

嘉实全球价值机会股票型证券投资基金  
(QDII)  
2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 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：2022 年 8 月 29 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。本中期报告已经由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 2022 年 08 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.8 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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	17
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	20
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>48</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	48
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	49
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	49

7.4 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 .....	49
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动 .....	97
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....	98
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 .....	99
7.8 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 .....	99
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 .....	99
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....	99
7.11 投资组合报告附注 .....	101
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>102</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	102
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	102
8.3 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 .....	103
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>103</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>103</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	103
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	103
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	104
10.4 基金投资策略的改变 .....	104
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	104
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	104
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	104
10.8 其他重大事件 .....	108
<b>§11 备查文件目录 .....</b>	<b>109</b>
11.1 备查文件目录 .....	109
11.2 存放地点 .....	109
11.3 查阅方式 .....	109

## § 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	205,860,844.30 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	205,582,805.34 份	278,038.96 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
	联系电话	(010)65215588
	电子邮箱	service@jsfund.cn
客户服务电话	400-600-8800	95599

传真	(010)65215588	010-68121816
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期27楼09-14单元	北京东城区建国门内大街69号
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街21号北京国际俱乐部C座写字楼12A层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码	100005	100031
法定代表人	经雷	谷澍

## 2.4 境外资产托管人

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

## 2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a>
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年01月01日-2022年06月30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
本期已实现收益	-11,215,782.63	-91,421.66
本期利润	-31,628,218.74	-253,397.02
加权平均基金份额	-0.1439	-0.9032

额本期利润		
本期加权平均净值利润率	-15.77%	-15.50%
本期基金份额净值增长率	-14.12%	-18.42%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
期末可供分配利润	-30,472,530.96	-263,457.04
期末可供分配基金份额利润	-0.1482	-0.9476
期末基金资产净值	175,110,274.38	1,513,965.21
期末基金份额净值	0.8518	0.8113
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-14.82%	-18.87%

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

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

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

（4）嘉实全球价值股票(QDII)美元现汇的期末基金份额净值单位为美元。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实全球价值股票（QDII）人民币

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-5.98%	1.35%	-4.72%	1.22%	-1.26%	0.13%

过去三个月	-8.76%	1.28%	-11.14%	1.12%	2.38%	0.16%
过去六个月	-14.12%	1.12%	-17.51%	1.07%	3.39%	0.05%
自基金合同生效起 至今	-14.82%	1.01%	-17.04%	1.02%	2.22%	-0.01%

## 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
过去一个月	-6.69%	1.36%	-4.72%	1.22%	-1.97%	0.14%
过去三个月	-13.70%	1.32%	-11.14%	1.12%	-2.56%	0.20%
过去六个月	-18.42%	1.15%	-17.51%	1.07%	-0.91%	0.08%
自基金合同生效起 至今	-18.87%	1.04%	-17.04%	1.02%	-1.83%	0.02%

注：本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

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

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

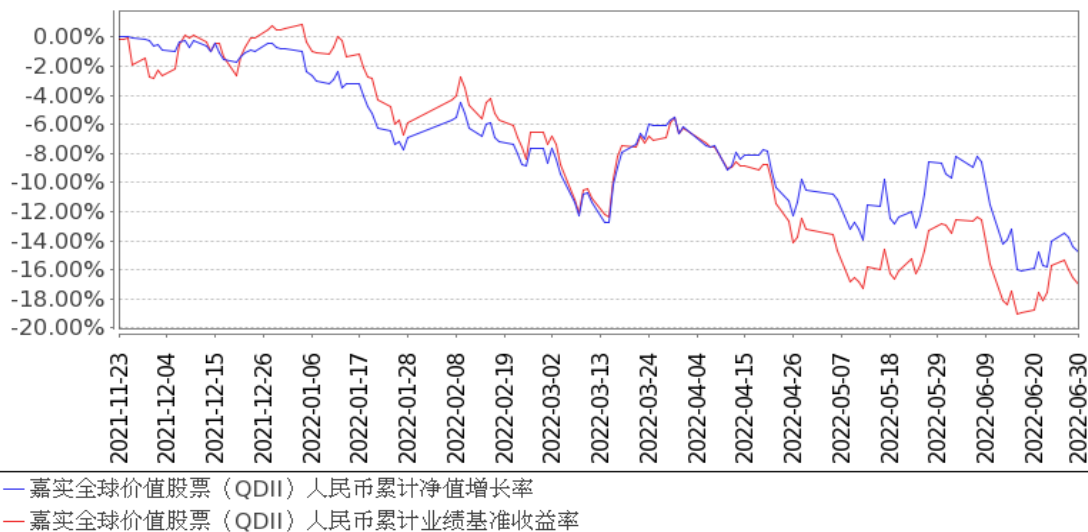
其中， $t = 1, 2, 3, \dots, T$ ， $T$  表示时间截至日。



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

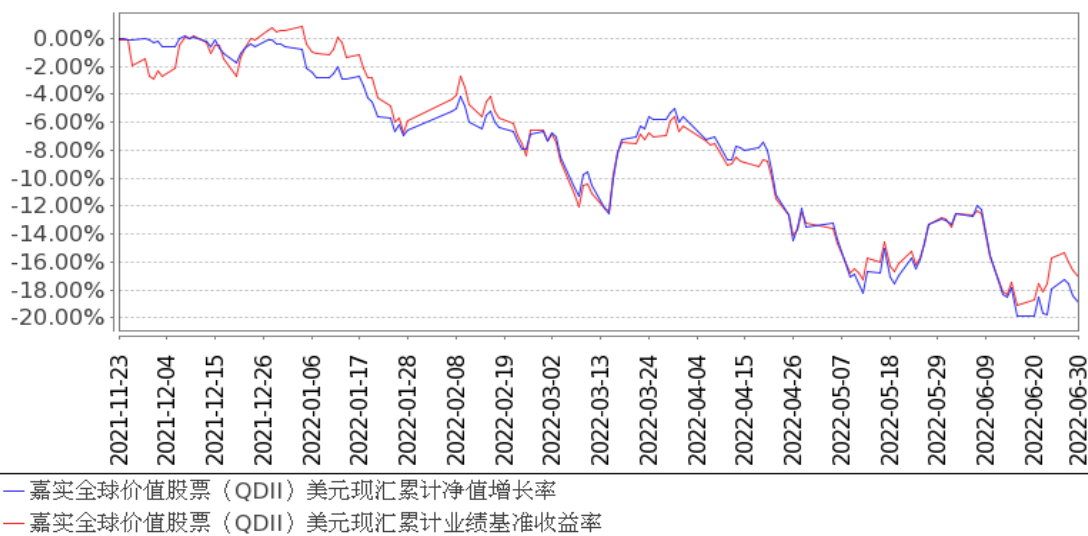
#### 嘉实全球价值股票（QDII）人民币累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2021年11月23日至2022年06月30日）



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

（2021年11月23日至2022年06月30日）



注：（1）本基金合同生效日 2021 年 11 月 23 日至报告期末未满 1 年。

（2）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。

### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止 2022 年 6 月 30 日, 基金管理人共管理 277 只开放式证券投资基金, 覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF 等不同类别。同时, 还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张自力	本基金、嘉实美国成长股票（QDII）、嘉实事件驱动股票基金经理	2021 年 11 月 23 日	-	26 年	曾任美国世纪投资管理公司（American Century Investments）资深副总经理, 研究部总监暨基金经理, 负责直接管理、支持公司旗下近二百亿美元的多项大型公募基金和对冲基金类产品。2012 年 2 月加入嘉实基金管理有限公司, 曾任定量投资部负责人, 现任人工智能投资部负责人。理论物理学博士, 毕业于美国德州大学奥斯汀分校和中国科学技术大学, 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 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，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；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

#### 4.3.2 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 4 次，其中 1 次为旗下组合被动跟踪模拟组合权重配置需要与其他组合发生反向交易，另 3 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 上半年，在报告期内，本组合已完成建仓，面向目标比例完成各类资产配置。本组合面向全球资本市场投资，根据投资基准定义，底层资产上美股配置约达到 60%，境内资产要求至少达到 20%，并在欧股日股港股等发达市场以及新兴市场如印度、巴西等进行配置。

报告期内，全球较为重大的经济事件，为美联储在量化宽松退出操作并缩表的进程中，达到了单次加息 75bps 的强度，并吹风将在随后的三季度内进一步保持如此强度的加息节奏。新冠疫情已进入第三年，部分国家已经逐步放松或进一步宣称与新冠共存，但新变种对社会秩序和经济复苏进程的持续影响依然存在，国内核心经济区包括上海北京也先后经历了疫情的反弹和管控应对过程。二月下旬爆发的俄乌冲突尚未看到明确的妥协空间和终止路径，但对国际资源能源及农业等基础大宗商品的影响则持续存在。

就美股而言，2022 年一季度，美国股票市场在开年后开始持续下行，短暂离开各大股指持续多年的强势上行轨迹，并在三月份中旬重拾上行趋势；二季度，美国股票市场延续了开年后一季度的持续下行，在二季度内继续回调，至 6 月中旬的上半年累积回调幅度已经达到近几年的最大值。结构上，价值风格显著占优，且扭曲强度较大。一季度内，大盘价值指数罗素 1000 价值超越同期大盘成长指数罗素 1000 成长达到 8%以上，小市值内价值相对成长风格的超额收益接近 10%，分化显著。美股在 2021 年初就逐步显现了价值风格的回暖，并在 2022 年随着大宗商品价格上行，

拉动产业链相关上游板块的盈利上行，通胀交易与价值风格有所叠加。

就 A 股而言，一季度报告期内，A 股市场整体全面回撤。大盘指数沪深 300 等跌幅达到 15% 水平，创业板指和中小板指跌幅接近 20% 水平；二季度报告期内，A 股市场在延续了一季度的回调后，走出相对全球主要股指更加独立的趋势，转入上行趋势。在国内上海等地疫情及相应的管控措施的影响下，国内经济在一季度面临较大增长压力，居民消费、出行以及工业生产等全面受到疫情影响，同时全球资本环境在美联储的加息过程中逐步收紧，权益类市场在估值维度内受到利率政策的直接影响。在多方面影响下，A 股在一季度逐步走弱并加速下探，新能源、电子、军工等高估值高成长板块回撤更强，白酒与生物医药波动较大，二季度 4 月份后随着疫情管控见效，生产生活活动逐步放开，包括汽车等耐用品消费的累积需求逐步释放，市场信心逐步增强，投资者情绪也逐步抬升，成长股、主题板块等在五月份迎来持续和强劲的反弹。

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

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

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

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

会较好的方向。

本报告期间，运作主要包括各类资产头寸的有效配置、各国别内的选股和组合层面的风险控制。由于投资的资本市场涉及全球不同国家不同体制，本基金资金运作流程较长，单向包括从人民币申购、确认、换汇和掉汇等一系列步骤，涉及国内外券商和银行的多个环节，后续在市场大幅震荡背景下，申赎的不确定性会直接影响仓位水平并影响投资业绩，本基金将按合约要求保持 90%权益资产配置、5%现金投资配置、20%的境内资产投资配置的合规约束，本报告期内实现了流动性的稳健管理。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实全球价值股票（QDII）人民币基金份额净值为 0.8518 元，本报告期基金份额净值增长率为-14.12%；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 0.8113 美元，本报告期基金份额净值增长率为-18.42%；业绩比较基准收益率为-17.51%。

#### 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，首先权益类资产是相对较好的配置方向，核心逻辑是本基金权重市场所在国美国的高通胀以及美联储的货币缩紧进程，在大类资产中明显的相对性的利好权益类资产。其次，对权益类资产，企业经营处于疫情复苏进程，各类企业的盈利增速较强，而美股股票的估值水平目前有所偏高，但尚未达到泡沫区域，在投资组合建立过程中会更加注重风格方向和结构配置，规避过高估值的区域，对全球资本市场而言，我们认为较好的安全边际将是首要条件，优选未被过高高估的优质股票，是本组合近期的目标。而从长期来看，我们考虑全球大概率从 80 年代开始的长达三四十年的低利率大周期，逐步转入另一个长达三四十年的利率逐步上抬的大周期，在这一过程中，价值风格将有更好的价值。

美国宏观经济层面，国内的通胀指标 PCE，在二季度中期连续三期保持稳定略降，市场对通胀的担忧已经退居第二位，排在首位的则是对美国经济是否会陷入衰退的担忧，即在“滞胀”之中，已经从担心“胀”进一步转移到“滞”，在进入三季度的数据显示通胀依然高位且有所抬头。实际上，当前美国非政府部门资产负债表状况相对较为健康，至少不会面临较大的债务危机风险，大概率不会出现类似 2008 年金融危机的深度衰退。因而在当前“经济增长放缓，但未进入衰退”的大背景下，当美联储政策完成既定目标之后，如通胀出现拐点、且联邦基金利率有效超过中性利率时，联储的货币政策同时也达到退坡甚至转向的话，那么市场则可以进入增长放缓且政策宽松的交易逻辑，在当前通胀和长远的利率抬升大周期内，权益类资产是较好的配置选择。就相对

比较而言，面临油气资源、矿产资源与农产品等短缺风险的欧洲，将比美国更需要担心衰退风险。

对资本市场内部结构，相对美股而言，A 股有更强烈的结构变化和更多的扰动来源。既有成长空间确定性高的新能源新材料领域，也有疫情管控见效后的经济活动复苏领域，还有提振经济促进就业的各项基建和消费支持方向即相应的被拉动产业链，A 股更为复杂的定价逻辑和博弈过程为市场带来更多的非有效性。

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。如大工业制造领域内的德国汽车、德国法国的电气化与半导体，以及环保制造业、工业配套服务，日本的精细工业如光学等。在消费领域，作为全球奢侈品领导者，法国多个顶级奢侈品集团的盈利能力在疫情期间继续高歌猛进。金融板块内，银行有较好的估值投资机会，金融服务与咨询是国内尚未发展成熟的行业。本报告期内，已在包括以德法为主的欧洲部分，以及欧洲外的英国、加拿大、澳大利亚、瑞士、日本等国建立部分头寸。

