝房 地产信 托	KREIT SP	新加坡 证券交 易所	新加 坡	1,320	6,601.05	0.00
56	Discover	Discov	DFS UN	纽约证	美国	8	6,368.76	0.00

7	Financial Services	er 金融服务公司		券交易所				
568	China Overseas Land & Investment Ltd	中国海外发展	688 HK	香港证券交易所	中国香港	500	6,234.79	0.00
569	Victoria's Secret & Co	维多利亚的秘密	VSCO UN	纽约证券交易所	美国	33	6,203.17	0.00
570	Vodafone Group PLC	沃达丰	VOD LN	伦敦证券交易所	英国	981	6,080.77	0.00
571	Vitesse Energy Inc	Vitesse Energy Inc	VTS UN	纽约证券交易所	美国	39	6,046.57	0.00
572	Crown Holdings Inc	Crown 控股股份有限公司	CCK UN	纽约证券交易所	美国	9	5,870.21	0.00
573	HCA Healthcare Inc	HCA 医疗保健有限公司	HCA UN	纽约证券交易所	美国	3	5,751.44	0.00
574	Brookfield Infrastructure Corp	Brookfield Infrastructure Corp	BIPC UN	纽约证券交易所	美国	23	5,747.19	0.00
575	BrightSphere Investment Group Inc	BrightSphere 投资集团有限公司	BSIG UN	纽约证券交易所	美国	42	5,699.59	0.00
576	Computershare Ltd	Computershare 有限公司	CPU AT	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	48	5,676.12	0.00
577	Angang Steel Co Ltd	鞍钢股份有限公司	347 HK	香港证券交易所	中国香港	4,000	5,582.32	0.00
578	Legal & General	法通集团公共	LGEN LN	伦敦证券交易所	英国	232	5,266.89	0.00

	Group PLC	有限公司		所				
579	Qifu Technology Inc	奇富科技-S	QFIN UW	纳斯达克证券交易所	美国	46	5,154.22	0.00
580	Nordea Bank Abp	北欧联合银行	NDA SS	斯德哥尔摩证券交易所	瑞典	55	4,877.07	0.00
581	Cerence Inc	Cerence Inc	CRNC UW	纳斯达克证券交易所	美国	34	4,734.36	0.00
582	RingCentral Inc	RingCentral 股份有限公司	RNG UN	纽约证券交易所	美国	17	4,087.78	0.00
583	Zhuzhou CRRC Times Electric Co Ltd	株洲中车时代电气股份有限公司	3898 HK	香港证券交易所	中国香港	200	4,041.74	0.00
584	Wolfspeed Inc	Wolfspeed 股份有限公司	WOLF UN	纽约证券交易所	美国	13	4,006.19	0.00
585	State Street Corp	道富集团	STT UN	纽约证券交易所	美国	7	3,840.38	0.00
586	Confluent Inc	Confluent 股份有限公司	CFLT UW	纳斯达克证券交易所	美国	23	3,811.91	0.00
587	Pernod Ricard SA	保乐力加股份有限公司	RI FP	巴黎证券交易所	法国	3	3,766.52	0.00
588	Oracle Corp	甲骨文	ORCL UN	纽约证券交易所	美国	5	3,733.65	0.00
589	Texas Instruments Inc	德州仪器	TXN UW	纳斯达克证券交易所	美国	3	3,621.95	0.00
590	TC Energy Corp	TC 能源公司	TRP CT	加拿大证券交	加拿大	13	3,611.55	0.00

