

嘉实全球价值机会股票型证券投资基金
(QDII)
2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 03 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	11
3.4 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	17
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	22

7.4 报表附注.....	24
§8 投资组合报告	52
8.1 期末基金资产组合情况.....	52
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	52
8.3 期末按行业分类的权益投资组合	53
8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	53
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动	120
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	122
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	123
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	123
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	123
8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	123
8.11 投资组合报告附注.....	124
§9 基金份额持有人信息.....	125
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	125
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	125
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	125
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况.....	126
§10 开放式基金份额变动.....	126
§11 重大事件揭示.....	126
11.1 基金份额持有人大会决议.....	126
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	126
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	127
11.4 基金投资策略的改变.....	127
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	127
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	127
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	127
11.8 其他重大事件.....	135
§12 备查文件目录.....	136
12.1 备查文件目录.....	136
12.2 存放地点.....	136
12.3 查阅方式.....	137

§ 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	142,010,550.41 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	141,882,529.07 份	128,021.34 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	郭松	任航
	联系电话	(010)65215588	010-66060069
	电子邮箱	service@jsfund.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-600-8800	95599
传真		(010)65215588	010-68121816

注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 1806A 单元	北京东城区建国门内大街 69 号
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100020	100031
法定代表人	经雷	谷澍

2.4 境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	JP Morgan Chase Bank, National Association
	中文	摩根大通银行
注册地址		1111 Polaris Parkway, Columbus, OH 43240, U. S. A.
办公地址		383 Madison Avenue, New York, NY 10179-0001, U. S. A.
邮政编码		10179

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金年度报告备置地点	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 19 层
注册登记机构	嘉实基金管理有限公司	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2024 年 1 月 1 日 - 2024 年 12 月 31 日）		报告期（2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 12 月 31 日）		报告期（2022 年 1 月 1 日 - 2022 年 12 月 31 日）	
	嘉实全球价值股票（QDII）人民币	嘉实全球价值股票（QDII）美元现汇	嘉实全球价值股票（QDII）人民币	嘉实全球价值股票（QDII）美元现汇	嘉实全球价值股票（QDII）人民币	嘉实全球价值股票（QDII）美元现汇
本期	21,366,942.9	158,994.64	-1,778,233.0	-27,666.32	-27,755,809.	-297,002.6

已实现收益	3		5		47	9
本期利润	28,802,771.29	267,296.87	28,474,520.73	311,566.93	-32,580,044.67	-332,023.56
加权平均基金份额本期利润	0.2125	1.5190	0.1601	0.9546	-0.1555	-0.9825
本期加权平均净值利润率	18.64%	21.10%	17.24%	16.20%	-17.45%	-17.33%
本期基金份额净值增长率	22.23%	20.38%	19.62%	17.69%	-14.78%	-21.94%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
期末可供分配利润	2,457,050.74	14,221.26	-23,537,519.33	-234,149.39	-29,137,654.80	-441,273.95
期末可供分配基金份额利润	0.0173	0.1111	-0.1467	-0.9385	-0.1548	-0.9899
期末基金资产净值	175,329,527.73	1,012,150.58	162,255,492.12	1,614,511.38	159,142,205.38	2,410,339.23
期末基金份额	1.2357	1.0998	1.0110	0.9136	0.8452	0.7763

净值						
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
基金份额累计净值增长率	23.57%	9.98%	1.10%	-8.64%	-15.48%	-22.37%

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

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

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

（4）嘉实全球价值股票（QDII）美元现汇的期末基金份额净值为美元。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实全球价值股票（QDII）人民币

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	3.10%	0.78%	-1.17%	0.57%	4.27%	0.21%
过去六个月	6.08%	0.97%	6.68%	0.69%	-0.60%	0.28%
过去一年	22.23%	0.87%	15.16%	0.61%	7.07%	0.26%
过去三年	24.59%	0.87%	4.89%	0.74%	19.70%	0.13%
自基金合同生效起至今	23.57%	0.86%	5.49%	0.74%	18.08%	0.12%

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	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①－③	②－④
----	----------	------------	-----------	--------------	-----	-----

		②	率③	准差④		
过去三个月	0.53%	0.73%	-1.17%	0.57%	1.70%	0.16%
过去六个月	5.11%	0.95%	6.68%	0.69%	-1.57%	0.26%
过去一年	20.38%	0.86%	15.16%	0.61%	5.22%	0.25%
过去三年	10.59%	0.87%	4.89%	0.74%	5.70%	0.13%
自基金合同生效 起至今	9.98%	0.86%	5.49%	0.74%	4.49%	0.12%

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

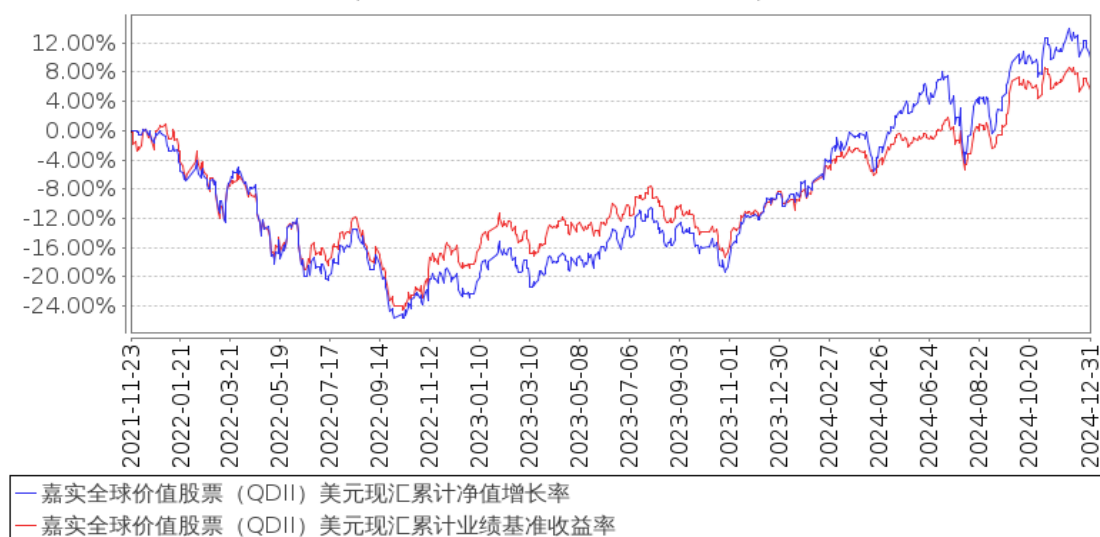
嘉实全球价值股票（QDII）人民币累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2021年11月23日至2024年12月31日)