对新兴市场部分，本组合将在进一步确定全球疫情控制进展、产业链恢复、资源商品价格趋势以及美联储收紧货币对新兴市场国家的影响后再完成全部新兴市场头寸建立，本报告期内主要对港股进行布局。在 H 股内，本组合贯彻“价值机会”的两层逻辑，对在 A-H 两地上市的部分优选企业而言，H 股的估值更具吸引力，契合价值投资理念，对在 H 股有而 A 股没有的部分优选互联网和消费股标的，符合投资机会覆盖的理念。H 股之内中资企业有相对较好的安全边际和上行空间。

后续，我们将根据合同要求，完成组合建仓，之后保持高仓位水平，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。

#### 4.7 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“6.4.11 利润分配情况”。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—嘉实基金管理有限公司 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，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中期报告中的财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款	6.4.7.1	5,401,318.70	73,730,899.83
结算备付金		381,343.96	57,938,421.71
存出保证金		532,599.70	384,775.71
交易性金融资产	6.4.7.2	170,701,166.04	106,146,325.66
其中：股票投资		160,611,032.23	101,785,594.19
基金投资		1,458,587.43	2,860,431.47
债券投资		8,631,546.38	1,500,300.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		528,551.91	12,472.39
应收申购款		64,652.46	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	54,345.64
资产总计		177,609,632.77	238,267,240.94
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年6月30日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1.00	0.66
应付赎回款		560,259.54	-
应付管理人报酬		270,291.81	363,585.20
应付托管费		52,556.72	70,697.12
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	102,284.11	35,490.53
负债合计		985,393.18	469,773.51
<b>净资产：</b>			



实收基金	6.4.7.10	207,360,227.59	239,756,122.79
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-30,735,988.00	-1,958,655.36
净资产合计		176,624,239.59	237,797,467.43
负债和净资产总计		177,609,632.77	238,267,240.94

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，嘉实全球价值股票（QDII）人民币基金份额净值 0.8518 元，基金份额总额 205,582,805.34 份，嘉实全球价值股票（QDII）美元现汇基金份额净值 0.8113 美元，基金份额总额 278,038.96 份，基金份额总额合计为 205,860,844.30 份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-29,614,179.52
1. 利息收入		122,528.77
其中：存款利息收入	6.4.7.13	122,528.77
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-8,876,080.73
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-10,090,716.94
基金投资收益	6.4.7.15	-538,194.16
债券投资收益	6.4.7.16	26,821.15
资产支持证券投资收益	6.4.7.17	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-126,946.94
股利收益	6.4.7.20	1,852,956.16
以摊余成本计量的金融资产 终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号 填列）	6.4.7.21	-20,574,411.47
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-361,883.45
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	75,667.36
<b>减：二、营业总支出</b>		2,267,436.24
1. 管理人报酬		1,815,430.82
2. 托管费		353,000.48

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	6.4.7.23	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.24	99,004.94
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-31,881,615.76
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-31,881,615.76
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		-31,881,615.76

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	239,756,122.79	-	-1,958,655.36	237,797,467.43
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	239,756,122.79	-	-1,958,655.36	237,797,467.43
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-32,395,895.20	-	-28,777,332.64	-61,173,227.84
(一)、综合收	-	-	-31,881,615.76	-31,881,615.76

益总额				
(二)、 本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-32,395,895.20	-	3,104,283.12	-29,291,612.08
其中:1. 基金申购款	3,168,066.55	-	-348,058.07	2,820,008.48
2 .基金赎回款	-35,563,961.75	-	3,452,341.19	-32,111,620.56
(三)、 本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、 其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	207,360,227.59	-	-30,735,988.00	176,624,239.59

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

经雷

梁凯

李袁

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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。

### 6.4.2 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3号《半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。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2022年6月30日的财务状况以及自2022年1月1日起至2022年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 6.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间系自2022年1月1日起至2022年6月30日止。

#### 6.4.4.2 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。

### 6.4.4.3 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、其他金融负债。

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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；

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。对于其他金融负债，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。

#### 6.4.4.5 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。

#### 6.4.4.6 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。

#### 6.4.4.7 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。

#### 6.4.4.8 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）”。

#### 6.4.4.9 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。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费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。

#### 6.4.4.11 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。

#### 6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

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。

#### 6.4.4.13 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。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统

称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期初未分配利润。

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

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

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

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

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

以摊余成本计量的金融资产：

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

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

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 54,345.64 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 2,005.37 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 17,887.53 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 34,452.74 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至

应收申购款的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 0.00 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

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

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

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

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	5,401,318.70
等于：本金	5,401,089.30
加：应计利息	229.40
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	5,401,318.70

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	182,001,520.78	-	160,611,032.23	-21,390,488.55	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	8,515,300.00	118,796.38	8,631,546.38	-2,550.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	8,515,300.00	118,796.38	8,631,546.38	-2,550.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	1,620,767.76	-	1,458,587.43	-162,180.33	
其他	-	-	-	-	
合计	192,137,588.54	118,796.38	170,701,166.04	-21,555,218.88	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	3,793,460.00	-	-	
其中：股指期货投资	3,793,460.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	3,793,460.00	-	-	

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2207	IC2207	2.00	2,573,840.00	98,280.00
IF2207	IF2207	1.00	1,341,960.00	24,060.00
合计				122,340.00
减：可抵销期货暂收款				122,340.00

净额					0.00
----	--	--	--	--	------

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

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

#### 6.4.7.8 其他资产

无。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,021.71
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	11,002.25
其中：交易所市场	11,002.25
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,260.15
合计	102,284.11

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实全球价值股票 (QDII) 人民币

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	237,958,337.73	237,958,337.73
本期申购	3,046,223.15	3,046,223.15
本期赎回 (以“-”号填列)	-35,421,755.54	-35,421,755.54
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	205,582,805.34	205,582,805.34

嘉实全球价值股票 (QDII) 美元现汇

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	281,215.89	1,797,785.06
本期申购	19,034.27	121,843.40
本期赎回 (以“-”号填列)	-22,211.20	-142,206.21
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	278,038.96	1,777,422.25

注：(1) 申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

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

## 6.4.7.11 其他综合收益

无。

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 嘉实全球价值股票（QDII）人民币

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-1,091,938.32	-852,030.33	-1,943,968.65
本期利润	-11,215,782.63	-20,412,436.11	-31,628,218.74
本期基金份额交易产生的变动数	956,536.63	2,143,119.80	3,099,656.43
其中：基金申购款	-134,607.54	-200,968.05	-335,575.59
基金赎回款	1,091,144.17	2,344,087.85	3,435,232.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-11,351,184.32	-19,121,346.64	-30,472,530.96

## 嘉实全球价值股票（QDII）美元现汇

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-8,249.63	-6,437.08	-14,686.71
本期利润	-91,421.66	-161,975.36	-253,397.02
本期基金份额交易产生的变动数	1,531.99	3,094.70	4,626.69
其中：基金申购款	-4,412.02	-8,070.46	-12,482.48
基金赎回款	5,944.01	11,165.16	17,109.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-98,139.30	-165,317.74	-263,457.04

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	27,934.23
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	94,498.93
其他	95.61
合计	122,528.77

## 6.4.7.14 股票投资收益

## 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-10,090,716.94
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	-10,090,716.94

#### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	65,968,449.17
减：卖出股票成本总额	75,857,501.45
减：交易费用	201,664.66
买卖股票差价收入	-10,090,716.94

#### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	2,139,148.76
减：卖出/赎回基金成本总额	2,674,830.57
减：买卖基金差价收入应缴纳增值 税额	-
减：交易费用	2,512.35
基金投资收益	-538,194.16

#### 6.4.7.16 债券投资收益

##### 6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	29,515.36
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券 到期兑付）差价收入	-2,694.21
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	26,821.15

##### 6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
----	----------------------------

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	11,431,794.76
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	11,315,534.00
减：应计利息总额	118,926.56
减：交易费用	28.41
买卖债券差价收入	-2,694.21

#### 6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.17 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

##### 6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.18 贵金属投资收益

##### 6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

##### 6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.19 衍生工具收益

##### 6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-126,946.94

## 6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,825,042.19
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	27,913.97
合计	1,852,956.16

## 6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-20,692,951.47
股票投资	-20,519,516.94
债券投资	-2,250.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-171,184.53
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	118,540.00
权证投资	-
期货投资	118,540.00
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	-20,574,411.47

## 6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	75,666.79
其他	0.57
合计	75,667.36

## 6.4.7.23 信用减值损失

无。

## 6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	3,296.10
债券托管账户维护费	4,500.00
其他	1,761.86
证券组合费	186.83
合计	99,004.94

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 6.4.8.1 或有事项

无。

## 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

## 6.4.9 关联方关系

## 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

## 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
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

## 6.4.10 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。

## 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 6.4.10.1.1 股票交易

无。

## 6.4.10.1.2 债券交易

无。

## 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

**6.4.10.1.4 基金交易**

无。

**6.4.10.1.5 权证交易**

无。

**6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金**

无。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,815,430.82
其中：支付销售机构的客户维护费	755,906.67

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。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	353,000.48

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。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

无。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

无。

**6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

无。

#### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司_活期	3,386,278.34	27,934.23
摩根大通银行_活期	2,015,040.36	-

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本期(2022年1月1日至2022年6月30日),本基金未实施利润分配。

#### 6.4.12 期末(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，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。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 6.4.13.3 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。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《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 6.4.12 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 6.4.12.3 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。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,401,318.70	-	-	-	5,401,318.70
结算备付金	381,343.96	-	-	-	381,343.96
存出保证金	532,599.70	-	-	-	532,599.70
交易性金融资产	8,631,546.38	-	-	-162,069,619.66	170,701,166.04
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	-	-	-	528,551.91	528,551.91
应收申购款	-	-	-	64,652.46	64,652.46
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	14,946,808.74	-	-	-162,662,824.03	177,609,632.77
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	-	-	-	1.00	1.00
应付赎回款	-	-	-	560,259.54	560,259.54
应付管理人报酬	-	-	-	270,291.81	270,291.81
应付托管费	-	-	-	52,556.72	52,556.72
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	102,284.11	102,284.11
负债总计	-	-	-	985,393.18	985,393.18
利率敏感度缺口	14,946,808.74	-	-	-161,677,430.85	176,624,239.59
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	73,730,899.83	-	-	-	73,730,899.83
结算备付金	57,938,421.71	-	-	-	57,938,421.71
存出保证金	384,775.71	-	-	-	384,775.71
交易性金融资产	1,500,300.00	-	-	-104,646,025.66	106,146,325.66
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	54,345.64	54,345.64
应收股利	-	-	-	12,472.39	12,472.39
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	133,554,397.25	-	-	-104,712,843.69	238,267,240.94
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	0.66	0.66
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	363,585.20	363,585.20
应付托管费	-	-	-	70,697.12	70,697.12
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	19,463.13	19,463.13
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-

递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	16,027.40
负债总计	-	-	-	469,773.51
利率敏感度缺口	133,554,397.25	-	-	-104,243,070.18

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 (2022 年 6 月 30 日)	上年度末 (2021 年 12 月 31 日)
分析	市场利率上升 25 个基点	-7,886.68	-215.64
	市场利率下降 25 个基点	7,901.83	215.70

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有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。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	4,642,161.69	-	0.56	4,642,162.25
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	88,867,14	14,398,215.22	27,364,799.98	130,630,158.28

	3.08			
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	130,161.06	229,400.07	62,347.84	421,908.97
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其它资产	-	-	-	-
资产合计	93,639,465.83	14,627,615.29	27,427,148.38	135,694,229.50
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	93,639,465.83	14,627,615.29	27,427,148.38	135,694,229.50
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	63,443,99	-	-	63,443,991.95

	1.95			
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	71,048,708.84	3,727,193.11	6,052,648.71	80,828,550.66
衍生金融资产	-	-	-	-
应收股利	4,301.95	6,279.17	1,891.27	12,472.39
应收利息	42.08	-	-	42.08
应收申购款	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
其它资产	-	-	-	-
资产合计	134,497,044.82	3,733,472.28	6,054,539.98	144,285,057.08
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
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	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	134,497,044.82	3,733,472.28	6,054,539.98	144,285,057.08

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的	

	动	影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	所有外币相对人民币升值 5%	6,784,711.48	7,214,252.85
	所有外币相对人民币贬值 5%	-6,784,711.48	-7,214,252.85

#### 6.4.13.4.3 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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	160,611,032.23	90.93	101,785,594.19	42.80
交易性金融资产—基金投资	1,458,587.43	0.83	2,860,431.47	1.20
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	162,069,619.66	91.76	104,646,025.66	44.01

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准以外的其他市场变量保持不变	
	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准上升 5%	8,580,256.52	3,243,652.10
	业绩比较基准下降 5%	-8,580,256.52	-3,243,652.10

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	162,069,619.66	104,646,025.66
第二层次	8,631,546.38	1,500,300.00
第三层次	-	-
合计	170,701,166.04	106,146,325.66

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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）和非公开发行等情况，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。本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

**6.4.14.3 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。

**6.4.14.4 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。

**6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

本报告中资产负债表的上期比较数据，已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的格式要求进行列示调整。其中：

原“应收利息”、“其他资产”项目，合并列示在“其他资产”项目；

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

**§ 7 投资组合报告****7.1 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	160,611,032.23	90.43
	其中：普通股	156,898,590.07	88.34
	存托凭证	3,301,381.29	1.86
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	411,060.87	0.23
2	基金投资	1,458,587.43	0.82
3	固定收益投资	8,631,546.38	4.86
	其中：债券	8,631,546.38	4.86
	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	5,782,662.66	3.26
8	其他各项资产	1,125,804.07	0.63
9	合计	177,609,632.77	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 4,591,604.05 元，占基金资产净值的比例为 2.60%。