				易所				
59 1	Resona Holdings Inc	理索纳控股株式会社	8308 JT	日本证券交易所	日本	100	3,597.76	0.00
59 2	DENTSPLY SIRONA Inc	登士柏西诺德公司	XRAY UW	纳斯达克证券交易所	美国	14	3,529.03	0.00
59 3	Allegro Microsystems Inc	Allegro Microsystems 股份有限公司	ALGM UW	纳斯达克证券交易所	美国	15	3,215.90	0.00
59 4	Telstra Group Ltd	Telstra Group Ltd	TLS AT	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	164	3,148.74	0.00
59 5	Ovintiv Inc	Ovintiv 股份有限公司	OVV UN	纽约证券交易所	美国	10	3,110.72	0.00
59 6	ArcelorMittal SA	安赛乐米塔尔	MT UN	纽约证券交易所	美国	13	2,614.01	0.00
59 7	Jinmao Property Services Co Ltd	金茂服务	816 HK	香港证券交易所	中国香港	1,480	2,414.17	0.00
59 8	Owens & Minor Inc	Owens & Minor 公司	OMI UN	纽约证券交易所	美国	17	2,320.22	0.00
59 9	CNH Industrial NV	凯斯纽荷兰工业集团	CNHI IM	意大利证券交易所	意大利	26	2,264.08	0.00
60 0	Affiliated Managers Group Inc	Affiliated Managers 集团 股份有限公司	AMG UN	纽约证券交易所	美国	2	2,144.92	0.00
60 1	Credicorp Ltd	Credicorp 有限公司	BAP UN	纽约证券交易所	美国	2	2,123.82	0.00
60 2	Roche Holding	罗氏控股股份	ROG SE	瑞士证券交易所	瑞士	1	2,058.30	0.00

	AG	公司		所				
603	Schindler Holding AG	迅达控股有限公司	SCHP SE	瑞士证券交易所	瑞士	1	1,770.39	0.00
604	Monster Beverage Corp	怪兽饮料公司	MNST UW	纳斯达克证券交易所	美国	4	1,632.14	0.00
605	Insulet Corp	Insulet 股份有限公司	PODD UW	纳斯达克证券交易所	美国	1	1,536.80	0.00
606	Array Technologies Inc	Array Technologies 股份有限公司	ARRY UQ	纳斯达克证券交易所	美国	12	1,427.87	0.00
607	Trip.com Group Ltd	携程集团	TCOM UW	纳斯达克证券交易所	美国	4	1,020.19	0.00
608	Leidos Holdings Inc	Leidos 控股公司	LDOS UN	纽约证券交易所	美国	1	766.63	0.00
609	Epiroc AB	安百拓集团	EPIA SS	斯德哥尔摩证券交易所	瑞典	5	718.81	0.00
610	Pfizer Inc	辉瑞制药	PFE UN	纽约证券交易所	美国	3	611.73	0.00
611	Tenable Holdings Inc	Tenable 控股股份有限公司	TENB UW	纳斯达克证券交易所	美国	1	326.23	0.00
612	Arlo Technologies Inc	Arlo Technologies Inc	ARLO UN	纽约证券交易所	美国	3	202.28	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	Alphabet Inc	GOOGL UW	2,489,064.67	1.54
2	Amazon.com Inc	AMZN UW	2,195,387.15	1.36
3	Advanced Micro Devices Inc	AMD UW	1,754,273.53	1.09
4	NVIDIA Corp	NVDA UW	1,685,661.90	1.04
5	Yealink Network Technology Corp Ltd	300628 CH	1,330,388.00	0.82
6	Jiangsu Zhangjiagang Rural Commercial Bank Co Ltd	002839 CH	1,318,007.00	0.82
7	Zhejiang Qianjiang Biochem	600796 CH	1,233,712.00	0.76
8	Shanghai SK Petroleum & Chemical Equipment Corp Ltd	002278 CH	1,225,610.00	0.76
9	China Fangda Group Co Ltd	000055 CH	1,221,604.00	0.76
10	Shanghai Yongli Belting Co Ltd	300230 CH	1,208,356.00	0.75
11	Liaoning Kelong Fine Chemical Co Ltd	300405 CH	1,111,975.40	0.69
12	Beihai Gofar Chuanshan Biological Co Ltd	600538 CH	1,101,951.00	0.68
13	Adobe Inc	ADBE UW	1,087,891.03	0.67
14	Avary Holding Shenzhen Co Ltd	002938 CH	1,063,025.00	0.66
15	Red Star Macalline Group Corp Ltd	601828 CH	1,031,210.00	0.64
16	Industrial Securities Co Ltd	601377 CH	1,026,140.00	0.64
17	Jihua Group Corp Ltd	601718 CH	1,017,677.00	0.63
18	Shaanxi Beiyuan Chemical Industry Group Co Ltd	601568 CH	1,017,342.00	0.63
19	Jiangsu Changbao Steeltube Co Ltd	002478 CH	1,004,345.00	0.62