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

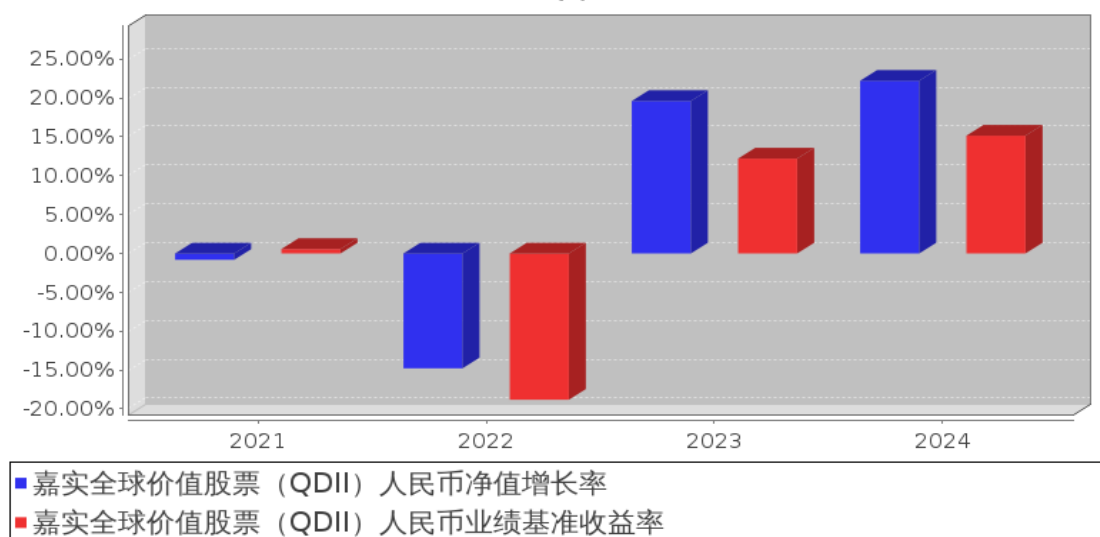
(2021年11月23日至2024年12月31日)



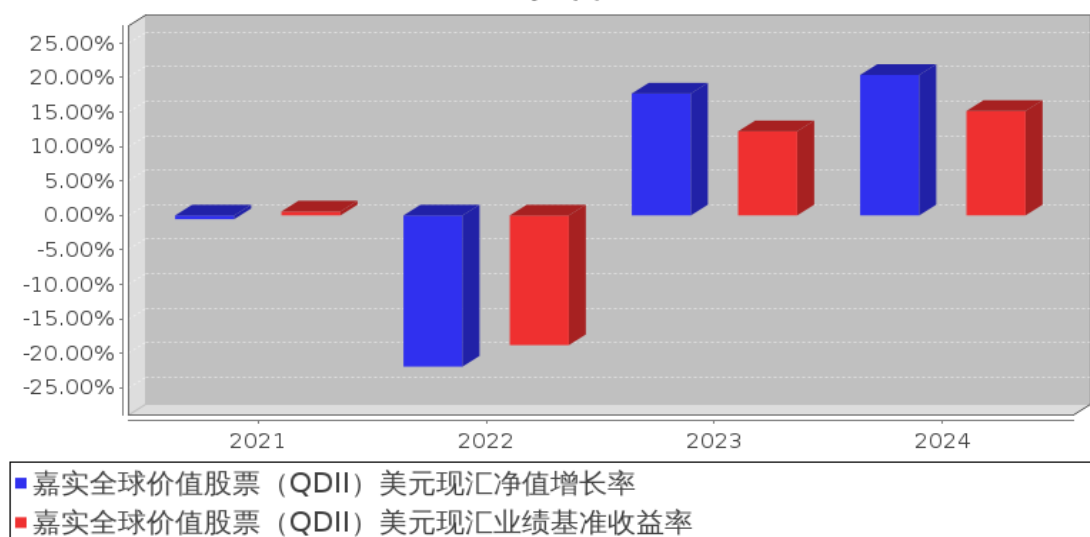
注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

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

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



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



注：上述数据根据基金当年实际存续期计算。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5 号文批准，于 1999 年 3 月 25 日成立。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 2024 年 12 月 31 日，基金管理人共管理 355 只公募基金，覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF、基础设施基金等不同类别。同时，还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张自	本基金、	2021 年	-	28 年	曾任美国世纪投资管理公司（American

力	嘉实美国 成长股票 （QDII） 基金经理	11 月 23 日			Century Investments）资深副总经理，研究部总监暨基金经理，负责直接管理、支持公司旗下近二百亿美元的多项大型公募基金和对冲基金类产品。2012 年 2 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任定量投资部负责人、人工智能投资部负责人，现任股票投研人工智能投资总监，博士后科研工作站导师。博士研究生，毕业于美国德州大学奥斯汀分校和中国科学技术大学，具有基金从业资格。美国国籍。
张楠	本基金基 金经理	2024 年 12 月 3 日	-	12 年	2012 年 1 月加入嘉实基金管理有限公司从事投资模型研究和投资组合管理工作，现任基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

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

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

公司严格执行《公平交易管理制度》，各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部门集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格

遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的，合计 11 次，均为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本组合面向全球资本市场投资，对应的基准指数覆盖了包括 A 股在内的多地市场。报告期内，本组合面向产品基准的目标比例完成各类资产配置，并保持相关的资产配置处于稳定水平，保持了充足的境内资产比例和流动性资产比例。

2024 全年，全球主要资本市场整体呈现积极上涨的态势。基准指数收涨，MSCI 全球指数涨幅超 15%。组合最大权重地域美股市场继续上行，道指上涨 12.88%，标普 500 上涨 23.31%，大盘成长风格和科技板块较强，纳指上涨 24.88%，罗素 1000 成长指数上涨 32.46%。第二权重地域中国市场表现积极，沪深 300 指数全年上涨 14.68%，上半年波动并持平获得正涨幅，下半年 A 股情绪向好，涨幅显著。

报告期内，对全球资本市场影响较重大的经济事件，主要是中美两国货币与金融监管领域的重大事件，包括中国央行联合证监会等监管机构推出提振资本市场的重大政策方向与举措，美联储在下半年进行了降息措施。

就美股而言，全年表现出较为明显的结构性特征，大盘占优、成长占优。市值维度上，大盘指数罗素 1000 上涨 22.84%，大幅领先小盘指数罗素 2000 的 10.02%，大盘之内的风格维度上，罗