## 7.2 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	87,736,694.59	49.67
中国	31,439,461.38	17.80
中国香港	14,398,215.22	8.15
加拿大	9,482,972.25	5.37
英国	4,063,844.50	2.30
日本	3,589,010.88	2.03
澳大利亚	2,834,054.99	1.60
法国	1,701,930.64	0.96
德国	1,276,690.04	0.72
瑞士	1,144,515.60	0.65
荷兰	993,010.18	0.56
意大利	805,605.28	0.46
新加坡	492,557.52	0.28
瑞典	442,729.82	0.25
奥地利	174,680.52	0.10
比利时	35,058.82	0.02
合计	160,611,032.23	90.93

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
金融	24,335,319.28	13.78
房地产	885,735.32	0.50
信息技术	37,044,978.74	20.97
原材料	17,083,262.29	9.67
必需消费品	14,871,245.65	8.42
非必需消费品	10,929,932.71	6.19
工业	16,053,942.00	9.09
能源	16,300,963.54	9.23
医疗保健	12,309,412.74	6.97
公用事业	3,497,549.21	1.98
通信服务	6,887,629.88	3.90
房地产信托特殊类	235,117.19	0.13
房地产信托工业类	33,245.36	0.02
房地产信托零售类	142,698.32	0.08
合计	160,611,032.23	90.93

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

## 7.4 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	公司名称	公司名	证券代	所在证	所属	数量	公允价值	占基
---	------	-----	-----	-----	----	----	------	----

号	(英文)	称(中文)	码	券市场	国家(地区)	(股)		金资产净值比例(%)
1	Apple Inc	苹果公司	AAPL UW	纳斯达克证券交易所	美国	10,177	9,338,238.20	5.29
2	Microsoft Corp	微软	MSFT UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,995	6,886,137.00	3.90
3	Berkshire Hathaway Inc	伯克希尔哈撒韦公司	BRK/B UN	纽约证券交易所	美国	2,853	5,227,684.36	2.96
4	Teck Resources Ltd	加拿大泰克资源有限公司	TECK UN	纽约证券交易所	美国	17,337	3,556,988.91	2.01
5	Alphabet Inc	Alphabet 公司	GOOGL UW	纳斯达克证券交易所	美国	217	3,173,817.17	1.80
6	NVIDIA Corp	英伟达	NVDA UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,713	2,760,154.99	1.56
7	Costco Wholesale Corp	开市客	COST UW	纳斯达克证券交易所	美国	757	2,434,996.32	1.38
8	Tesla Inc	特斯拉公司	TSLA UW	纳斯达克证券交易所	美国	509	2,300,471.81	1.30
9	Raytheon Technologies Corp	雷神技术公司	RTX UN	纽约证券交易所	美国	3,493	2,253,099.06	1.28
10	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	6,215	2,237,929.43	1.27
11	China Shenhua Energy Co Ltd	中国神华	601088 SH	上海证券交易所	中国	31,400	1,045,620.00	0.59
11	China Shenhua Energy Co Ltd	中国神华	1088 HK	香港证券交易所	中国香港	33,500	644,599.46	0.36

12	Steel Dynamics Inc	Steel Dynamics 股份有限公司	STLD UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,488	1,548,529.38	0.88
13	Dollarama Inc	Dollarama 股份有限公司	DOL CT	加拿大证券交易所	加拿大	3,788	1,461,614.56	0.83
14	General Dynamics Corp	通用动力	GD UN	纽约证券交易所	美国	912	1,354,226.29	0.77
15	LONGi Green Energy Technology Co Ltd	隆基绿能科技股份有限公司	601012 SH	上海证券交易所	中国	20,020	1,333,932.60	0.76
16	Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co Ltd	山西汾酒	600809 SH	上海证券交易所	中国	4,000	1,299,200.00	0.74
17	Zijin Mining Group Co Ltd	紫金矿业	601899 SH	上海证券交易所	中国	105,500	984,315.00	0.56
17	Zijin Mining Group Co Ltd	紫金矿业	2899 HK	香港证券交易所	中国香港	38,000	312,298.28	0.18
18	Amazon.com Inc	亚马逊公司	AMZN UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,740	1,240,302.96	0.70
19	Kweichow Moutai Co Ltd	贵州茅台	600519 SH	上海证券交易所	中国	600	1,227,000.00	0.69
20	Exxon Mobil Corp	埃克森美孚石油	XOM UN	纽约证券交易所	美国	2,111	1,213,327.43	0.69
21	Activision Blizzard Inc	动视暴雪股份有限公司	ATVI UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,246	1,173,646.41	0.66
22	Coca-Cola	可口可乐	KO UN	纽约证	美国	2,722	1,149,266.98	0.65

	Co/The	乐		券交易 所				
23	Broadcom Inc	博通股 份有限 公司	AVGO UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	332	1,082,474.46	0.61
24	Contempor ary Amperex Technolog y Co Ltd	宁德时代	300750 SZ	深圳证 券交易 所	中国	2,000	1,068,000.00	0.60
25	Advanced Micro Devices Inc	AMD 公 司	AMD UR	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,068	1,061,340.53	0.60
26	McKesson Corp	McKess on 公 司	MCK UN	纽约证 券交易 所	美国	480	1,050,876.38	0.59
27	Cheniere Energy Inc	Chenie re 能 源公司	LNG UA	纽约证 券交易 所	美国	1,135	1,013,347.91	0.57
28	BYD Co Ltd	比亚迪	002594 SZ	深圳证 券交易 所	中国	3,000	1,000,470.00	0.57
29	Cameco Corp	Cameco 公司	CCO CT	加拿大 证券交 易所	加拿 大	6,944	978,193.97	0.55
30	Computers hare Ltd	Comput ershar e 有限 公司	CPU AT	澳大利 亚证券 交易所	澳大 利亚	8,562	973,510.36	0.55
31	Bank of Montreal	蒙特利 尔银行	BMO CT	加拿大 证券交 易所	加拿 大	1,488	958,828.40	0.54
32	COSCO SH IPPING H oldings Co Ltd	中远海 控	1919 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	56,500	529,567.85	0.30
32	COSCO SH IPPING H oldings Co Ltd	中远海 控	601919 SH	上海证 券交易 所	中国	30,000	417,000.00	0.24
33	QUALCOMM Inc	高通公 司	QCOM UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,092	936,187.15	0.53

34	ConocoPhillips	康菲石油	COP UN	纽约证券交易所	美国	1,380	831,796.15	0.47
35	WuXi AppTec Co Ltd	药明康德	603259 SH	上海证券交易所	中国	5,800	603,142.00	0.34
35	WuXi AppTec Co Ltd	药明康德	2359 HK	香港证券交易所	中国香港	2,300	205,544.92	0.12
36	Anhui Jinhe Industrial Co Ltd	金禾实业	002597 SZ	深圳证券交易所	中国	18,200	788,606.00	0.45
37	Wuliangye Yibin Co Ltd	五粮液	000858 SZ	深圳证券交易所	中国	3,900	787,527.00	0.45
38	HSBC Holdings PLC	汇丰控股	HSBA LN	伦敦证券交易所	英国	12,414	540,990.84	0.31
38	HSBC Holdings PLC	汇丰控股	5 HK	香港证券交易所	中国香港	4,800	212,018.70	0.12
39	UnitedHealth Group Inc	联合健康集团	UNH UN	纽约证券交易所	美国	216	744,590.10	0.42
40	PetroChina Co Ltd	中国石油	857 HK	香港证券交易所	中国香港	226,000	722,840.80	0.41
41	Postal Savings Bank of China Co Ltd	邮储银行	1658 HK	香港证券交易所	中国香港	134,000	713,929.72	0.40
42	China Railway Group Ltd	中国中铁	390 HK	香港证券交易所	中国香港	142,000	588,969.35	0.33
42	China Railway Group Ltd	中国中铁	601390 SH	上海证券交易所	中国	16,700	102,538.00	0.06
43	AbbVie Inc	艾伯维公司	ABBV UN	纽约证券交易所	美国	669	687,677.16	0.39
44	Ameriprise	阿默普莱斯金	AMP UN	纽约证券交易所	美国	427	681,135.69	0.39

	Financial Inc	融公司		所				
45	Bristol-Myers Squibb Co	百时美施贵宝公司	BYM UN	纽约证券交易所	美国	1,304	673,878.25	0.38
46	COFCO Joycome Foods Ltd	中粮家佳康	1610 HK	香港证券交易所	中国香港	203,000	659,693.57	0.37
47	Intact Financial Corp	Intact 金融公司	IFC CT	加拿大证券交易所	加拿大	676	638,931.57	0.36
48	Royal Bank of Canada	加拿大皇家银行	RY CT	加拿大证券交易所	加拿大	975	632,629.64	0.36
49	China Communications Construction Co Ltd	中国交建	1800 HK	香港证券交易所	中国香港	151,000	521,700.11	0.30
49	China Communications Construction Co Ltd	中国交建	601800 SH	上海证券交易所	中国	10,600	98,368.00	0.06
50	Mastercard Inc	万事达股份有限公司	MA UN	纽约证券交易所	美国	286	605,551.37	0.34
51	Zhejiang Jiuzhou Pharmaceutical Co Ltd	九洲药业	603456 SH	上海证券交易所	中国	11,400	589,380.00	0.33
52	Yankuang Energy Group Co Ltd	兖矿能源	1171 HK	香港证券交易所	中国香港	28,000	589,054.87	0.33
53	TELUS Corp	泰勒斯电信公司	T CT	加拿大证券交易所	加拿大	3,924	585,658.12	0.33
54	Pfizer Inc	辉瑞制药	PFE UN	纽约证券交易所	美国	1,663	585,174.28	0.33

55	Bank of Jiangsu Co Ltd	江苏银行	600919 SH	上海证券交易所	中国	80,200	571,024.00	0.32
56	ASML Holding NV	阿斯麦控股公司	ASML UW	纳斯达克证券交易所	美国	178	568,500.14	0.32
57	GEM Co Ltd	格林美	002340 SZ	深圳证券交易所	中国	62,000	564,200.00	0.32
58	Shell PLC	壳牌公共有限公司	SHEL LN	伦敦证券交易所	英国	3,246	563,612.43	0.32
59	China Qinfa Group Ltd	中国秦发	866 HK	香港证券交易所	中国香港	1,320,000	558,781.15	0.32
60	Procter & Gamble Co/The	宝洁	PG UN	纽约证券交易所	美国	576	555,858.55	0.31
61	BP PLC	BP 公司	BP UN	纽约证券交易所	美国	1,779	338,487.11	0.19
61	BP PLC	BP 公司	BP/ LN	伦敦证券交易所	英国	6,295	198,884.46	0.11
62	Ganfeng Lithium Co Ltd	赣锋锂业	1772 HK	香港证券交易所	中国香港	3,640	268,798.19	0.15
62	Ganfeng Lithium Co Ltd	赣锋锂业	002460 SZ	深圳证券交易所	中国	1,800	267,660.00	0.15
63	CVS Health Corp	CVS 保健公司	CVS UN	纽约证券交易所	美国	860	534,815.36	0.30
64	AstraZeneca PLC	阿斯利康公共有限公司	AZN UW	纳斯达克证券交易所	美国	728	322,811.36	0.18
64	AstraZeneca PLC	阿斯利康公共有限公司	AZN LN	伦敦证券交易所	英国	227	199,474.43	0.11
65	Bank of America Corp	美国银行公司	BAC UN	纽约证券交易所	美国	2,488	519,807.59	0.29

66	AIA Group Ltd	友邦保险	1299 HK	香港证券交易所	中国香港	7,000	509,137.37	0.29
67	Eni SpA	埃尼集团	ENI IM	意大利证券交易所	意大利	4,232	335,983.40	0.19
67	Eni SpA	埃尼集团	E UN	纽约证券交易所	美国	1,072	171,303.92	0.10
68	Chevron Corp	雪佛龙	CVX UN	纽约证券交易所	美国	516	501,385.07	0.28
69	China Construction Bank Corp	建设银行	939 HK	香港证券交易所	中国香港	111,000	500,260.49	0.28
70	Zhangzhou Pientze huang Pharmaceutical Co Ltd	片仔癀	600436 SH	上海证券交易所	中国	1,400	499,422.00	0.28
71	Mitsubishi Corp	三菱商事	8058 JT	日本证券交易所	日本	2,500	495,905.08	0.28
72	Newland Digital Technology Co Ltd	新大陆	000997 SZ	深圳证券交易所	中国	36,700	484,807.00	0.27
73	CK Hutchison Holdings Ltd	长和	1 HK	香港证券交易所	中国香港	10,500	476,362.21	0.27
74	Baoji Titanium Industry Co Ltd	宝钛股份	600456 SH	上海证券交易所	中国	7,700	457,380.00	0.26
75	TotalEnergies SE	道达尔集团	TTE UN	纽约证券交易所	美国	898	317,252.71	0.18
75	TotalEnergies SE	道达尔集团	TTE FP	巴黎证券交易所	法国	360	127,084.72	0.07
76	Unigroup	紫光国	002049	深圳证	中国	2,300	436,356.00	0.25



	Guoxin Microelectronics Co Ltd	微	SZ	券交易所				
77	Bunge Ltd	邦吉有限公司	BG UN	纽约证券交易所	美国	716	435,798.32	0.25
78	Visa Inc	维萨公司	V UN	纽约证券交易所	美国	324	428,136.04	0.24
79	Olin Corp	奥林公司	OLN UN	纽约证券交易所	美国	1,349	419,004.25	0.24
80	Archer-Daniels-Midland Co	Archer-Daniels-Midland 公司	ADM UN	纽约证券交易所	美国	804	418,726.93	0.24
81	Gigadevice Semiconductor Beijing Inc	兆易创新	603986 SH	上海证券交易所	中国	2,900	412,409.00	0.23
82	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	中国平安	2318 HK	香港证券交易所	中国香港	8,000	364,995.09	0.21
82	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	中国平安	601318 SH	上海证券交易所	中国	1,000	46,690.00	0.03
83	Freeport-McMoRan Inc	自由港迈克墨伦股份有限公司	FCX UN	纽约证券交易所	美国	2,092	410,817.68	0.23
84	GrainCorp Ltd	GrainCorp 有限公司	GNC AT	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	9,214	404,346.21	0.23
85	Jiangsu	洋河股	002304	深圳证	中国	2,200	402,930.00	0.23