20	Anhui Guangxin Agrochemical Co Ltd	603599 CH	1,002,763.00	0.62
----	------------------------------------	-----------	--------------	------

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	Berkshire Hathaway Inc	BRK/B UN	3,847,550.85	2.38
2	Exxon Mobil Corp	XOM UN	2,287,499.26	1.42
3	CIG Shanghai Co Ltd	603083 CH	1,688,901.00	1.05
4	Steel Dynamics Inc	STLD UW	1,667,990.68	1.03
5	CRRC Corp Ltd	601766 CH	1,573,675.00	0.97
5	CRRC Corp Ltd	1766 HK	83,364.01	0.05
6	Apple Inc	AAPL UW	1,527,917.18	0.95
7	Activision Blizzard Inc	ATVI UW	1,502,568.44	0.93
8	Teck Resources Ltd	TECK UN	1,444,918.15	0.89
9	China Shenhua Energy Co Ltd	601088 CH	1,050,930.00	0.65
9	China Shenhua Energy Co Ltd	1088 HK	339,020.66	0.21
10	Jiangsu Zhangjiagang Rural Commercial Bank Co Ltd	002839 CH	1,344,252.00	0.83
11	NVIDIA Corp	NVDA UW	1,344,114.14	0.83
12	Yealink Network Technology Corp Ltd	300628 CH	1,332,234.00	0.82
13	BOE Technology Group Co Ltd	000725 CH	1,295,132.00	0.80
14	Baidu Inc	BIDU UW	1,198,330.15	0.74
15	Zhejiang Qianjiang Biochem	600796 CH	1,184,249.00	0.73
16	Shanghai Yongli Belting Co Ltd	300230 CH	1,170,041.00	0.72
17	Shanghai SK Petroleum & Chemical Equipment Corp Ltd	002278 CH	1,168,613.00	0.72
18	China Fangda Group Co Ltd	000055 CH	1,157,249.00	0.72
19	RTX Corp	RTX UN	1,091,157.08	0.68

20	Foxconn Industrial Internet Co Ltd	601138 CH	1,077,071.00	0.67
----	------------------------------------	-----------	--------------	------

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	321,899,284.61
卖出收入（成交）总额	344,575,333.46

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+	7,941,339.73	4.85
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	019709	23 国债 16	79,000	7,941,339.73	4.85

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 只债券。

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	iShares 20+ Year Treasury Bond ETF	ETF	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	357,172.06	0.22
2	SPDR Gold Shares	ETF	交易型开放式	State Street Global Advisors Inc	297,879.95	0.18
3	VanEck Gold Miners ETF/USA	ETF	交易型开放式	Van Eck Associates Corp	220,073.80	0.13
4	Invesco QQQ Trust Series 1	ETF	交易型开放式	Invesco Capital Management LLC	214,637.54	0.13
5	Global X Artificial Intelligence & Technology ETF	ETF	交易型开放式	Global X Management Co LLC	188,596.15	0.12
6	ARK Innovation ETF	ETF	交易型开放式	ARK Investment Management LLC	186,573.26	0.11
7	iShares CORE S&P/ASX 200 ETF	ETF	交易型开放式	BlackRock Investment Management Australia Ltd/Australia	25,460.94	0.02
8	iShares Core MSCI Europe ETF	ETF	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	7,014.42	0.00

9	iShares MSCI ACWI ETF	ETF	交易型开放 式	BlackRock Fund Advisors	720.81	0.00
---	-----------------------------	-----	------------	-------------------------------	--------	------

注：报告期末，本基金仅持有上述 9 只基金。

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	9,580.05
2	应收清算款	2,494,788.42
3	应收股利	75,430.39
4	应收利息	-
5	应收申购款	362,676.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,942,475.26