素 1000 成长上涨 32.46%，也大幅领先罗素 1000 价值的 11.94%。美股市场内的结构性特征，受到诸多因素推动，疫情后持续多个季度的较强劲的企业盈利增长，对整体市场尤其是成长板块和龙头股的上行起到了推动作用并消化估值、AI 产业趋势继续对科技成长风格以及核心龙头股票的催化、宏观经济指标对美联储货币政策施展空间及投资者预期的推动。相比于美联储加息期间价值风格的走强而言，报告期内成长风格显著占优。美股市场在科技龙头的较强势表现之外，有逐步向扩散性上行趋势发展的趋势，预计随着诸如美联储降息预期升温而进一步催化，其背后是企业盈利的坚实基本面，随着盈利增厚，美股整体估值并未明显抬升到高估水平。由于一季度大面积的业绩持续超预期，美股也远未达到泡沫化水平，三季度期间受大选、飓风影响，企业经营决策在期间有所延迟，盈利回到龙头股拉动的结构。在货币政策转向后，美股经济预估没有深度衰退的风险，在此背景下估值扩张会是另一个整体上涨的驱动力，市场将有更广泛的 ALPHA 机会，从历史规律来看，加息转入降息通道后，对利率更为敏感的资产往往表现领先。下半年，美联储已经进入降息周期，预期未来随着通胀处于高位平台并不再上行、美国就业数据保持稳定、经济增长稳健、企业投资开支增加等多重因素，权益类资产、成长风格以及新兴科技等领域都会有更乐观的预期。

就中国 A 股而言，报告期内，A 股市场在上半年保持平稳窄幅震荡，在下半年显著上行，整体态势积极。下半年 4 月份新的《国九条》，进一步推动中国资本市场进入高质量发展阶段，供给侧提高上市公司质量，需求侧推动长期资金入市，行为侧加权机构和交易监管。下半年 9 月份央行证监会等机构对资本市场的导向与新政策措施的提出，引导市场积极上行。本组合在实际管理过程中，根据宏观经济形式与政策导向的变化进行组合积极优化，避免追逐市场短期热点主题或板块，在 A 股部分采取了控制实际敞口、控制估值等方式规避市场波动，在适当的持仓分散性下以较强的盈利能力、较好的流动性、与产业发展匹配的适当的估值水平为核心要素进行筛选。

欧股以及发达市场部分，本组合继续侧重于在传统发达国家各自的优势产业上进行配置，实现在全球范围内覆盖各地的强势优势行业。如大工业制造领域内的德国汽车、德国法国的电气化与半导体，以及环保制造业、工业配套服务，日本的精细工业如光学等。此外，部分高端消费品牌也发布了较强的盈利披露信息，也在组合覆盖的范围之内。在国别上，进一步增加国别覆盖，对部分未和我国证监会建立证券备忘录的资本市场如芬兰，采用存托凭证等方式进行配置，以更加严格的实现基金合同内业绩基准指数所界定的投资范围。

新兴市场部分，本组合优化新兴市场头寸结构，控制具体标的的风险，紧密跟踪部分领域受到国际间政治干扰的情况、资源商品价格趋势以及美联储货币政策变化对新兴市场国家的影响。本报告期内保持港股仓位不变。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、乌克兰、以色列等资本市场，不持有与俄乌冲突相关的新兴市场上市公司股票、不持有潜在可能受中东局势影响的上市公司股票。

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，对本报告期内表现较弱的国内资产本组合将继续保持配置。对受限的地域或交易所，本组合通过存托凭证等方式进行敞口建立。

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，报告期内实现了流动性的稳健管理。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实全球价值股票（QDII）人民币基金份额净值为 1.2357 元，本报告期基金份额净值增长率为 22.23%；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 1.0998 美元，本报告期基金份额净值增长率为 20.38%；业绩比较基准收益率为 15.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在当前时点，随着美国经济增速保持稳健、通胀压力逐步受到控制，美联储已在 2024 年进入降息通道，预期美联储在 2025 年中继续执行降息操作，大选落地政治风向不确定性结束，企业资本开支可能从去年 3、4 季度的收缩过程中逐步回暖，而美国新总统履新后，其产业政策、国际贸易等措施还在逐步展开，既需要控制相关的关税、贸易摩擦带来的企业盈利受损，也需要针对新的减税、政府财政支出等利好信息进行积极跟踪。

在此宏观背景下，以及当前新兴科技尤其是人工智能领域的持续突破，我们除使用企业盈利增速等成长性指标外，还将继续结合创新能力、新科技下的成长空间，进一步对静态企业估值水平进行修正，以更精细的企业价值测算方式，挖掘个股投资机会。

相对美股而言，国内资本市场经历了成长风格的持续调整后，在 2024 年上半年成长、情绪与预期类特征有所向稳，市值维度波动较大，A 股的趋势在一定程度上释放了部分估值空间，A 股在全球各资本市场中的估值水平优势更加凸显，下半年的市场上行，进一步提振了投资者的积极情

绪。在实体经济层面，结合积极的政策意愿，实体经济在中长期的预期有望逐步稳定向好。对欧股、日股等发达资本市场，本组合侧重于在传统发达国家各自的优势产业上进行配置，实现在全球范围内覆盖各地的强势优势行业。对新兴市场部分，本组合将在监控全球产业链结构性调整、资源商品价格趋势以及美联储货币政策动向对新兴市场国家的影响后再积极调整新兴市场头寸和结构。在 H 股内，本组合贯彻“价值+机会”的两层逻辑。

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

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人有关监察稽核工作情况如下：

（1）继续内控前置。在基金营销、投资交易、信息披露以及新产品设计开发、海外业务、另类业务、制度建设、合同管理、法律咨询等方面，事前进行合规性审核、监控。全力支持新业务开展，对新产品、新投资工具等进行合规性判断。在制度流程、投资范围、投资工具、运作规则等方面，防控重大风险。

（2）全流程动态开展投资交易监督。一是事前防范，主要从事前研讨，合规风险识别、评估和分析，IT 事前设置，建立禁限库，合规培训、承诺书等方面开展；二是事中实时监控，如实时回答组合经理、交易员投资交易事项，盘中实时监控等；三是事后检查及改进，如检查投资交易合规情况，对异常行为进行提示、处理建议并督促改正。优化和升级合规风控系统，不断提高自动化监控能力，保障各类组合合规运作，保护投资者利益。

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

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

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

此外，我们还积极配合监管，按时完成合规报告和各项统计报表以及专题报告。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照《企业会计准则》及中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于基金资产估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求，履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，

研究、指导基金估值业务。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，具备投研、风险管理、基金估值运作、法律合规等方面的专业胜任能力。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制，与估值相关的机构包括基金投资市场的证券交易场所以及境内相关机构等。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2025）审字第 70022036_A77 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII），并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行