	Yanghe Brewery Joint-Stock Co Ltd	份	SZ	券交易所				
86	Luzhou Laojiao Co Ltd	泸州老窖	000568 SZ	深圳证券交易所	中国	1,600	394,464.00	0.22
87	Unisplendour Corp Ltd	紫光股份	000938 SZ	深圳证券交易所	中国	20,200	391,880.00	0.22
88	GSK PLC	葛兰素史克公共有限公司	GSK LN	伦敦证券交易所	英国	1,691	242,925.78	0.14
88	GSK PLC	葛兰素史克公共有限公司	GSK UN	纽约证券交易所	美国	507	148,118.65	0.08
89	UBS Group AG	瑞银集团	UBSG SE	瑞士证券交易所	瑞士	3,578	387,104.40	0.22
90	Toyota Motor Corp	丰田汽车	7203 JT	日本证券交易所	日本	3,700	381,786.72	0.22
91	East Money Information Co Ltd	东方财富	300059 SZ	深圳证券交易所	中国	14,920	378,968.00	0.21
92	Tongwei Co Ltd	通威股份	600438 SH	上海证券交易所	中国	6,300	377,118.00	0.21
93	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	495	375,770.04	0.21
94	Jazz Pharmaceuticals PLC	爵士制药公司	JAZZ UW	纳斯达克证券交易所	美国	358	374,842.29	0.21
95	KLA Corp	KLA 公司	KLAC UW	纳斯达克证券交易所	美国	172	368,333.44	0.21
96	HP Inc	惠普	HPQ UN	纽约证券交易所	美国	1,673	368,059.48	0.21

				所				
97	Man Group PLC/Jersey	Man Group PLC/Jersey	EMG LN	伦敦证券交易所	英国	17,838	362,556.91	0.21
98	Glencore PLC	嘉能可	GLEN LN	伦敦证券交易所	英国	9,947	360,236.21	0.20
99	FirstEnergy Corp	第一能源	FE UN	纽约证券交易所	美国	1,390	358,134.40	0.20
100	New China Life Insurance Co Ltd	新华保险	1336 HK	香港证券交易所	中国香港	17,500	329,996.44	0.19
100	New China Life Insurance Co Ltd	新华保险	601336 SH	上海证券交易所	中国	700	22,533.00	0.01
101	Marvell Technology Inc	美满电子科技公司	MRVL UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,206	352,329.57	0.20
102	China Resources Cement Holdings Ltd	华润水泥控股	1313 HK	香港证券交易所	中国香港	78,000	351,534.40	0.20
103	Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd	晶盛机电	300316 SZ	深圳证券交易所	中国	5,200	351,468.00	0.20
104	AVIC Xi'an Aircraft Industry Group Co Ltd	中航西飞	000768 SZ	深圳证券交易所	中国	11,300	342,277.00	0.19
105	Southern Copper Corp	南方铜业公司	SCCO UN	纽约证券交易所	美国	1,020	340,980.73	0.19

106	Wells Fargo & Co	富国银行	WFC UN	纽约证券交易所	美国	1,231	323,612.10	0.18
107	Nexstar Media Group Inc	Nexstar 媒体集团股份有限公司	NXST UW	纳斯达克证券交易所	美国	294	321,386.93	0.18
108	Chow Tai Seng Jewellery Co Ltd	周大生	002867 SZ	深圳证券交易所	中国	20,600	319,918.00	0.18
109	YTO Express Group Co Ltd	圆通速递	600233 SH	上海证券交易所	中国	15,600	318,084.00	0.18
110	CITIC Securities Co Ltd	中信证券	6030 HK	香港证券交易所	中国香港	13,500	202,500.44	0.11
110	CITIC Securities Co Ltd	中信证券	600030 SH	上海证券交易所	中国	5,285	114,473.10	0.06
111	Nestle SA	雀巢	NESN SE	瑞士证券交易所	瑞士	402	314,931.65	0.18
112	Henan Lingrui Pharmaceutical Co	羚锐制药	600285 SH	上海证券交易所	中国	25,000	313,250.00	0.18
113	Marubeni Corp	丸红株式会社	8002 JT	日本证券交易所	日本	5,200	312,740.81	0.18
114	Anhui Honglu Steel Construction Group Co Ltd	鸿路钢构	002541 SZ	深圳证券交易所	中国	9,360	312,624.00	0.18
115	American International Group Inc	美国国际集团	AIG UN	纽约证券交易所	美国	903	309,867.96	0.18
116	Bank of Communications Co	交通银行	3328 HK	香港证券交易所	中国香港	51,000	236,391.62	0.13

	Ltd							
116	Bank of Communications Co Ltd	交通银行	601328 SH	上海证券交易所	中国	14,600	72,708.00	0.04
117	JD.com Inc	京东集团	9618 HK	香港证券交易所	中国香港	1,428	308,722.22	0.17
118	Nucor Corp	纽柯公司	NUE UN	纽约证券交易所	美国	437	306,222.19	0.17
119	Exelon Corp	Exelon 公司	EXC UN	纳斯达克证券交易所	美国	1,004	305,074.07	0.17
120	Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd	伊利股份	600887 SH	上海证券交易所	中国	7,800	303,810.00	0.17
121	American Express Co	美国运通	AXP UN	纽约证券交易所	美国	325	302,358.64	0.17
122	Bank of Nova Scotia/The	加拿大丰业银行	BNS CT	加拿大证券交易所	加拿大	742	294,260.76	0.17
123	Jiangxi Copper Co Ltd	江西铜业	358 HK	香港证券交易所	中国香港	32,000	293,911.70	0.17
124	Applied Materials Inc	应用材料	AMAT UW	纳斯达克证券交易所	美国	480	293,089.52	0.17
125	Chengxin Lithium Group Co Ltd	盛新锂能集团股份有限公司	002240 SZ	深圳证券交易所	中国	4,800	289,728.00	0.16
126	Nintendo Co Ltd	任天堂	7974 JT	日本证券交易所	日本	100	288,330.05	0.16
127	Hess Corp	赫斯公司	HES UN	纽约证券交易所	美国	404	287,246.31	0.16
128	Shanghai	璞泰来	603659	上海证	中国	3,400	286,960.00	0.16

8	Putailai New Energy Technology Co Ltd		SH	券交易所				
129	Huntsman Corp	亨斯迈公司	HUN UN	纽约证券交易所	美国	1,492	283,880.14	0.16
130	CNOOC Ltd	中国海洋石油	883 HK	香港证券交易所	中国香港	32,000	283,512.59	0.16
131	ZTE Corp	中兴通讯	000063 SZ	深圳证券交易所	中国	11,000	280,830.00	0.16
132	RWE AG	莱茵集团	RWE GY	德国证券交易所	德国	1,139	280,028.47	0.16
133	Juniper Networks Inc	瞻博网络股份有限公司	JNPR UN	纽约证券交易所	美国	1,449	277,157.33	0.16
134	NAURA Technology Group Co Ltd	北方华创	002371 SZ	深圳证券交易所	中国	1,000	277,120.00	0.16
135	Keysight Technologies Inc	是德科技公司	KEYS UN	纽约证券交易所	美国	298	275,699.61	0.16
136	Morgan Stanley	摩根士丹利	MS UN	纽约证券交易所	美国	540	275,653.31	0.16
137	Targa Resources Corp	Targa 资源公司	TRGP UN	纽约证券交易所	美国	686	274,721.90	0.16
138	China State Construction Engineering Corp Ltd	中国建筑	601668 SH	上海证券交易所	中国	51,400	273,448.00	0.15
139	Sony Group Corp	索尼集团公司	6758 JT	日本证券交易所	日本	500	272,581.96	0.15

140	AT&T Inc	美国电话电报公司	T UN	纽约证券交易所	美国	1,920	270,088.21	0.15
141	Huayu Automotive Systems Co Ltd	华域汽车	600741 SH	上海证券交易所	中国	11,700	269,100.00	0.15
142	Onto Innovation Inc	Onto 创新股份有限公司	ONTO UN	纽约证券交易所	美国	568	265,854.12	0.15
143	Jiangsu Zhongtian Technology Co Ltd	中天科技	600522 SH	上海证券交易所	中国	11,500	265,650.00	0.15
144	East West Bancorp Inc	华美银行集团公司	EWBC UW	纳斯达克证券交易所	美国	609	264,853.32	0.15
145	Mitsui & Co Ltd	三井物产	8031 JT	日本证券交易所	日本	1,800	264,847.95	0.15
146	Eve Energy Co Ltd	亿纬锂能	300014 SZ	深圳证券交易所	中国	2,700	263,250.00	0.15
147	ON Semiconductor Corp	安森美半导体公司	ON UW	纳斯达克证券交易所	美国	768	259,315.61	0.15
148	WH Group Ltd	万洲国际	288 HK	香港证券交易所	中国香港	50,000	259,122.57	0.15
149	Constellation Energy Corp	美国联合能源公司	CEG UW	纳斯达克证券交易所	美国	671	257,861.79	0.15
150	Zhejiang Shouxiangu Pharmaceutical Co Ltd	寿仙谷	603896 SH	上海证券交易所	中国	6,600	255,948.00	0.14
151	EOG Resources Inc	EOG 资源	EOG UN	纽约证券交易所	美国	345	255,716.42	0.14
15	Inner	电投能	002128	深圳证	中国	17,700	253,464.00	0.14

2	Mongolia Dian Tou Energy Corp Ltd	源	SZ	券交易所				
153	Deutsche Telekom AG	德国电信	DTE GY	德国证券交易所	德国	1,890	250,956.37	0.14
154	Anhui Gujing Distillery Co Ltd	古井贡酒	000596 SZ	深圳证券交易所	中国	1,000	249,660.00	0.14
155	Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai	格力电器	000651 SZ	深圳证券交易所	中国	7,400	249,528.00	0.14
156	AXA SA	安盛集团	CS FP	巴黎证券交易所	法国	1,616	245,311.94	0.14
157	Hebei Hengshui Laobaigan Liquor Co Ltd	老白干酒	600559 SH	上海证券交易所	中国	8,400	240,996.00	0.14
158	Loblaw Cos Ltd	Loblaw 有限公司	L CT	加拿大证券交易所	加拿大	398	240,527.85	0.14
159	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	93	239,702.48	0.14
160	Montage Technology Co Ltd	澜起科技	688008 SH	上海证券交易所	中国	3,900	236,262.00	0.13
161	Satellite Chemical Co Ltd	卫星化学股份有限公司	002648 SZ	深圳证券交易所	中国	9,095	235,105.75	0.13
162	ASM International NV	ASM 国际有限公司	ASM NA	阿姆斯特丹交易所	荷兰	140	234,108.59	0.13
163	Shanghai Fosun Pharmaceutical Gr	复星医药	600196 SH	上海证券交易所	中国	5,300	233,677.00	0.13



	oup Co Ltd							
164	Blackstone Inc	黑石集团股份有限公司	BX UN	纽约证券交易所	美国	377	230,829.95	0.13
165	YongXing Special Materials Technology Co Ltd	永兴材料	002756 SZ	深圳证券交易所	中国	1,500	228,315.00	0.13
166	SITC International Holdings Co Ltd	海丰国际	1308 HK	香港证券交易所	中国香港	12,000	227,822.62	0.13
167	Beijing Tongrentang Co Ltd	同仁堂	600085 SH	上海证券交易所	中国	4,300	227,384.00	0.13
168	Will Semiconductor Co Ltd Shanghai	韦尔股份	603501 SH	上海证券交易所	中国	1,300	224,939.00	0.13
169	Toronto-Dominion Bank/The	多伦多道明银行	TD CT	加拿大证券交易所	加拿大	261	114,689.03	0.06
169	Toronto-Dominion Bank/The	多伦多道明银行	TD UN	纽约证券交易所	美国	249	109,593.27	0.06
170	Pembina Pipeline Corp	彭比纳管道公司	PPL CT	加拿大证券交易所	加拿大	944	223,599.52	0.13
171	National Australia Bank Ltd	澳大利亚国民银行有限公司	NAB AT	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	1,764	222,954.00	0.13
172	China Overseas Land & Investment Ltd	中国海外发展	688 HK	香港证券交易所	中国香港	10,500	222,691.48	0.13
173	Chongqing Zhifei	智飞生物	300122 SZ	深圳证券交易所	中国	2,000	222,020.00	0.13

	Biological Products Co Ltd			所				
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	2,954	221,830.65	0.13
175	Anhui Yingjia Distillery Co Ltd	迎驾贡酒	603198 SH	上海证券交易所	中国	3,400	221,476.00	0.13
176	Telstra Corp Ltd	澳大利亚电信股份有限公司	TLS AT	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	12,423	220,704.84	0.12
177	Lam Research Corp	泛林集团	LRCX UW	纳斯达克证券交易所	美国	77	220,224.86	0.12
178	Linde PLC	林德公共有限公司	LIN UN	纽约证券交易所	美国	113	218,059.36	0.12
179	Johnson & Johnson	强生	JNJ UN	纽约证券交易所	美国	183	218,015.33	0.12
180	Tokyo Electron Ltd	东京电子	8035 JT	日本证券交易所	日本	100	217,672.48	0.12
181	Valiant Co Ltd	万润股份	002643 SZ	深圳证券交易所	中国	10,400	216,944.00	0.12
182	Zhejiang HangKe Technology Inc Co	杭可科技	688006 SH	上海证券交易所	中国	3,087	216,275.22	0.12
183	Adobe Inc	奥多比	ADBE UW	纳斯达克证券交易所	美国	88	216,196.21	0.12
184	Haohua Chemical Science & Technology Co Ltd	昊华科技	600378 SH	上海证券交易所	中国	5,600	215,712.00	0.12