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	户均持有的基 金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		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	4,794	33,476.54	42,043,678.99	26.20	118,442,834.63	73.80
嘉实全球 价值股票 (QDII) 美元现汇	21	11,880.94	-	-	249,499.68	100.00
合计	4,813	33,396.22	42,043,678.99	26.16	118,692,334.31	73.84

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 理人所有从业 人员持 有本基 金	嘉实全球价值股票（QDII）人 民币	231,700.94	0.14
	嘉实全球价值股票（QDII）美 元现汇	-	-
	合计	231,700.94	0.14

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、 基金投资和相关部门 负责人持有本开放式 基金	嘉实全球价值股票（QDII） 人民币	10~50
	嘉实全球价值股票（QDII） 美元现汇	0
	合计	10~50
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品情况

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	188,279,860.18	445,785.86
本报告期基金总申购份额	29,701,860.15	42,196.19
减：本报告期基金总赎回份额	57,495,206.71	238,482.37
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	160,486,513.62	249,499.68

§ 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

2023年4月29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》，张峰先生任公司副总经理。

2023年4月29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》，程剑先生任公司副总经理。

2023年4月29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》，李明先生任公司财务总监。

2023 年 6 月 20 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》，姚志鹏先生任公司副总经理。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。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 40,000.00 元，该审计机构已连续 2 年为本基金提供审计服务。

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

本报告期，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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 CITIC Securities Co., Ltd	-	270,655,031.57	40.72	170,996.77	45.09	-
摩根大通 证券（亚 太）有限公 司 J.P.Morgan Secu	-	156,708,408.74	23.58	61,950.47	16.34	-

rities (Asia Pacific) Limited						
海通证券股份有限公司 Haitong Securities CO., LTD	-	60,501,839.82	9.10	39,077.11	10.31	-
开源证券股份有限公司 Kaiyuan Securities CO., LTD	-	35,110,763.21	5.28	22,646.85	5.97	-
东方财富证券 Eastmoney Securities CO., LTD	-	21,389,296.57	3.22	13,814.82	3.64	-
长江证券 Changjiang Securities Company Limited	-	16,471,492.91	2.48	10,637.77	2.81	-
华兴证券有限公司 China Renaissance Security	-	4,982,772.99	0.75	9,965.57	2.63	-
申万宏源证券 Shenwan Hongyuan Securities CO., LTD	-	13,147,154.80	1.98	9,203.41	2.43	-
花旗环球金融亚洲有限公司 Citigroup	-	28,927,626.36	4.35	9,026.27	2.38	-

Global Markets Asia Limited						
瑞银集团 Union Bank of Switzerland	-	16,123,343.47	2.43	8,854.40	2.33	-
野村证券 NOMURA	-	8,700,835.42	1.31	6,032.70	1.59	-
元大证券 (香港)有限公司 Yuanta Securities (Hong Kong) Company Limited	-	2,574,033.05	0.39	5,148.04	1.36	-
高盛(亚洲)有限责任公司 Goldman Sachs (Asia) L.L.C	-	9,847,216.41	1.48	4,071.95	1.07	-
瑞士信贷 (香港)有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	8,411,381.59	1.27	2,614.55	0.69	-
盛博香港有限公司 Sanford C. Bernstein (Hong Kong) Limited	-	2,279,848.45	0.34	1,924.84	0.51	-
极讯欧洲	-	4,905,457.68	0.74	1,486.86	0.39	-

有限公司 Instinet Europ e Limite d						
长城证券 Greatwall Secur ities CO ., LTD	-	1,307,635.68	0.20	915.36	0.24	-
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	-	1,627,491.43	0.24	470.43	0.12	-
里昂证券 有限公司 CLSA L imited	-	86,037.28	0.01	215.09	0.06	-
香港上海 汇丰银行 有限公司 The Ho ngkong a nd Shang hai Bank ing Corp oration Limited	-	887,427.42	0.13	150.63	0.04	-
法国巴黎 兴业银行 SOCIETE GENERAL E Corpor ate and Investm ent Bank	-	-	-	-	-	-

ing						
信达国际 证券有限 公司 CINDA INTERNATI ONAL SEC URITIES LIMITED	-	-	-	-	-	-
招商证券 (香港)有 限公司 China Merchants Securit ies (HK) Co. , Ltd.	-	-	-	-	-	-
中国银河 证券股份 有限公司 China Galaxy I nternatio nal Fina ncials H oldings	-	-	-	-	-	-