	清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）的财务报告过程。	
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	贺耀	马剑英
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室	
审计报告日期	2025 年 03 月 26 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	2,846,045.36	2,649,780.09
结算备付金		203,019.43	141,300.59
存出保证金		8,238.38	9,580.05
交易性金融资产	7.4.7.2	174,428,972.68	163,294,244.67
其中：股票投资		162,383,994.88	153,854,776.01
基金投资		438,210.19	1,498,128.93
债券投资		11,606,767.61	7,941,339.73
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		23,839.99	2,494,788.42
应收股利		84,169.49	75,430.39
应收申购款		639,043.85	362,676.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	183,248.32	-
资产总计		178,416,577.50	169,027,800.61
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		118,305.52	0.49
应付赎回款		1,232,596.93	4,627,213.75
应付管理人报酬		266,338.60	257,293.38
应付托管费		51,788.05	50,029.26
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,397.51	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	404,472.58	223,260.23
负债合计		2,074,899.19	5,157,797.11
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	142,701,594.10	162,083,274.63
未分配利润	7.4.7.12	33,640,084.21	1,786,728.87
净资产合计		176,341,678.31	163,870,003.50
负债和净资产总计		178,416,577.50	169,027,800.61

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，嘉实全球价值股票（QDII）人民币基金份额净值 1.2357 元，基金份额总额 141,882,529.07 份，嘉实全球价值股票（QDII）美元现汇基金份额净值 1.0998 美元，基金份额总额 128,021.34 份，基金份额总额合计为 142,010,550.41 份。

7.2 利润表

会计主体：嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		32,585,581.24	32,569,031.48
1. 利息收入		34,728.47	28,954.18
其中：存款利息收入	7.4.7.13	34,728.47	28,954.18
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		24,940,944.20	1,990,711.55
其中：股票投资收益	7.4.7.14	22,567,900.67	-906,043.16
基金投资收益	7.4.7.15	25,327.43	-89,123.65
债券投资收益	7.4.7.16	202,303.38	133,938.65
资产支持证券投资	7.4.7.17	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.18	-	-
衍生工具收益	7.4.7.19	-	170,247.95
股利收益	7.4.7.20	2,145,412.72	2,681,691.76
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	7,544,130.59	30,591,987.03

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-121,512.56	-93,601.49
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.22	187,290.54	50,980.21
减：二、营业总支出		3,515,513.08	3,782,943.82
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,799,886.07	3,006,443.12
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	544,422.36	584,586.20
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		414.54	348.77
8. 其他费用	7.4.7.24	170,790.11	191,565.73
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		29,070,068.16	28,786,087.66
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		29,070,068.16	28,786,087.66
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		29,070,068.16	28,786,087.66

7.3 净资产变动表

会计主体：嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	162,083,274.63	-	1,786,728.87	163,870,003.50
二、本期期初净资产	162,083,274.63	-	1,786,728.87	163,870,003.50
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-19,381,680.53	-	31,853,355.34	12,471,674.81
（一）、综合收益总额	-	-	29,070,068.16	29,070,068.16
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数	-19,381,680.53	-	2,783,287.18	-16,598,393.35

（净资产减少以“-”号填列）				
其中：1. 基金申购款	97,653,027.56	-	15,844,014.16	113,497,041.72
2. 基金赎回款	-117,034,708.09	-	-13,060,726.98	-130,095,435.07
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	142,701,594.10	-	33,640,084.21	176,341,678.31
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	191,131,473.36	-	-29,578,928.75	161,552,544.61
二、本期期初净资产	191,131,473.36	-	-29,578,928.75	161,552,544.61
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-29,048,198.73	-	31,365,657.62	2,317,458.89
（一）、综合收益总额	-	-	28,786,087.66	28,786,087.66
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-29,048,198.73	-	2,579,569.96	-26,468,628.77
其中：1. 基金申购款	29,972,161.56	-	-589,199.19	29,382,962.37
2. 基金赎回款	-59,020,360.29	-	3,168,769.15	-55,851,591.14
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	162,083,274.63	-	1,786,728.87	163,870,003.50

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>经雷</u>	<u>梁凯</u>	<u>李袁</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

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

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

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

(2) 金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

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

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

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

实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

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

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

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

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

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

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要

意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

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

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直

线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

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

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

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

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

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

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

7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》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附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳；

基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税；

基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	2,846,045.36	2,649,780.09
等于：本金	2,845,422.89	2,649,204.10
加：应计利息	622.47	575.99
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	2,846,045.36	2,649,780.09

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	130,095,689.05	-	162,383,994.88	32,288,305.83
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	11,514,051.18	76,447.61	11,606,767.61	16,268.82
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	11,514,051.18	76,447.61	11,606,767.61	16,268.82
资产支持证券		-	-	-	-
基金		324,390.70	-	438,210.19	113,819.49
其他		-	-	-	-
合计		141,934,130.93	76,447.61	174,428,972.68	32,418,394.14
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日				
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		129,138,697.52	-	153,854,776.01	24,716,078.49
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	7,878,846.76	57,139.73	7,941,339.73	5,353.24
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	7,878,846.76	57,139.73	7,941,339.73	5,353.24
资产支持证券		-	-	-	-
基金		1,345,297.11	-	1,498,128.93	152,831.82
其他		-	-	-	-
合计		138,362,841.39	57,139.73	163,294,244.67	24,874,263.55

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应收利息	-	-
其他应收款	183,248.32	-
待摊费用	-	-
合计	183,248.32	-

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	2,302.97	763.36
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	36,388.51	62,496.87
其中：交易所市场	36,388.51	62,496.87
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	183,000.00	160,000.00
其他应付款	182,781.10	-

合计	404,472.58	223,260.23
----	------------	------------

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实全球价值股票（QDII）人民币

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	160,486,513.62	160,486,513.62
本期申购	96,922,824.74	96,922,824.74
本期赎回（以“-”号填列）	-115,526,809.29	-115,526,809.29
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	141,882,529.07	141,882,529.07

嘉实全球价值股票（QDII）美元现汇

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	249,499.68	1,596,761.01
本期申购	114,101.65	730,202.82
本期赎回（以“-”号填列）	-235,579.99	-1,507,898.80
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	128,021.34	819,065.03

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

嘉实全球价值股票（QDII）人民币

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-23,537,519.33	25,306,497.83	1,768,978.50
本期期初	-23,537,519.33	25,306,497.83	1,768,978.50
本期利润	21,366,942.93	7,435,828.36	28,802,771.29
本期基金份额交易产生的变动数	4,627,627.14	-1,752,378.27	2,875,248.87
其中：基金申购款	-8,020,745.32	23,720,160.05	15,699,414.73
基金赎回款	12,648,372.46	-25,472,538.32	-12,824,165.86