185	AltaGas Ltd	阿尔塔燃气有限公司	ALA CT	加拿大证券交易所	加拿大	1,524	215,477.64	0.12
186	NatWest Group PLC	国民西敏寺银行集团公共有限公司	NWG LN	伦敦证券交易所	英国	12,128	215,417.25	0.12
187	Mercedes-Benz Group AG	梅赛德斯-奔驰集团	MBG GY	德国证券交易所	德国	556	215,174.14	0.12
188	Jiangsu Yangnong Chemical Co Ltd	扬农化工	600486 SH	上海证券交易所	中国	1,600	213,248.00	0.12
189	China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd	永达汽车	3669 HK	香港证券交易所	中国香港	33,500	212,574.58	0.12
190	ABB Ltd	ABB 有限公司	ABBN SE	瑞士证券交易所	瑞士	686	122,781.14	0.07
190	ABB Ltd	ABB 有限公司	ABB UN	纽约证券交易所	美国	500	89,697.86	0.05
191	Booking Holdings Inc	Booking 控股股份有限公司	BKNG UW	纳斯达克证券交易所	美国	18	211,287.09	0.12
192	National Grid PLC	英国国家电网	NG/ LN	伦敦证券交易所	英国	2,468	211,250.88	0.12
193	China Jushi Co Ltd	中国巨石	600176 SH	上海证券交易所	中国	12,100	210,661.00	0.12
194	Kraft Heinz Co/The	卡夫亨氏公司	KHC UW	纳斯达克证券交易所	美国	820	209,897.69	0.12
195	China Taiping Insurance Holdings Co Ltd	中国太平	966 HK	香港证券交易所	中国香港	25,000	206,955.98	0.12

196	Sanan Optoelectronics Co Ltd	三安光电	600703 SH	上海证券交易所	中国	8,400	206,472.00	0.12
197	Raymond James Financial Inc	Raymond James 金融股份有限公司	RJF UN	纽约证券交易所	美国	344	206,422.80	0.12
198	Metallurgical Corp of China Ltd	中国中冶	1618 HK	香港证券交易所	中国香港	128,000	205,792.92	0.12
199	Tianjin Pharmaceutical Da Re Tang Group Corp Ltd	达仁堂	600329 SH	上海证券交易所	中国	8,300	204,014.00	0.12
200	Yunda Holding Co Ltd	韵达股份	002120 SZ	深圳证券交易所	中国	11,900	203,014.00	0.11
201	Sumitomo Corp	住友商事有限公司	8053 JT	日本证券交易所	日本	2,200	200,740.21	0.11
202	NiSource Inc	NiSource 公司	NI UN	纽约证券交易所	美国	1,012	200,294.22	0.11
203	Travelers Cos Inc/The	旅行家集团	TRV UN	纽约证券交易所	美国	175	198,642.34	0.11
204	Merck & Co Inc	默克	MRK UN	纽约证券交易所	美国	323	197,636.70	0.11
205	Pacific Basin Shipping Ltd	太平洋航运	2343 HK	香港证券交易所	中国香港	77,000	197,548.89	0.11
206	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	196	197,354.62	0.11
20	Carrefour	家乐福	CA FP	巴黎证	法国	1,660	196,439.14	0.11

7	SA			券交易所				
208	Public Storage	公共存储公司	PSA UN	纽约证券交易所	美国	93	195,156.17	0.11
209	Hua Hong Semiconductor Ltd	华虹半导体	1347 HK	香港证券交易所	中国香港	8,000	194,299.17	0.11
210	Dongfeng Motor Group Co Ltd	东风集团股份有限公司	489 HK	香港证券交易所	中国香港	38,000	193,683.43	0.11
211	China State Construction International Holdings Ltd	中国建筑国际	3311 HK	香港证券交易所	中国香港	26,000	192,999.28	0.11
212	Power Construction Corp of China Ltd	中国电建	601669 SH	上海证券交易所	中国	24,500	192,815.00	0.11
213	Infosys Ltd	Infosys 科技有限公司	INFY UN	纽约证券交易所	美国	1,540	191,311.14	0.11
214	SG Micro Corp	圣邦股份	300661 SZ	深圳证券交易所	中国	1,050	191,121.00	0.11
215	BNP Paribas SA	法国巴黎银行	BNP FP	巴黎证券交易所	法国	594	188,854.02	0.11
216	Elevance Health Inc	Elevance 健康股份有限公司	ELV UN	纽约证券交易所	美国	58	187,849.67	0.11
217	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	1,078	187,818.67	0.11
218	Taiwan Semiconductor Manufacturer	台积电	TSM UN	纽约证券交易所	美国	342	187,640.68	0.11

	facturing Co L td							
21 9	Antero Resources Corp	Antero 资源公 司	AR UN	纽约证 券交易 所	美国	912	187,602.42	0.11
22 0	Alimentat ion Couche-Ta rd Inc	Alimen tation Couche -Tard 公司	ATD CT	加拿大 证券交 易所	加拿 大	715	186,889.00	0.11
22 1	Pernod Ricard SA	保乐力 加股份 有限公司	RI FP	巴黎证 券交易 所	法国	152	186,743.02	0.11
22 2	CSPC Pharmaceu tical Group Ltd	石药集 团	1093 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	28,000	186,534.04	0.11
22 3	China Energy Engineeri ng Corp Ltd	中国能 源建设	3996 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	200,000	186,431.42	0.11
22 4	China National Building Material Co Ltd	中国建 材	3323 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	26,000	186,328.80	0.11
22 5	Yangling Metron New Material Inc	美畅股 份	300861 SZ	深圳证 券交易 所	中国	2,000	185,380.00	0.10
22 6	Oracle Corp	甲骨文	ORCL UN	纽约证 券交易 所	美国	395	185,225.58	0.10
22 7	Fifth Third Bancorp	五三银 行	FITB UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	820	184,912.49	0.10
22 8	NIKE Inc	耐克公 司	NKE UN	纽约证 券交易 所	美国	269	184,508.47	0.10
22 9	Edwards Lifescien	爱德华 生命科	EW UN	纽约证 券交易	美国	289	184,436.05	0.10

	ces Corp	学公司		所				
230	Arista Networks Inc	Arista 网络股份有限公司	ANET UN	纽约证券交易所	美国	293	184,334.10	0.10
231	Nippon Yusen KK	日本邮船株式会社	9101 JT	日本证券交易所	日本	400	182,196.29	0.10
232	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股	700 HK	香港证券交易所	中国香港	600	181,847.60	0.10
233	Kroger Co/The	克罗格公司	KR UN	纽约证券交易所	美国	572	181,696.12	0.10
234	China Merchants Bank Co Ltd	招商银行	600036 SH	上海证券交易所	中国	4,300	181,460.00	0.10
235	Shanghai International Airport Co Ltd	上海机场	600009 SH	上海证券交易所	中国	3,200	181,440.00	0.10
236	CF Industries Holdings Inc	CF 工业控股股份有限公司	CF UN	纽约证券交易所	美国	313	180,090.28	0.10
237	Bayerische Motoren Werke AG	宝马汽车股份有限公司	BMW GY	德国证券交易所	德国	349	179,678.14	0.10
238	3i Group PLC	3i 集团公共股份有限公司	III LN	伦敦证券交易所	英国	1,992	179,664.66	0.10
239	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	166	179,647.40	0.10
240	Central China New Life Ltd	建业新生活	9983 HK	香港证券交易所	中国香港	54,000	179,641.21	0.10
241	Barclays PLC	巴克莱	BARC LN	伦敦证券交易所	英国	14,306	178,232.88	0.10

				所				
24 2	Prudential Financial Inc	保德信 金融集 团	PRU UN	纽约证 券交易 所	美国	277	177,874.65	0.10
24 3	Cigna Corp	信诺集 团	CI UN	纽约证 券交易 所	美国	100	176,858.81	0.10
24 4	China Jinmao Holdings Group Ltd	中国金 茂	817 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	98,000	176,836.19	0.10
24 5	FMC Corp	FMC 公 司	FMC UN	纽约证 券交易 所	美国	245	175,955.79	0.10
24 6	China Yangtze Power Co Ltd	长江电 力	600900 SH	上海证 券交易 所	中国	7,600	175,712.00	0.10
24 7	China Water Affairs Group Ltd	中国水 务	855 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	28,000	174,800.84	0.10
24 8	Verbund AG	维邦电 力公司	VER AV	维也纳 证券交 易所	奥地 利	267	174,680.52	0.10
24 9	China Southern Airlines Co Ltd	南方航 空	600029 SH	上海证 券交易 所	中国	23,200	169,592.00	0.10
25 0	Guangzhou Automobil e Group Co Ltd	广汽集 团	601238 SH	上海证 券交易 所	中国	11,000	167,640.00	0.09
25 1	Chubb Ltd	邱博保 险集团	CB UN	纽约证 券交易 所	美国	127	167,554.53	0.09
25 2	Juneyao Airlines Co Ltd	吉祥航 空	603885 SH	上海证 券交易 所	中国	9,300	167,307.00	0.09
25 3	Meituan	美团一 W	3690 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	1,000	166,077.90	0.09
25	HCA	HCA 医	HCA UN	纽约证	美国	147	165,803.93	0.09



4	Healthcare Inc	疗保健有限公司		券交易所				
255	Atlas Air Worldwide Holdings Inc	阿特拉斯航空全球控股有限公司	AAWW UW	纳斯达克证券交易所	美国	400	165,664.20	0.09
256	NN Group NV	NN 集团公众有限公司	NN NA	阿姆斯特丹交易所	荷兰	544	165,236.77	0.09
257	Tenet Healthcare Corp	Tenet 医疗保健公司	THC UN	纽约证券交易所	美国	468	165,087.55	0.09
258	United Overseas Bank Ltd	新加坡大华银行	UOB SP	新加坡证券交易所	新加坡	1,300	164,380.13	0.09
259	Olympic Circuit Technology Co Ltd	世运电路	603920 SH	上海证券交易所	中国	9,500	164,350.00	0.09
260	Micron Technology Inc	美光科技股份有限公司	MU UW	纳斯达克证券交易所	美国	442	163,984.74	0.09
261	APA Corp	APA	APA UW	纳斯达克证券交易所	美国	697	163,256.82	0.09
262	Huizhou Desay Sv Automotive Co Ltd	德赛西威	002920 SZ	深圳证券交易所	中国	1,100	162,800.00	0.09
263	Citigroup Inc	花旗集团	C UN	纽约证券交易所	美国	527	162,662.39	0.09
264	Ovintiv Inc	Ovintiv 股份有限公司	OVV UN	纽约证券交易所	美国	548	162,524.07	0.09
265	PepsiCo Inc	百事可乐	PEP UW	纳斯达克证券交易所	美国	143	159,948.64	0.09
266	Nutrien Ltd	Nutrien 有限	NTR CT	加拿大证券交易所	加拿大	299	159,560.32	0.09

		公司		易所				
26 7	Capital One Financial Corp	第一资 本金融	COF UN	纽约证 券交易 所	美国	227	158,732.19	0.09
26 8	Continent al Resources Inc/OK	美国大 陆资源 股份有 限公司 (俄克 拉何马 州)	CLR UN	纽约证 券交易 所	美国	360	157,892.40	0.09
26 9	Devon Energy Corp	戴文能 源	DVN UN	纽约证 券交易 所	美国	426	157,562.60	0.09
27 0	Mosaic Co/The	Mosaic 公司	MOS UN	纽约证 券交易 所	美国	495	156,904.81	0.09
27 1	LyondellB asell Industrie s NV	利安德 巴塞尔 工业公 司	LYB UN	纽约证 券交易 所	美国	267	156,723.40	0.09
27 2	Schneider Electric SE	施耐德 电气有 限公司	SU FP	巴黎证 券交易 所	法国	198	156,667.18	0.09
27 3	Intel Corp	英特尔	INTC UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	614	154,159.11	0.09
27 4	Dassault Systemes SE	达索系 统公司	DSY FP	巴黎证 券交易 所	法国	621	152,828.11	0.09
27 5	LB Group Co Ltd	龙佰集 团	002601 SZ	深圳证 券交易 所	中国	7,600	152,380.00	0.09
27 6	Option Care Health Inc	Option 护理健 康股份 有限公 司	OPCH UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	813	151,632.47	0.09
27 7	Assured Guaranty Ltd	美国保 证担保 有限公 司	AGO UN	纽约证 券交易 所	美国	404	151,269.32	0.09
27	Sempra	桑普拉	SRE UN	纽约证	美国	147	148,252.75	0.08

8	Energy	能源		券交易所				
279	Siemens AG	西门子	SIE GY	德国证券交易所	德国	217	147,656.69	0.08
280	W R Berkley Corp	WR Berkley 公司	WRB UN	纽约证券交易所	美国	322	147,514.69	0.08
281	Goldman Sachs Group Inc/The	高盛	GS UN	纽约证券交易所	美国	73	145,519.66	0.08
282	MaxLinear Inc	美国 MaxLinear 股份有限公司	MXL UN	纳斯达克证券交易所	美国	635	144,558.19	0.08
283	Bank of Chengdu Co Ltd	成都银行	601838 SH	上海证券交易所	中国	8,700	144,246.00	0.08
284	Simon Property Group Inc	西蒙房地产集团公司	SPG UN	纽约证券交易所	美国	224	142,698.32	0.08
285	Tenaris SA	特纳股份公司	TEN IM	意大利证券交易所	意大利	1,629	140,082.71	0.08
286	China Avionics Systems Co Ltd	中航电子	600372 SH	上海证券交易所	中国	7,100	137,669.00	0.08
287	Comerica Inc	Comerica 公司	CMA UN	纽约证券交易所	美国	278	136,910.14	0.08
288	Carlisle Cos Inc	卡莱股份有限公司	CSL UN	纽约证券交易所	美国	85	136,119.61	0.08
289	Bank of Ningbo Co Ltd	宁波银行	002142 SZ	深圳证券交易所	中国	3,800	136,078.00	0.08
290	Ningbo Menovo Pharmaceutical Co Ltd	美诺华	603538 SH	上海证券交易所	中国	4,259	135,649.15	0.08