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 CITIC Securities Co., Ltd	14,663,884.95	43.74	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券 (亚太) 有限公司 J.P.Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-	2,992,632.65	79.25
海通证券股份有限公司 Haitong Securities CO.,LTD	100,120.23	0.30	-	-	-	-	-	-
开源证券 Kaiyuan Securities CO.,LTD	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券 Eastmoney Securities CO.,LTD	1,523,882.70	4.55	-	-	-	-	-	-
长江证券 Changjiang Securities Company Limited	3,982,449.00	11.88	-	-	-	-	-	-
华兴证券有限公司 China Renaissance Security	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券 Shenwan Hongyuan Securities CO.,LTD	-	-	-	-	-	-	-	-
花旗环球金融亚洲有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited	-	-	-	-	-	-	107,461.86	2.85
瑞银集团 Union Bank of Switzerland	-	-	-	-	-	-	199,058.60	5.27
野村证券 NOMURA	-	-	-	-	-	-	84,354.03	2.23
元大证券(香港)有限公司 Yuanta Securities (Hong Kong) Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-

高盛（亚洲）有限责任公司 Goldman Sachs (Asia) L.L.C	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞士信贷（香港）有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
盛博香港有限公司 Sanford C. Bernstein (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	167,023.62	4.42	
极讯欧洲有限公司 Instinet Europe Limited	-	-	-	-	-	-	-	
长城证券 Greatwall Securities CO., LTD	4,083,720.59	12.18	-	-	-	-	-	
中国国际金融香港证券有限公司 China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	-	-	-	-	-	225,900.01	5.98	
里昂证券有限公司 CLSA Limited	-	-	-	-	-	-	-	
香港上海汇丰银行有限公司 The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	-	-	-	-	-	-	-	
法国巴黎兴业银行 SOCIETE GENERALE Corporate and Investment Banking	-	-	-	-	-	-	-	
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.	-	-	-	-	-	-	-	
中国银河证券股份有限公司 China Galaxy International Financials Holdings	9,170,570.00	27.35	-	-	-	-	-	

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	关于嘉实全球价值股票（QDII）2023 年 1 月 16 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	2023 年 1 月 12 日
2	关于嘉实全球价值股票（QDII）2023 年 2 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	2023 年 2 月 16 日
3	嘉实基金管理有限公司关于防范不法分子诈骗活动的提示性公告	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	2023 年 3 月 21 日
4	关于嘉实全球价值股票（QDII）2023 年 4 月 7 日、4 月 10 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	2023 年 4 月 4 日

5	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	2023 年 4 月 29 日
6	关于嘉实全球价值股票（QDII）2023 年 5 月 8 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	2023 年 5 月 4 日
7	关于嘉实全球价值股票（QDII）2023 年 5 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	2023 年 5 月 25 日
8	关于嘉实全球价值股票（QDII）2023 年 6 月 19 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	2023 年 6 月 15 日
9	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	2023 年 6 月 20 日
10	关于嘉实全球价值股票（QDII）2023 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	2023 年 6 月 30 日
11	关于嘉实全球价值股票（QDII）2023 年 8 月 28 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	2023 年 8 月 24 日
12	关于嘉实全球价值股票（QDII）2023 年 9 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	2023 年 8 月 31 日
13	关于嘉实全球价值股票（QDII）2023 年 11 月 23 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	2023 年 11 月 21 日
14	关于嘉实全球价值股票（QDII）2023 年 12 月 25 日、12 月 26 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	2023 年 12 月 21 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

2024 年 3 月 28 日