本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,457,050.74	30,989,947.92	33,446,998.66

嘉实全球价值股票（QDII）美元现汇

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-234,149.39	251,899.76	17,750.37
本期期初	-234,149.39	251,899.76	17,750.37
本期利润	158,994.64	108,302.23	267,296.87
本期基金份额交易产生的变动数	89,376.01	-181,337.70	-91,961.69
其中：基金申购款	-40,231.86	184,831.29	144,599.43
基金赎回款	129,607.87	-366,168.99	-236,561.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,221.26	178,864.29	193,085.55

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
活期存款利息收入	32,167.43	25,710.01
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	1,944.67	3,009.54
其他	616.37	234.63
合计	34,728.47	28,954.18

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	22,567,900.67	-906,043.16
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	22,567,900.67	-906,043.16

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	330,682,311.83	344,575,333.46
减：卖出股票成本总额	307,640,633.91	344,855,759.20
减：交易费用	473,777.25	625,617.42
买卖股票差价收入	22,567,900.67	-906,043.16

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出/赎回基金成交总额	2,001,367.72	2,644,131.72
减：卖出/赎回基金成本总额	1,972,839.98	2,732,382.58
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	830.92	-1,895.29
减：交易费用	2,369.39	2,768.08
基金投资收益	25,327.43	-89,123.65

7.4.7.16 债券投资收益

7.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	193,902.26	181,120.46
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	8,401.12	-47,181.81
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	202,303.38	133,938.65
----	------------	------------

7.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	30,320,944.00	17,935,422.47
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	29,916,544.88	17,660,799.85
减：应计利息总额	395,998.00	321,804.43
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	8,401.12	-47,181.81

7.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.17 资产支持证券投资收益

7.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.18 贵金属投资收益

7.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.19 衍生工具收益

7.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	-	170,247.95

7.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	2,140,187.01	2,663,467.47
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	5,225.71	18,224.29
合计	2,145,412.72	2,681,691.76

7.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	7,544,130.59	30,619,827.03
股票投资	7,572,227.34	30,352,897.24
债券投资	10,915.58	37,964.85
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-39,012.33	228,964.94
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-27,840.00
权证投资	-	-
期货投资	-	-27,840.00
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	7,544,130.59	30,591,987.03
----	--------------	---------------

7.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	187,069.73	50,800.90
其他	220.81	179.31
合计	187,290.54	50,980.21

7.4.7.23 信用减值损失

无。

7.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	23,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	5,763.44	6,098.00
债券托管账户维护费	18,000.00	18,000.00
其他	3,839.79	7,265.36
证券组合费	186.88	202.37
合计	170,790.11	191,565.73

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

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

嘉实资本管理有限公司（“嘉实资本”）	基金管理人的控股子公司
嘉实财富管理有限公司（“嘉实财富”）	基金管理人的控股子公司

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 基金交易

无。

7.4.10.1.5 权证交易

无。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,799,886.07	3,006,443.12
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,095,084.76	1,330,734.18
应支付基金管理人的净管理费	1,704,801.31	1,675,708.94

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.80%/当年天数。

2. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	544,422.36	584,586.20

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.35% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.35% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司_活期	2,599,661.41	32,167.43	1,979,031.05	25,710.01
摩根大通银行_活期	246,383.95	-	670,749.04	-

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本期（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日），本基金未实施利润分配。

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

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

围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，持有境外基金的市值合计不超过基金资产净值的 10%（持有货币市场基金可以不受前述限制），且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的 20%。

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	—	—
AAA 以下	11,606,767.61	7,941,339.73
未评级	—	—
合计	11,606,767.61	7,941,339.73

注：评级取自第三方评级机构。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一

方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,846,045.36	-	-	-	2,846,045.36
结算备付金	203,019.43	-	-	-	203,019.43
存出保证金	8,238.38	-	-	-	8,238.38
交易性金融资产	11,606,767.61	-	-	162,822,205.07	174,428,972.68
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	23,839.99	23,839.99
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	84,169.49	84,169.49
应收申购款	-	-	-	639,043.85	639,043.85
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	183,248.32	183,248.32
资产总计	14,664,070.78	-	-	163,752,506.72	178,416,577.50
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	118,305.52	118,305.52
应付赎回款	-	-	-	1,232,596.93	1,232,596.93
应付管理人报酬	-	-	-	266,338.60	266,338.60
应付托管费	-	-	-	51,788.05	51,788.05
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1,397.51	1,397.51
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	404,472.58	404,472.58
负债总计	-	-	-	2,074,899.19	2,074,899.19
利率敏感度缺口	14,664,070.78	-	-	161,677,607.53	176,341,678.31
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,649,780.09	-	-	-	2,649,780.09
结算备付金	141,300.59	-	-	-	141,300.59
存出保证金	9,580.05	-	-	-	9,580.05
交易性金融资产	7,941,339.73	-	-	155,352,904.94	163,294,244.67
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-

应收清算款	-	-	-	2,494,788.42	2,494,788.42
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	75,430.39	75,430.39
应收申购款	-	-	-	362,676.40	362,676.40
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	10,742,000.46	-	-	158,285,800.15	169,027,800.61
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	0.49	0.49
应付赎回款	-	-	-	4,627,213.75	4,627,213.75
应付管理人报酬	-	-	-	257,293.38	257,293.38
应付托管费	-	-	-	50,029.26	50,029.26
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	223,260.23	223,260.23
负债总计	-	-	-	5,157,797.11	5,157,797.11
利率敏感度缺口	10,742,000.46	-	-	-153,128,003.04	163,870,003.50

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-16,656.31	-11,171.60
	市场利率下降 25 个基点	16,713.23	11,203.12

7.4.13.4.2 外汇风险

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

金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	408,682.69	—	3,884.28	412,566.97
结算备付金	—	—	—	—
存出保证金	—	—	—	—
交易性金融资产	109,808,566.25	8,237,691.61	20,128,213.31	138,174,471.17
衍生金融资产	—	—	—	—
债权投资	—	—	—	—
应收股利	32,901.38	21,697.11	12,706.28	67,304.77
应收申购款	5,024.55	—	—	5,024.55
应收清算款	—	—	23,839.99	23,839.99
其他资产	—	95,412.41	87,835.91	183,248.32
资产合计	110,255,174.87	8,354,801.13	20,256,479.77	138,866,455.77
以外币计价的负债				
应付清算款	22,891.46	95,412.41	—	118,303.87
衍生金融负债	—	—	—	—
应付赎回款	73,083.67	—	—	73,083.67
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	182,872.90	-	-	182,872.90
负债合计	278,848.03	95,412.41	-	374,260.44
资产负债表外 汇风险敞口净额	109,976,326.84	8,259,388.72	20,256,479.77	138,492,195.33
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	722,339.93	-	25,306.41	747,646.34
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	92,728,654.02	7,146,211.73	28,846,192.19	128,721,057.94
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	53,047.57	-	20,862.82	73,910.39
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	2,313,823.96	-	180,964.46	2,494,788.42
其他资产	-	-	-	-
资产合计	95,817,865.48	7,146,211.73	29,073,325.88	132,037,403.09
以外币计价的				