29 1	Macy's Inc	梅西百 货	M UN	纽约证 券交易 所	美国	1,100	135,248.13	0.08
29 2	Herc Holdings Inc	Herc 控 股公司	HRI UN	纽约证 券交易 所	美国	219	132,502.16	0.08
29 3	Alcoa Corp	美国铝 业公司	AA UN	纽约证 券交易 所	美国	432	132,151.22	0.07
29 4	Chesapeak e Utilities Corp	切萨皮 克气业 公司	CPK UN	纽约证 券交易 所	美国	148	128,680.36	0.07
29 5	NXP Semicondu ctors NV	恩智浦 半导体 公司	NXPI UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	129	128,160.02	0.07
29 6	Industria l Bank Co Ltd	兴业银 行	601166 SH	上海证 券交易 所	中国	6,400	127,360.00	0.07
29 7	RELX PLC	励讯集 团	REL LN	伦敦证 券交易 所	英国	703	127,326.30	0.07
29 8	Gartner Inc	Gartne r 公司	IT UN	纽约证 券交易 所	美国	78	126,595.39	0.07
29 9	Matador Resources Co	Matado r 资源 公司	MTDR UN	纽约证 券交易 所	美国	403	126,011.70	0.07
30 0	PICC Property & Casualty Co Ltd	中国财 险	2328 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	18,000	125,610.31	0.07
30 1	Joinn Laborator ies China Co Ltd	昭衍新 药	603127 SH	上海证 券交易 所	中国	1,100	125,180.00	0.07
30 2	Airbnb Inc	爱彼迎 股份有 限公司	ABNB UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	209	124,950.97	0.07
30 3	L'Oreal SA	欧莱雅	OR FP	巴黎证 券交易 所	法国	54	124,624.77	0.07
30	Sonova	索诺瓦	SOON SE	瑞士证 券交易 所	瑞士	58	123,951.20	0.07

4	Holding AG	控股公司		券交易所				
305	Equinor ASA	挪威国家石油公司	EQNR UN	纽约证券交易所	美国	530	123,642.78	0.07
306	Wuxi Biologics Cayman Inc	药明生物	2269 HK	香港证券交易所	中国香港	2,000	122,805.28	0.07
307	Novo Nordisk A/S	诺和诺德公司	NVO UN	纽约证券交易所	美国	163	121,899.76	0.07
308	General Mills Inc	通用磨坊	GIS UN	纽约证券交易所	美国	239	121,023.66	0.07
309	Standard Chartered PLC	渣打集团	STAN LN	伦敦证券交易所	英国	2,386	120,093.11	0.07
310	Zhejiang Supor Co Ltd	苏泊尔	002032 SZ	深圳证券交易所	中国	2,100	118,314.00	0.07
311	Suncor Energy Inc	森科能源公司	SU CT	加拿大证券交易所	加拿大	501	117,782.06	0.07
312	British American Tobacco PLC	英美烟草	BATS LN	伦敦证券交易所	英国	411	117,695.69	0.07
313	Sompo Holdings Inc	损保控股株式会社	8630 JT	日本证券交易所	日本	400	117,592.28	0.07
314	South32 Ltd	南拓32有限公司	S32 AT	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	6,344	115,341.09	0.07
315	Poly Developments and Holdings Group Co Ltd	保利发展	600048 SH	上海证券交易所	中国	6,600	115,236.00	0.07
316	Group 1 Automotive Inc	第一汽车集团公司	GPI UN	纽约证券交易所	美国	101	115,099.17	0.07
31	Swiss	瑞士人	SLHN SE	瑞士证	瑞士	35	114,411.62	0.06

7	Life Holding AG	寿控股公司		券交易所				
318	Amgen Inc	AMGEN-T	AMGN UW	纳斯达克证券交易所	美国	70	114,301.85	0.06
319	Sandvik AB	山特维克股份公司	SAND SS	斯德哥尔摩证券交易所	瑞典	1,044	113,494.63	0.06
320	BAE Systems PLC	英国宇航系统	BA/ LN	伦敦证券交易所	英国	1,659	112,064.18	0.06
321	Fortescue Metals Group Ltd	FMG 集团	FMG AT	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	1,385	112,035.68	0.06
322	Microchip Technology Inc	微芯科技股份有限公司	MCHP UW	纳斯达克证券交易所	美国	287	111,872.06	0.06
323	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	268	111,771.68	0.06
324	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	110,789.79	0.06
325	Lockheed Martin Corp	洛克希德马丁	LMT UN	纽约证券交易所	美国	38	109,654.07	0.06
326	Thermo Fisher Scientific Inc	Thermo Fisher Scientific 公司	TMO UN	纽约证券交易所	美国	30	109,385.08	0.06
327	Helmerich & Payne Inc	Helmerich & Payne Inc	HP UN	纽约证券交易所	美国	378	109,239.31	0.06
328	ArcelorMittal SA	安赛乐米塔尔	MT UN	纽约证券交易所	美国	719	109,056.22	0.06
32	Biem. L. Fd	比音勒	002832	深圳证	中国	4,300	108,360.00	0.06

9	Ikk Garment Co Ltd	芬	SZ	券交易 所				
33 0	Dillard's Inc	Dillard's 公司	DDS UN	纽约证 券交易 所	美国	73	108,064.35	0.06
33 1	Woodside Energy Group Ltd	伍德赛 德能源 集团有 限公司	WDS AT	澳大利 亚证券 交易所	澳大 利亚	732	107,549.60	0.06
33 2	Aier Eye Hospital Group Co Ltd	爱尔眼 科	300015 SZ	深圳证 券交易 所	中国	2,400	107,448.00	0.06
33 3	Resona Holdings Inc	理索纳 控股株 式会社	8308 JT	日本证 券交易 所	日本	4,300	107,353.81	0.06
33 4	Unum Group	尤纳姆 集团	UNM UN	纽约证 券交易 所	美国	470	107,311.26	0.06
33 5	L3Harris Technologies Inc	L3Harris Technologies 股份有 限公司	LHX UN	纽约证 券交易 所	美国	66	107,061.60	0.06
33 6	Chord Energy Corp	绿洲石 油公司	OAS UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	131	106,953.88	0.06
33 7	Diageo PLC	帝亚吉 欧	DGE LN	伦敦证 券交易 所	英国	370	106,285.88	0.06
33 8	Internati onal Business Machines Corp	国际商 业机器	IBM UN	纽约证 券交易 所	美国	112	106,129.25	0.06
33 9	KDDI Corp	KDDI 有 限公司	9433 JT	日本证 券交易 所	日本	500	105,372.15	0.06
34 0	Wolters Kluwer NV	威科集 团	WKL NA	阿姆斯 特丹交 易所	荷兰	162	105,089.00	0.06
34	Las Vegas	拉斯维	LVS UN	纽约证	美国	465	104,827.71	0.06

1	Sands Corp	加斯金沙集团		券交易所				
342	Enphase Energy Inc	Enphase 能源股份有限公司	ENPH UQ	纳斯达克证券交易所	美国	80	104,826.70	0.06
343	Eli Lilly & Co	礼来	LLY UN	纽约证券交易所	美国	48	104,449.79	0.06
344	CenterPoint Energy Inc	中点能源	CNP UN	纽约证券交易所	美国	525	104,224.69	0.06
345	China National Nuclear Power Co Ltd	中国核电	601985 SH	上海证券交易所	中国	15,100	103,586.00	0.06
346	Komatsu Ltd	小松制作所	6301 JT	日本证券交易所	日本	700	103,460.76	0.06
347	Tyson Foods Inc	泰森食品公司	TSN UN	纽约证券交易所	美国	177	102,232.21	0.06
348	Thales SA	泰雷兹集团	HO FP	巴黎证券交易所	法国	124	101,721.32	0.06
349	Arch Capital Group Ltd	阿契资本集团	ACGL UW	纳斯达克证券交易所	美国	333	101,665.43	0.06
350	Occidental Petroleum Corp	西方石油	OXY UN	纽约证券交易所	美国	257	101,557.98	0.06
351	Coterra Energy Inc	Coterra 能源股份有限公司	CTRA UN	纽约证券交易所	美国	586	101,428.99	0.06
352	Capitaland Investment Ltd/Singapore	凯德投资有限公司/新加坡	CLI SP	新加坡证券交易所	新加坡	5,500	101,205.17	0.06
35	Rio Tinto	力拓有	RIO AT	澳大利	澳大	213	100,942.65	0.06



3	Ltd	限公司		亚证券 交易所	利亚			
35 4	Assurant Inc	安信龙 集团	AIZ UN	纽约证 券交易 所	美国	87	100,925.70	0.06
35 5	China Railway Construct ion Corp Ltd	中国铁 建	601186 SH	上海证 券交易 所	中国	12,700	100,330.00	0.06
35 6	Consolida ted Edison Inc	联合爱 迪生	ED UN	纽约证 券交易 所	美国	157	100,205.90	0.06
35 7	Yunnan Energy New Material Co Ltd	恩捷股 份	002812 SZ	深圳证 券交易 所	中国	400	100,180.00	0.06
35 8	Enbridge Inc	安桥公 司	ENB CT	加拿大 证券交 易所	加拿 大	353	99,894.51	0.06
35 9	AP Moller - Maersk A/S	AP Moller - Maersk 公共有 限公司	AMKBY UV	纽约证 券交易 所	美国	1,276	99,810.46	0.06
36 0	Rio Tinto PLC	力拓公 司	RIO UN	纽约证 券交易 所	美国	243	99,483.08	0.06
36 1	TC Energy Corp	TC 能源 公司	TRP CT	加拿大 证券交 易所	加拿 大	286	99,277.10	0.06
36 2	Chesapeak e Energy Corp	切萨皮 克能源 公司	CHK UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	182	99,061.61	0.06
36 3	Kunlun Energy Co Ltd	昆仑能 源	135 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	18,000	98,979.69	0.06
36 4	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	1,800	98,758.13	0.06

365	Danaher Corp	丹纳赫	DHR UN	纽约证券交易所	美国	58	98,685.50	0.06
366	Dai-ichi Life Holdings Inc	第一生命控股株式会社	8750 JT	日本证券交易所	日本	800	98,665.09	0.06
367	Luxshare Precision Industry Co Ltd	立讯精密	002475 SZ	深圳证券交易所	中国	2,900	97,991.00	0.06
368	Western Union Co/The	西联汇款	WU UN	纽约证券交易所	美国	874	96,609.13	0.05
369	Hitachi Ltd	日立	6501 JT	日本证券交易所	日本	300	94,901.27	0.05
370	Atmos Energy Corp	美国阿特摩斯能源公司	ATO UN	纽约证券交易所	美国	126	94,795.84	0.05
371	Lloyds Banking Group PLC	劳埃德银行集团	LLOY LN	伦敦证券交易所	英国	27,422	94,401.71	0.05
372	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	47	94,391.01	0.05
373	Assicurazioni Generali SpA	忠利保险	G IM	意大利证券交易所	意大利	878	93,685.14	0.05
374	Fortinet Inc	Fortinet 股份有限公司	FTNT UW	纳斯达克证券交易所	美国	245	93,034.10	0.05
375	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	BJ's 批发俱乐部控股有限公司	BJ UN	纽约证券交易所	美国	222	92,852.49	0.05
376	AES Corp/The	爱伊斯科公司	AES UN	纽约证券交易所	美国	654	92,218.26	0.05

				所				
377	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	Mediobanca 公共有限公司	MB IM	意大利证券交易所	意大利	1,593	92,195.43	0.05
378	Mitsui OSK Lines Ltd	商船三井	9104 JT	日本证券交易所	日本	600	91,540.37	0.05
379	Discover Financial Services	Discover 金融服务公司	DFS UN	纽约证券交易所	美国	142	90,136.52	0.05
380	Caterpillar Inc	卡特彼勒	CAT UN	纽约证券交易所	美国	75	89,979.74	0.05
381	McCormick & Co Inc/MD	味好美股份有限公司/马里兰州	MKC UN	纽约证券交易所	美国	161	89,954.57	0.05
382	Canadian National Railway Co	加拿大国家铁路公司	CNR CT	加拿大证券交易所	加拿大	119	89,695.99	0.05
383	Palo Alto Networks Inc	Palo Alto Networks 股份有限公司	PANW UN	纳斯达克证券交易所	美国	27	89,500.34	0.05
384	United States Steel Corp	美国钢铁	X UN	纽约证券交易所	美国	744	89,429.67	0.05
385	Daiwa Securities Group Inc	大和证券	8601 JT	日本证券交易所	日本	3,000	89,329.25	0.05
386	Kinder Morgan Inc	特拉华州金德摩根公司	KMI UN	纽约证券交易所	美国	793	89,199.07	0.05
38	Amerisour	美源伯	ABC UN	纽约证	美国	93	88,306.19	0.05

7	ceBergen Corp	根		券交易所				
388	KeyCorp	KeyCorp 公司	KEY UN	纽约证券交易所	美国	759	87,768.80	0.05
389	Wilmar International Ltd	丰益国际有限公司	WIL SP	新加坡证券交易所	新加坡	4,500	87,573.06	0.05
390	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	1,125	86,886.64	0.05
391	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	三菱日联金融集团	8306 JP	日本证券交易所	日本	2,400	86,015.52	0.05
392	Epiroc AB	安百拓集团	EPIA SS	斯德哥尔摩证券交易所	瑞典	830	85,932.42	0.05
393	Westlake Corp	Westlake 公司	WLK UN	纽约证券交易所	美国	130	85,520.69	0.05
394	Cardinal Health Inc	嘉德诺健康集团	CAH UN	纽约证券交易所	美国	243	85,245.59	0.05
395	West Pharmaceutical Services Inc	西氏医药服务公司	WST UN	纽约证券交易所	美国	42	85,231.69	0.05
396	JPMorgan Chase & Co	摩根大通	JPM UN	纽约证券交易所	美国	112	84,646.32	0.05
397	China Vanke Co Ltd	万科	000002 SZ	深圳证券交易所	中国	4,100	84,050.00	0.05
398	SF Holding Co Ltd	顺丰控股	002352 SZ	深圳证券交易所	中国	1,500	83,715.00	0.05
399	BHP Group Ltd	必和必拓集团	BHP AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	439	83,562.83	0.05
400	Hewlett Packard	慧与	HPE UN	纽约证券交易所	美国	938	83,475.59	0.05