负债				
应付清算款	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	95,817,865.48	7,146,211.73	29,073,325.88	132,037,403.09

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	所有外币相对人民币升值 5%	6,924,609.77	6,601,870.15
	所有外币相对人民币贬值 5%	-6,924,609.77	-6,601,870.15

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	162,383,994.88	92.08	153,854,776.01	93.89
交易性金融资产—基金投资	438,210.19	0.25	1,498,128.93	0.91
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	162,822,205.07	92.33	155,352,904.94	94.80

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	11,173,100.40	8,591,088.21
	业绩比较基准下降 5%	-11,173,100.40	-8,591,088.21

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	162,822,205.07	155,352,904.94
第二层次	11,606,767.61	7,941,339.73
第三层次	—	—
合计	174,428,972.68	163,294,244.67

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、新发未上市、涨跌停等导致的交易不活跃）或非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

无。

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

无。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	162,383,994.88	91.01
	其中：普通股	157,626,649.37	88.35
	存托凭证	4,530,168.56	2.54
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	227,176.95	0.13
2	基金投资	438,210.19	0.25
3	固定收益投资	11,606,767.61	6.51
	其中：债券	11,606,767.61	6.51
	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	3,049,064.79	1.71
8	其他各项资产	938,540.03	0.53
9	合计	178,416,577.50	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 1,862,238.66 元，占基金资产净值的比例为 1.06%。

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
美国	109,095,285.46	61.87
中国	24,647,733.90	13.98
中国香港	8,237,691.61	4.67
日本	5,334,841.59	3.03
英国	3,728,623.39	2.11
德国	2,639,331.48	1.50
加拿大	1,933,490.30	1.10
法国	1,525,785.69	0.87
瑞士	1,328,719.96	0.75
意大利	693,136.01	0.39
荷兰	533,290.00	0.30

瑞典	494,309.29	0.28
挪威	450,427.90	0.26
新加坡	432,512.75	0.25
澳大利亚	422,346.20	0.24
丹麦	336,112.53	0.19
比利时	242,964.21	0.14
奥地利	171,511.61	0.10
新西兰	88,698.70	0.05
爱尔兰	46,409.56	0.03
西班牙	772.74	0.00
合计	162,383,994.88	92.08

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
信息技术	48,406,063.60	27.45
工业	22,117,683.78	12.54
金融	31,165,760.05	17.67
非必需消费品	18,425,606.40	10.45
通信服务	16,175,400.47	9.17
医疗保健	7,144,266.06	4.05
能源	4,005,249.23	2.27
原材料	4,412,414.81	2.50
必需消费品	7,206,087.84	4.09
公用事业	2,680,700.83	1.52
房地产	644,761.81	0.37
合计	162,383,994.88	92.08

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代 码	所在证 券市场	所属 国家 (地区)	数量 (股)	公允价值	占基 金资 产净 值比 例(%)
1	NVIDIA Corp	英伟达	NVDA UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	8,703	8,401,269.04	4.76
2	Apple Inc	苹果公 司	AAPL UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	3,595	6,471,428.27	3.67
3	Microsoft Corp	微软	MSFT UW	纳斯达克 证券	美国	1,800	5,453,839.08	3.09

				交易所				
4	Amazon. com Inc	亚马逊公司	AMZN UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,150	4,967,748.69	2.82
5	Alphabet Inc	Alphabet 公司	GOOGL UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,187	2,975,991.13	1.69
5	Alphabet Inc	Alphabet 公司	GOOG UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,050	1,437,406.84	0.82
6	Meta Platforms Inc	Meta 平台股份有限公司	META UW	纳斯达克证券交易所	美国	924	3,889,005.20	2.21
7	Broadcom Inc	博通股份有限公司	AVGO UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,501	2,501,504.54	1.42
8	Tesla Inc	特斯拉公司	TSLA UW	纳斯达克证券交易所	美国	809	2,348,497.44	1.33
9	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	台湾集成电路制造股份有限公司	TSM UN	纽约证券交易所	美国	1,585	2,250,124.83	1.28
10	Walmart Inc	沃尔玛股份有限公司	WMT UN	纽约证券交易所	美国	2,605	1,691,874.40	0.96
11	Berkshire Hathaway Inc	伯克希尔哈撒韦公司	BRK/B UN	纽约证券交易所	美国	489	1,593,337.04	0.90
12	JPMorgan Chase & Co	摩根大通	JPM UN	纽约证券交易所	美国	848	1,461,215.40	0.83
13	Netflix Inc	奈飞公司	NFLX UW	纳斯达克证券交易所	美国	220	1,409,576.23	0.80
14	PetroChina Co Ltd	中国石油天然气股份有限公司	857 HK	香港证券交易所	中国香港	136,000	769,502.20	0.44
14	PetroChina	中国石化	601857	上海证	中国	39,600	354,024.00	0.20

	a Co Ltd	油天然气股份有限公司	CH	券交易所				
15	China Construct ion Bank Corp	中国建设银行股份有限公司	939 HK	香港证券交易所	中国香港	143,000	858,105.70	0.49
15	China Construct ion Bank Corp	中国建设银行股份有限公司	601939 CH	上海证券交易所	中国	27,500	241,725.00	0.14
16	Kweichow Moutai Co L td	贵州茅台酒股份有限公司	600519 CH	上海证券交易所	中国	700	1,066,800.00	0.60
17	Palantir Technol ogies Inc	Palantir 科技股份有限公司	PLTR UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,953	1,061,765.43	0.60
18	GE Vernova Inc	通用电气 Vernova 股份有限公司	GEV UN	纽约证券交易所	美国	436	1,030,913.46	0.58
19	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	3,161	1,022,540.70	0.58
20	Eli Lilly & Co	礼来	LLY UN	纽约证券交易所	美国	183	1,015,548.40	0.58
21	Intuitive Surgical Inc	直觉外科手术公司	ISRG UW	纳斯达克证券交易所	美国	266	998,047.23	0.57
22	Costco Wholesale Corp	开市客	COST UW	纳斯达克证券交易所	美国	150	987,977.29	0.56
23	Mastercard Inc	万事达股份有限公司	MA UN	纽约证券交易所	美国	255	965,224.93	0.55
24	SAP SE	SAP 公司	SAP GY	德国证券交易所	德国	291	517,491.97	0.29

24	SAP SE	SAP 公司	SAP UN	纽约证券交易所	美国	249	440,694.14	0.25
25	Rolls-Royce Holdings PLC	罗尔斯·罗伊斯控股公司	RR/ LN	伦敦证券交易所	英国	18,139	936,135.23	0.53
26	ServiceNow Inc	ServiceNow 公司	NOW UN	纽约证券交易所	美国	121	922,088.56	0.52
27	KKR & Co Inc	KKR & Co 有限公司	KKR UN	纽约证券交易所	美国	833	885,675.79	0.50
28	Salesforce Inc	Salesforce 股份有限公司	CRM UN	纽约证券交易所	美国	350	841,154.22	0.48
29	Contemporary Amperex Technology Co Ltd	宁德时代新能源科技股份有限公司	300750 CH	深圳证券交易所	中国	3,100	824,600.00	0.47
30	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	中国平安保险（集团）股份有限公司	601318 CH	上海证券交易所	中国	15,600	821,340.00	0.47
30	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	中国平安保险（集团）股份有限公司	2318 HK	香港证券交易所	中国香港	1,000	42,644.14	0.02
31	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公司	700 HK	香港证券交易所	中国香港	1,500	579,238.02	0.33
31	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公司	TCEHY UV	纽约证券交易所	美国	598	228,602.91	0.13
32	Bank of Communications Co Ltd	交通银行股份有限公司	3328 HK	香港证券交易所	中国香港	83,000	491,143.84	0.28
32	Bank of	交通银	601328	上海证	中国	37,700	292,929.00	0.17

	Communications Co Ltd	行股份有限公司	CH	券交易所				
33	Marvell Technology Inc	美满电子科技有限公司	MRVL UW	纳斯达克证券交易所	美国	958	760,612.51	0.43
34	Siemens Energy AG	西门子能源公司	ENR GY	德国证券交易所	德国	1,975	748,810.91	0.42
35	ABB Ltd	ABB 有限公司	ABBN SE	瑞士证券交易所	瑞士	1,902	746,434.46	0.42
36	AT&T Inc	美国电话电报公司	T UN	纽约证券交易所	美国	4,540	743,106.60	0.42
37	Industrial & Commercial Bank of China Ltd	中国工商银行股份有限公司	601398 CH	上海证券交易所	中国	73,900	511,388.00	0.29
37	Industrial & Commercial Bank of China Ltd	中国工商银行股份有限公司	1398 HK	香港证券交易所	中国香港	39,000	188,162.07	0.11
38	GoDaddy Inc	GoDaddy 股份有限公司	GDDY UN	纽约证券交易所	美国	473	671,080.34	0.38
39	Schneider Electric SE	施耐德电气有限公司	SU FP	巴黎证券交易所	法国	370	670,788.22	0.38
40	CNOOC Ltd	中国海洋石油有限公司	883 HK	香港证券交易所	中国香港	32,000	566,588.31	0.32
40	CNOOC Ltd	中国海洋石油有限公司	600938 CH	上海证券交易所	中国	3,500	103,285.00	0.06
41	Zijin	紫金矿	601899	上海证	中国	32,100	485,352.00	0.28

	Mining Group Co Ltd	业集团股份有限公司	CH	券交易所				
41	Zijin Mining Group Co Ltd	紫金矿业集团股份有限公司	2899 HK	香港证券交易所	中国香港	14,000	183,318.88	0.10
42	Hitachi Ltd	日立	6501 JT	日本证券交易所	日本	3,600	655,269.56	0.37
43	Postal Savings Bank of China Co Ltd	中国邮政储蓄银行股份有限公司	1658 HK	香港证券交易所	中国香港	152,000	644,672.00	0.37
44	Spotify Technology SA	Spotify 科技股份有限公司	SPOT UN	纽约证券交易所	美国	197	633,541.44	0.36
45	Midea Group Co Ltd	美的集团股份有限公司	000333 CH	深圳证券交易所	中国	8,400	631,848.00	0.36
46	Vertiv Holdings Co	维谛技术	VRT UN	纽约证券交易所	美国	769	628,022.40	0.36
47	Visa Inc	维萨公司	V UN	纽约证券交易所	美国	274	622,479.21	0.35
48	AppLovin Corp	AppLovin 公司	APP UW	纳斯达克证券交易所	美国	254	591,266.17	0.34
49	China Shenhua Energy Co Ltd	中国神华能源股份有限公司	601088 CH	上海证券交易所	中国	7,800	339,144.00	0.19
49	China Shenhua Energy Co Ltd	中国神华能源股份有限公司	1088 HK	香港证券交易所	中国香港	8,000	248,919.55	0.14
50	BYD Co Ltd	比亚迪股份有限公司	002594 CH	深圳证券交易所	中国	1,200	339,192.00	0.19
50	BYD Co Ltd	比亚迪	1211 HK	香港证	中国	1,000	246,882.26	0.14

		股份有 限公司		券交易 所	香港			
51	Vistra Corp	Vistra 公司	VST UN	纽约证 券交易 所	美国	578	572,835.40	0.32
52	China Merchants Bank Co Ltd	招商银行股份 有限公司	600036 CH	上海证 券交易 所	中国	13,400	526,620.00	0.30
52	China Merchants Bank Co Ltd	招商银行股份 有限公司	3968 HK	香港证 券交易 所	中 国 香港	500	18,520.80	0.01
53	Eaton Corp PLC	伊顿	ETN UN	纽约证 券交易 所	美国	228	543,920.06	0.31
54	Manulife Financial Corp	宏利金 融	MFC UN	纽约证 券交易 所	美国	1,355	299,124.06	0.17
54	Manulife Financial Corp	宏利金 融	MFC CT	加拿大 证券交 易所	加 拿 大	1,087	242,400.10	0.14
55	Celestica Inc	天弘股 份有限 公司	CLS UN	纽约证 券交易 所	美国	778	516,194.69	0.29
56	Tower Semiconductor Ltd	塔尔半 导体有 限公司	TSEM UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,354	501,351.65	0.28
57	American Express Co	美国运 通	AXP UN	纽约证 券交易 所	美国	226	482,158.62	0.27
58	China Yangtze Power Co Ltd	中国长 江电力 股份有 限公司	600900 CH	上海证 券交易 所	中国	15,800	466,890.00	0.26
59	Fox Corp	福克斯 公司	FOX UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	990	325,509.44	0.18
59	Fox Corp	福克斯 公司	FOXA UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	397	138,637.35	0.08
60	Bank of America Corp	美国银 行公司	BAC UN	纽约证 券交易 所	美国	1,462	461,889.92	0.26