	Enterprise Co			所				
401	NortonLifeLock Inc	诺顿LifeLock 股份有限公司	NLOK UN	纳斯达克证券交易所	美国	565	83,271.02	0.05
402	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	111	83,018.94	0.05
403	Commercial Metals Co	美国商业金属公司	CMC UN	纽约证券交易所	美国	366	81,305.93	0.05
404	Newmont Corp	纽蒙黄金公司	NEM UN	纽约证券交易所	美国	202	80,894.79	0.05
405	IMCD NV	艾敏斯帝公众有限公司	IMCD NA	阿姆斯特丹交易所	荷兰	86	78,926.50	0.04
406	Inspire Medical Systems Inc	Inspire Medical Systems Inc	INSP UN	纽约证券交易所	美国	64	78,462.17	0.04
407	Ping An Bank Co Ltd	平安银行	000001 SZ	深圳证券交易所	中国	5,200	77,896.00	0.04
408	Sinomine Resource Group Co Ltd	中矿资源	002738 SZ	深圳证券交易所	中国	840	77,792.40	0.04
409	BlackRock Inc	贝莱德有限公司	BLK UN	纽约证券交易所	美国	19	77,662.71	0.04
410	Comefly Outdoor Co Ltd	牧高笛	603908 SH	上海证券交易所	中国	800	76,120.00	0.04
411	Progressive Corp/The	前进保险公司	PGR UN	纽约证券交易所	美国	97	75,692.44	0.04

41 2	Shenzhen Capchem Technology Co Ltd	新宙邦	300037 SZ	深圳证 券交易 所	中国	1,440	75,686.40	0.04
41 3	Credicorp Ltd	Credic orp 有 限公司	BAP UN	纽约证 券交易 所	美国	93	74,843.05	0.04
41 4	Cie Financier e Richemont SA	瑞士历 峰集团	CFR SE	瑞士证 券交易 所	瑞士	103	73,602.70	0.04
41 5	Engie SA	Engie	ENGI FP	巴黎证 券交易 所	法国	921	70,782.67	0.04
41 6	Telefonak tiebolage t LM Ericsson	爱立信	ERIC UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,396	69,331.45	0.04
41 7	Verizon Communica tions Inc	Verizo n 通信 股份有 限公司	VZ UN	纽约证 券交易 所	美国	200	68,120.71	0.04
41 8	Becton Dickinson and Co	碧迪	BDX UN	纽约证 券交易 所	美国	41	67,837.02	0.04
41 9	Duke Energy Corp	杜克能 源	DUK UN	纽约证 券交易 所	美国	94	67,635.74	0.04
42 0	Ivanhoe Mines Ltd	艾芬豪 矿业有 限公司	IVN CT	加拿大 证券交 易所	加拿 大	1,750	67,506.21	0.04
42 1	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	66,402.86	0.04
42 2	Switch Inc	Switch Inc	SWCH UN	纽约证 券交易 所	美国	295	66,325.41	0.04
42 3	MetLife Inc	大都会 集团	MET UN	纽约证 券交易 所	美国	153	64,475.55	0.04
42 4	Xinyi Glass	信义玻 璃	868 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	4,000	64,378.70	0.04

	Holdings Ltd			所				
425	S&P Global Inc	标普全球	SPGI UN	纽约证券交易所	美国	28	63,340.05	0.04
426	Iflytek Co Ltd	科大讯飞	002230 SZ	深圳证券交易所	中国	1,500	61,830.00	0.04
427	Lundin Mining Corp	伦丁矿业公司	LUN CT	加拿大证券交易所	加拿大	1,438	61,085.27	0.03
428	Global Payments Inc	环汇有限公司	GPN UN	纽约证券交易所	美国	82	60,889.04	0.03
429	Corteva Inc	科迪华公司	CTVA UN	纽约证券交易所	美国	167	60,680.32	0.03
430	Pioneer Natural Resources Co	Pioneer 自然资源公司	PXD UN	纽约证券交易所	美国	40	59,887.16	0.03
431	FactSet Research Systems Inc	FactSet 研究系统股份有限公司	FDS UN	纽约证券交易所	美国	23	59,363.07	0.03
432	Wynn Resorts Ltd	永利渡假村有限公司	WYNN UW	纳斯达克证券交易所	美国	155	59,274.41	0.03
433	CME Group Inc	芝加哥商业交易所	CME UW	纳斯达克证券交易所	美国	43	59,074.41	0.03
434	Norsk Hydro ASA	挪威海德鲁公司	NHYDY UV	纽约证券交易所	美国	1,528	58,351.06	0.03
435	Laboratory Corp of America Holdings	美国实验控股	LH UN	纽约证券交易所	美国	37	58,196.70	0.03
436	Lowe's Cos Inc	劳氏	LOW UN	纽约证券交易所	美国	49	57,441.73	0.03
437	AIXTRON SE	爱思强股份有	AIXA GY	德国证券交易所	德国	333	56,431.22	0.03

		限公司		所				
438	Societe Generale SA	法国兴业银行	GLE FP	巴黎证券交易所	法国	385	56,366.11	0.03
439	Brookfield Infrastructure Corp	Brookfield Infrastructure Corp	BIPC UN	纽约证券交易所	美国	196	55,905.96	0.03
440	Bank of Shanghai Co Ltd	上海银行	601229 SH	上海证券交易所	中国	8,500	55,675.00	0.03
441	United Parcel Service Inc	联合包裹服务股份有限公司	UPS UN	纽约证券交易所	美国	45	55,129.45	0.03
442	Vertex Pharmaceuticals Inc	福泰制药	VRTX UW	纳斯达克证券交易所	美国	29	54,844.96	0.03
443	HEICO Corp	海科航空公司	HEI UN	纽约证券交易所	美国	61	53,679.92	0.03
444	Infineon Technologies AG	英飞凌科技有限公司	IFX GY	德国证券交易所	德国	328	53,078.26	0.03
445	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	67	52,430.80	0.03
446	Paychex Inc	Paychex 公司	PAYX UW	纳斯达克证券交易所	美国	67	51,203.22	0.03
447	InterContinental Hotels Group PLC	洲际酒店集团	IHG LN	伦敦证券交易所	英国	144	50,967.04	0.03
448	FleetCor Technologies Inc	FleetCor 技术股份有限公司	FLT UN	纽约证券交易所	美国	36	50,764.76	0.03
44	China	中国太	601601	上海证	中国	2,000	47,060.00	0.03



9	Pacific Insurance Group Co Ltd	保	SH	券交易所				
450	Moderna Inc	莫德纳公司	MRNA UW	纳斯达克证券交易所	美国	48	46,018.73	0.03
451	SVB Financial Group	硅谷银行金融集团	SIVB UW	纳斯达克证券交易所	美国	17	45,065.91	0.03
452	II-VI Inc	贰陆公司	IIVI UW	纳斯达克证券交易所	美国	131	44,794.90	0.03
453	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	122	44,632.29	0.03
454	Matson Inc	美森公司	MATX UN	纽约证券交易所	美国	90	44,021.41	0.02
455	Veolia Environnement SA	威立雅环境集团	VIE FP	巴黎证券交易所	法国	269	43,907.70	0.02
456	Gilead Sciences Inc	吉利德科学	GILD UW	纳斯达克证券交易所	美国	105	43,557.32	0.02
457	CIMC Enric Holdings Ltd	中集安瑞科	3899 HK	香港证券交易所	中国香港	6,000	43,255.51	0.02
458	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	住友金属矿山株式会社	5713 JT	日本证券交易所	日本	200	41,765.60	0.02
459	MSCI Inc	MSCI 明晟	MSCI UN	纽约证券交易所	美国	15	41,491.55	0.02
460	Keppel Corp Ltd	吉宝企业有限公司	KEP SP	新加坡证券交易所	新加坡	1,300	40,641.03	0.02
461	Extra Space Storage Inc	额外空间仓储公司	EXR UN	纽约证券交易所	美国	35	39,961.02	0.02

46 2	Moncler SpA	Moncler 股份有限公司	MONC IM	意大利 证券交易所	意大利	139	39,872.68	0.02
46 3	Splunk Inc	Splunk 公司	SPLK UW	纳斯达克 证券交易所	美国	67	39,777.26	0.02
46 4	Thunder Software Technology Co Ltd	中科创 达	300496 SZ	深圳证 券交易 所	中国	300	39,144.00	0.02
46 5	Anhui Conch Cement Co Ltd	海螺水 泥	600585 SH	上海证 券交易 所	中国	1,100	38,808.00	0.02
46 6	Walt Disney Co/The	华特迪 士尼公 司	DIS UN	纽约证 券交易 所	美国	60	38,013.37	0.02
46 7	Schnitzer Steel Industrie s Inc	史尼索 钢铁工 业公司	SCHN UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	170	37,468.40	0.02
46 8	Legal & General Group PLC	法通集 团公共 有限公司	LGEN LN	伦敦证 券交易 所	英国	1,883	36,693.91	0.02
46 9	Beijing Career Internati onal Co Ltd	科锐国 际	300662 SZ	深圳证 券交易 所	中国	700	36,323.00	0.02
47 0	NIPPON EXPRESS HOLDINGS INC	NIPPON EXPRES S HOLDIN GS INC	9147 JT	日本证 券交易 所	日本	100	36,213.23	0.02
47 1	Assa Abloy AB	亚萨合 莱集团	ASSAB SS	斯德哥 尔摩证 券交易 所	瑞典	252	35,893.81	0.02
47 2	Brenntag SE	Brennt ag	BNR GY	德国证 券交易 所	德国	81	35,252.95	0.02
47 3	Elia Group	伊利亚 系统经	ELI BB	布鲁塞 尔证券	比利 时	37	35,058.82	0.02

	SA/NV	运商公司		交易所				
474	Bayer AG	拜耳股份公司	BAYN GY	德国证券交易所	德国	88	34,981.45	0.02
475	Shenzhen Senior Technology Material Co Ltd	星源材质	300568 SZ	深圳证券交易所	中国	1,199	34,818.96	0.02
476	Nuvei Corp	Nuvei Corp	NVEI UW	纳斯达克证券交易所	美国	137	33,256.93	0.02
477	Prologis Inc	安博	PLD UN	纽约证券交易所	美国	42	33,163.04	0.02
478	Ipsen SA	益普生集团	IPN FP	巴黎证券交易所	法国	52	32,817.53	0.02
479	Abbott Laboratories	雅培制药	ABT UN	纽约证券交易所	美国	45	32,813.71	0.02
480	Teledyne Technologies Inc	Teledyne 科技股份有限公司	TDY UN	纽约证券交易所	美国	13	32,727.67	0.02
481	NARI Technology Co Ltd	国电南瑞	600406 SH	上海证券交易所	中国	1,200	32,400.00	0.02
482	Nokia Oyj	诺基亚	NOK UN	纽约证券交易所	美国	1,024	31,682.10	0.02
483	Wuxi Lead Intelligent Equipment Co Ltd	先导智能	300450 SZ	深圳证券交易所	中国	500	31,590.00	0.02
484	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd	迈瑞医疗	300760 SZ	深圳证券交易所	中国	100	31,320.00	0.02

485	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	LVMH 集 团公司	LVMUY UV	纽约证 券交易 所	美国	38	31,170.16	0.02
486	Yealink Network Technolog y Corp Ltd	亿联网 络	300628 SZ	深圳证 券交易 所	中国	400	30,460.00	0.02
487	Getinge AB	洁定集 团	GETIB SS	斯德哥 尔摩证 券交易 所	瑞典	195	30,216.31	0.02
488	Foshan H aitian F lavouring & Food Co Ltd	海天味 业	603288 SH	上海证 券交易 所	中国	330	29,818.80	0.02
489	Qumei Home Furnishin gs Group Co Ltd	曲美家 居	603818 SH	上海证 券交易 所	中国	3,100	29,450.00	0.02
490	St James's Place PLC	圣占姆 士财富 管理有 限公司	STJ LN	伦敦证 券交易 所	英国	326	29,243.80	0.02
491	Wanhua Chemical Group Co Ltd	万华化 学	600309 SH	上海证 券交易 所	中国	300	29,097.00	0.02
492	AutoZone Inc	AutoZo ne 股份 有限公司	AZO UN	纽约证 券交易 所	美国	2	28,847.21	0.02
493	Universal Health Services Inc	Univer sal 保 健服务 股份有 限公司	UHS UN	纽约证 券交易 所	美国	41	27,712.11	0.02
494	Beijing Easpring Materia l Techno logy Co	当升科 技	300073 SZ	深圳证 券交易 所	中国	300	27,102.00	0.02

	Ltd							
49 5	Jiangsu Eastern Shenghong Co Ltd	东方盛 虹	000301 SZ	深圳证 券交易 所	中国	1,500	25,365.00	0.01
49 6	Charles Schwab Corp/The	嘉信理 财	SCHW UN	纽约证 券交易 所	美国	57	24,169.50	0.01
49 7	Heidelber gCement AG	海德堡 水泥股 份有限 公司	HEI GY	德国证 券交易 所	德国	73	23,452.35	0.01
49 8	Shockwave Medical Inc	Shockw ave Medica l Inc	SWAV UN	纳斯达 克证券 交易所	美国	18	23,094.33	0.01
49 9	Earthston e Energy Inc	地石能 源股份 有限公 司	ESTE UN	纽约证 券交易 所	美国	249	22,811.04	0.01
50 0	Ford Motor Co	福特汽 车	F UN	纽约证 券交易 所	美国	304	22,708.16	0.01
50 1	Ryder System Inc	莱德系 统股份 有限公 司	R UN	纽约证 券交易 所	美国	47	22,414.87	0.01
50 2	Silvergat e Capital Corp	Silver gate Capita l Corp	SI UN	纽约证 券交易 所	美国	62	22,274.20	0.01
50 3	Hainan Haide Capital Managem ent Co Ltd	海德股 份	000567 SZ	深圳证 券交易 所	中国	1,465	21,682.00	0.01
50 4	Zhejiang Xinan Chemical Industr ial Grou p Co Ltd	新安股 份	600596 SH	上海证 券交易 所	中国	1,000	21,650.00	0.01
50 5	WSP Global	WSP 环 球股份	WSP CT	加拿大 证券交	加拿 大	25	18,941.30	0.01

	Inc	有限公司		易所				
506	Netflix Inc	奈飞公司	NFLX UW	纳斯达克证券交易所	美国	16	18,777.96	0.01
507	Chengtun Mining Group Co Ltd	盛屯矿业	600711 SH	上海证券交易所	中国	2,400	18,624.00	0.01
508	US Bancorp	美国合众银行	USB UN	纽约证券交易所	美国	60	18,531.52	0.01
509	TCL Zhonghuan Renewable Energy Technology Co Ltd	TCL 中环	002129 SZ	深圳证券交易所	中国	300	17,667.00	0.01
510	Boeing Co/The	波音	BA UN	纽约证券交易所	美国	19	17,434.07	0.01
511	Beijing New Building Materials PLC	北新建材	000786 SZ	深圳证券交易所	中国	500	17,310.00	0.01
512	UniCredit SpA	裕信银行公共有限公司	UCG IM	意大利证券交易所	意大利	266	16,899.28	0.01
513	Ferrari NV	法拉利	RACE UN	纽约证券交易所	美国	12	14,776.89	0.01
514	Aon PLC	怡安集团	AON UN	纽约证券交易所	美国	8	14,479.44	0.01
515	KKR & Co Inc	KKR & Co Inc	KKR UN	纽约证券交易所	美国	46	14,290.85	0.01
516	Experian PLC	益博睿有限公司	EXP LN	伦敦证券交易所	英国	73	14,290.79	0.01
51	Sany	三一重	600031	上海证	中国	700	13,342.00	0.01

7	Heavy Industry Co Ltd	工	SH	券交易所				
518	Marriott International Inc/MD	万豪国际	MAR UW	纳斯达克证券交易所	美国	14	12,779.45	0.01
519	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	20	12,728.84	0.01
520	Anhui Kouzi Distillery Co Ltd	口子窖	603589 SH	上海证券交易所	中国	200	11,722.00	0.01
521	Zhongtai Securities Co Ltd	中泰证券	600918 SH	上海证券交易所	中国	1,400	10,710.00	0.01
522	Kering SA	开云集团	KER FP	巴黎证券交易所	法国	3	10,304.45	0.01
523	Jianmin Pharmaceutical Group Co Ltd	健民集团	600976 SH	上海证券交易所	中国	200	10,230.00	0.01
524	Guiyang Xintian Pharmaceutical Co Ltd	新天药业	002873 SZ	深圳证券交易所	中国	600	10,206.00	0.01
525	Warner Bros Discovery Inc	华纳兄弟探索公司	WBD UW	纳斯达克证券交易所	美国	108	9,727.23	0.01
526	Snowflake Inc	Snowflake 股份有限公司	SNOW UN	纽约证券交易所	美国	10	9,332.87	0.01
527	Luyang Energy-Saving Materials Co Ltd	鲁阳节能	002088 SZ	深圳证券交易所	中国	400	8,420.00	0.00
52	Sika AG	瑞士西	SIKA SE	瑞士证	瑞士	5	7,732.89	0.00

8		卡股份 公司		券交易 所				
52 9	Builders FirstSource Inc	Builders FirstSource 股份有 限公司	BLDR UN	纽约证 券交易 所	美国	21	7,568.45	0.00
53 0	Hermes Internati onal	爱马仕 国际公 司	RMS FP	巴黎证 券交易 所	法国	1	7,477.96	0.00
53 1	General Motors Co	通用汽 车公司	GM UN	纽约证 券交易 所	美国	31	6,607.78	0.00
53 2	Jinmao Property Services Co Ltd	金茂服 务	816 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	1,480	6,075.27	0.00
53 3	Accenture PLC	埃森哲 公司	ACN UN	纽约证 券交易 所	美国	3	5,590.26	0.00
53 4	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	36	5,483.69	0.00
53 5	PayPal Holdings Inc	Paypal 控股股 份有限 公司	PYPL UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	9	4,218.52	0.00
53 6	Zscaler Inc	Zscale r 股份 有限公 司	ZS UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	4	4,013.69	0.00
53 7	Embecta Corp	Embecta Corp	EMBC UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	13	2,209.12	0.00
53 8	Auto Trader Group PLC	Auto Trader 集团公 共有限 公司	AUTO LN	伦敦证 券交易 所	英国	34	1,535.36	0.00
53 9	Goodman Group	嘉民集 团	GMG AT	澳大利 亚证券 交易所	澳大 利亚	1	82.32	0.00



注：本表所使用的证券代码为彭博代码。

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	Berkshire Hathaway Inc	BRK/B UN	5,314,004.59	2.23
2	Teck Resources Ltd	TECK UN	4,535,860.43	1.91
3	Verbund AG	VER AV	2,378,438.49	1.00
4	Bank of Montreal	BMO CT	2,358,279.42	0.99
5	Royal Bank of Canada	RY CT	2,353,010.18	0.99
6	Steel Dynamics Inc	STLD UW	2,341,544.78	0.98
7	Canadian Natural Resources Ltd	CNQ CT	2,289,411.56	0.96
8	Raytheon Technologies Corp	RTX UN	2,255,573.91	0.95
9	Dollarama Inc	DOL CT	2,254,623.61	0.95
10	Bank of Nova Scotia/The	BNS CT	2,226,988.89	0.94
11	Check Point Software Technologies Ltd	CHKP UW	2,219,153.84	0.93
12	General Dynamics Corp	GD UN	1,353,275.25	0.57
13	Tesla Inc	TSLA UW	1,337,942.78	0.56
14	Amazon.com Inc	AMZN UW	1,251,031.48	0.53
15	Cameco Corp	CCO CT	1,238,230.89	0.52
16	Exxon Mobil Corp	XOM UN	1,182,594.64	0.50
17	Activision Blizzard Inc	ATVI UW	1,152,149.36	0.48
18	Loblaw Cos Ltd	L CT	1,117,191.46	0.47
19	Intact Financial Corp	IFC CT	1,099,066.45	0.46
20	Jazz Pharmaceuticals PLC	JAZZ UW	1,098,538.66	0.46

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

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	Microsoft Corp	MSFT UW	2,420,986.87	1.02
2	Verbund AG	VER AV	2,315,101.92	0.97
3	Check Point Software Technologies Ltd	CHKP UW	2,105,068.45	0.89
4	Bank of Nova Scotia/The	BNS CT	1,941,086.49	0.82
5	Royal Bank of Canada	RY CT	1,785,081.17	0.75
6	Apple Inc	AAPL UW	1,361,064.17	0.57
7	Bank of Montreal	BMO CT	1,307,369.50	0.55
8	Alphabet Inc	GOOGL UW	1,075,413.66	0.45
9	Dollarama Inc	DOL CT	989,254.82	0.42
10	Meta Platforms Inc	FB UW	982,359.53	0.41
11	JiuGui Liquor Co Ltd	000799 SZ	951,463.00	0.40
12	China Merchants Bank Co Ltd	600036 SH	939,338.00	0.40
13	Advanced Micro Devices Inc	AMD UR	903,448.53	0.38
14	Loblaw Cos Ltd	L CT	891,539.11	0.37
15	Steel Dynamics Inc	STLD UW	846,991.68	0.36
16	Jazz Pharmaceuticals PLC	JAZZ UW	789,655.84	0.33
17	Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	LISN SE	728,279.84	0.31
18	Adobe Inc	ADBE UW	699,038.10	0.29
19	East Money Information Co Ltd	300059 SZ	696,353.00	0.29
20	Shenzhen Capchem Technology Co Ltd	300037 SZ	604,720.00	0.25

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	155,155,968.28
卖出收入（成交）总额	65,968,449.17

注：7.5.1 项“买入金额”、7.5.2 项“卖出金额”及 7.5.3 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。

### 7.6 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+	8,631,546.38	4.89
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。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

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	019664	21 国债 16	69,000	7,013,589.12	3.97
2	019666	22 国债 01	16,000	1,617,957.26	0.92

注：报告期末，本基金仅持有上述 2 支债券。

#### 7.8 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。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

无。

#### 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

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 MSCI UAE ETF	E T F	交 易 型 开 放 式	BlackRock Fund Advisors	353,02 0.38	0.2 0
2	iShares CORE S&P/ ASX 200 ETF	E T F	交 易 型 开 放 式	BlackRock Investment Management Australia Ltd/Australia	328,13 8.94	0.1 9
3	iShares Russell 1 000 Value ETF	E T F	交 易 型 开 放 式	BlackRock Fund Advisors	279,23 7.13	0.1 6
4	SPDR Gold Shares	E T F	交 易 型 开 放 式	State Street Global Advisors I nc	248,73 2.54	0.1 4
5	iShares MSCI Braz il ETF	E T F	交 易 型 开 放 式	BlackRock Fund Advisors	123,71 4.39	0.0 7
6	iShares MSCI Sout h Africa ETF	E T F	交 易 型 开 放 式	BlackRock Fund Advisors	82,128 .21	0.0 5
7	Invesco QQQ Trust Series 1	E T F	交 易 型 开 放 式	Invesco Capital Management LLC	37,621 .42	0.0 2

			式			
8	iShares Core MSCI Europe ETF	E T F	交 易 型 开 放 式	BlackRock Fund Advisors	5,431.40	-
9	iShares MSCI ACWI ETF	E T F	交 易 型 开 放 式	BlackRock Fund Advisors	563.02	-

注：报告期末，本基金仅持有上述 9 支基金。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 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。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	532,599.70
2	应收清算款	-
3	应收股利	528,551.91
4	应收利息	-
5	应收申购款	64,652.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,125,804.07

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
嘉实全球价值股票（QDII）人民币	6,631	31,003.29	23,027,126.71	11.20	182,555,678.63	88.80
嘉实全球价值股票（QDII）美元现汇	23	12,088.65	-	-	278,038.96	100.00
合计	6,652	30,947.21	23,027,126.71	11.19	182,833,717.59	88.81

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。

## 8.2 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	207,351.75	0.10
	嘉实全球价值股票（QDII）美元现汇	-	-
	合计	207,351.75	0.10

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实全球价值股票（QDII）人民币	嘉实全球价值股票（QDII）美元现汇
基金合同生效日（2021年11月23日）基金份额总额	237,958,337.73	281,215.89
本报告期期初基金份额总额	237,958,337.73	281,215.89
本报告期基金总申购份额	3,046,223.15	19,034.27
减：本报告期基金总赎回份额	35,421,755.54	22,211.20
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	205,582,805.34	278,038.96

## § 10 重大事件揭示

## 10.1 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。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

## (1) 基金管理人的重大人事变动情况

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

## (2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

## 10.3 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。

## 10.4 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。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金的审计机构。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人收到中国证券监督管理委员会北京监管局对公司及相关人员采取行政监管措施。公司已及时按要求改正并报告。

报告期内，基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
瑞银集团 Union Bank of Switzerla nd	-	87,174,842.0 9	39.47	52,102.75	38.97	-
中信证券 股份有限 公司 Citic Securitie s Company Limited	-	50,168,532.4 5	22.72	31,878.68	23.84	-
华兴证券 有限公司 China	-	36,870,526.6 7	16.69	23,773.01	17.78	-



Renaissance Security						
瑞士信贷 (香港)有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	17,353,090.77	7.86	3,287.00	2.46	-
摩根大通 证券(亚太)有限公司 J.P.Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	16,798,334.53	7.61	5,421.21	4.05	-
花旗环球 金融亚洲 有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited	-	5,358,551.91	2.43	10,389.50	7.77	-
极讯欧洲 有限公司 Instinet Europe Limited	-	3,426,963.59	1.55	2,345.62	1.75	-
招商证券 (香港)有限公司 China Merchants Securities (HK) Co., Ltd.	-	1,614,914.18	0.73	3,229.83	2.42	-
中国国际 金融香港 证券有限	-	1,469,222.85	0.67	797.29	0.60	-

公司 China Internati onal Capital Corporati on Hong Kong Securitie s Limited						
野村证券 NOMURA	-	577,085.51	0.26	404.01	0.30	-
信达国际 证券有限 公司 CINDA INTERNATI ONAL SECURITIE S LIMITED	-	42,095.49	0.02	84.19	0.06	-
中国银河 证券股份 有限公司 China Galaxy Internati onal Financial s Holdings	-	-	-	-	-	-

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

## 2. 交易单元的选择标准和程序

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

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

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		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 (%)
瑞银集团 Union Bank of Switzerland	-	-	-	-	-	-	-2,019,002.95	56.34
中信证券股份 有限公司 Citic Securities Company Limited	28,143,102.20	100.00	-	-	-	-	-	-
华兴证券有限 公司 China Renaissance Security	-	-	-	-	-	-	-1,113,357.65	31.07
瑞士信贷（香 港）有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	375,349.24	10.47
摩根大通证券 （亚太）有限公 司 J.P.Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
花旗环球金融 亚洲有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited	-	-	-	-	-	-	75,609.99	2.11
极讯欧洲有限 公司 Instinet Europe Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券（香 港）有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-

China Merchants Securities (HK) Co., Ltd.								
中国国际金融香港证券有限公司 China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited								
野村证券 NOMURA								
信达国际证券有限公司 CINDA INTERNATIONAL SECURITIES LIMITED								
中国银河证券股份有限公司 China Galaxy International Financials Holdings								

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）开放日常申购、赎回及定投业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 2 月 18 日
2	关于嘉实全球价值股票（QDII）2022 年 4 月 15 日、4 月 18 日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 4 月 13 日
3	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 5 月 12 日
4	关于嘉实全球价值股票（QDII）2022 年 5 月 30 日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 5 月 26 日
5	关于嘉实全球价值股票（QDII）2022 年 6 月 2 日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 5 月 31 日

6	关于嘉实全球价值股票（QDII）2022 年 6 月 20 日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 6 月 16 日
7	关于嘉实全球价值股票（QDII）2022 年 7 月 4 日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 6 月 30 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 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。

### 11.2 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

### 11.3 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

2022 年 8 月 29 日