61	Goldman Sachs Group Inc/The	高盛	GS UN	纽约证券交易所	美国	112	461,016.82	0.26
62	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	三菱日联金融集团	8306 JT	日本证券交易所	日本	5,400	460,869.04	0.26
63	Kongsberg Gruppen ASA	Kongsberg Gruppen 公共有限公司	KOG NO	奥斯陆（挪威）证券交易所	挪威	551	450,427.90	0.26
64	Amphenol Corp	安费诺公司	APH UN	纽约证券交易所	美国	892	445,317.07	0.25
65	General Electric Co	通用电气航空航天	GE UN	纽约证券交易所	美国	362	434,021.07	0.25
66	China Unicom Hong Kong Ltd	中国联合网络通信（香港）股份有限公司	762 HK	香港证券交易所	中国香港	60,000	410,606.14	0.23
67	Wells Fargo & Co	富国银行	WFC UN	纽约证券交易所	美国	807	407,464.97	0.23
68	Lululemon Athletica Inc	Lululemon Athletica 股份有限公司	LULU UW	纳斯达克证券交易所	美国	147	404,090.66	0.23
69	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM UW	纳斯达克证券交易所	美国	364	401,958.65	0.23
70	Bank of China Ltd	中国银行股份有限公司	601988 CH	上海证券交易所	中国	37,500	206,625.00	0.12
70	Bank of	中国银	3988 HK	香港证	中国	53,000	194,848.08	0.11

	China Ltd	行股份 有限公司		券交易 所	香港			
71	RTX Corp	RTX 公 司	RTX UN	纽约证 券交易 所	美国	481	400,115.83	0.23
72	Oracle Corp	甲骨文	ORCL UN	纽约证 券交易 所	美国	333	398,892.37	0.23
73	Deckers Outdoor Corp	德克斯 户外用 品公司	DECK UN	纽约证 券交易 所	美国	273	398,550.56	0.23
74	Blackstone Inc	黑石集 团股份 有限公司	BX UN	纽约证 券交易 所	美国	312	386,700.27	0.22
75	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	爱立信	ERICB SS	斯德哥 尔摩证 券交易 所	瑞典	6,453	380,749.45	0.22
76	Shanghai Pudong Development Bank Co Ltd	上海浦 东发展 银行股 份有限 公司	600000 CH	上海证 券交易 所	中国	35,800	368,382.00	0.21
77	China Mobile Ltd	中国移 动有限 公司	600941 CH	上海证 券交易 所	中国	3,100	366,296.00	0.21
78	China Communications Construction Co Ltd	中国交 通建设 股份有 限公司	1800 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	72,000	366,045.09	0.21
79	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	三井住 友金融 集团	8316 JT	日本证 券交易 所	日本	2,100	365,444.13	0.21
80	China Telecom Corp Ltd	中国电 信股份 有限公司	601728 CH	上海证 券交易 所	中国	50,500	364,610.00	0.21
81	Wuliangye	宜宾五	000858	深圳证	中国	2,600	364,104.00	0.21

	Yibin Co Ltd	粮液股份有限公司	CH	券交易所				
82	InterDigital Inc	InterDigital 股份有限公司	IDCC UW	纳斯达克证券交易所	美国	260	362,059.58	0.21
83	Philip Morris International Inc	菲利普莫里斯国际集团公司	PM UN	纽约证券交易所	美国	415	359,026.44	0.20
84	Axon Enterprise Inc	Axon Enterprise 股份有限公司	AXON UW	纳斯达克证券交易所	美国	83	354,593.42	0.20
85	East Money Information Co Ltd	东方财富信息股份有限公司	300059 CH	深圳证券交易所	中国	13,700	353,734.00	0.20
86	Accellero n Industries AG	Accelleron Industries AG	ACLN SE	瑞士证券交易所	瑞士	930	347,348.11	0.20
86	Accellero n Industries AG	Accelleron Industries AG	ACLLY UV	纽约证券交易所	美国	14	5,121.66	0.00
87	GigaDevice Semiconductor Inc	兆易创新科技集团股份有限公司	603986 CH	上海证券交易所	中国	3,300	352,440.00	0.20
88	Sumitomo Corp	住友商事有限公司	8053 JT	日本证券交易所	日本	2,200	348,670.79	0.20
89	Barclays PLC	巴克莱	BARC LN	伦敦证券交易所	英国	14,149	344,367.31	0.20
90	Fiserv Inc	Fiserv 公司	FI UN	纽约证券交易所	美国	231	341,104.10	0.19
91	Deutsche Telekom AG	德国电信	DTE GY	德国证券交易所	德国	1,566	340,475.76	0.19

92	Novo Nordisk A/S	诺和诺德公司	NOVOB DC	哥本哈根交易所	丹麦	534	336,112.53	0.19
93	NARI Technology Co Ltd	国电南瑞科技股份有限公司	600406 CH	上海证券交易所	中国	13,300	335,426.00	0.19
94	Trip.com Group Ltd	携程集团有限公司	TCOM UW	纳斯达克证券交易所	美国	577	284,781.55	0.16
94	Trip.com Group Ltd	携程集团有限公司	9961 HK	香港证券交易所	中国香港	100	50,006.16	0.03
95	Arista Networks Inc	Arista 网络股份有限公司	ANET UN	纽约证券交易所	美国	420	333,704.22	0.19
96	Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd	内蒙古伊利实业集团股份有限公司	600887 CH	上海证券交易所	中国	10,900	328,962.00	0.19
97	Progressive Corp/The	前进保险公司	PGR UN	纽约证券交易所	美国	189	325,535.97	0.18
98	SF Holding Co Ltd	顺丰控股股份有限公司	002352 CH	深圳证券交易所	中国	8,022	323,286.60	0.18
99	China CITIC Bank Corp Ltd	中信银行股份有限公司	998 HK	香港证券交易所	中国香港	65,000	323,234.26	0.18
100	Motorola Solutions Inc	摩托罗拉解决方案股份有限公司	MSI UN	纽约证券交易所	美国	97	322,301.33	0.18
101	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	524	321,489.69	0.18
102	Twilio Inc	Twilio 股份有	TWLO UN	纽约证券交易	美国	411	319,315.05	0.18

		限公司		所				
10 3	Sony Group Corp	索尼集团公司	SONY UN	纽约证券交易所	美国	2,097	318,967.42	0.18
10 4	Carpenter Technology Corp	卡朋特科技公司	CRS UN	纽约证券交易所	美国	261	318,405.22	0.18
10 5	Caterpillar Inc	卡特彼勒	CAT UN	纽约证券交易所	美国	122	318,135.01	0.18
10 6	Chubb Ltd	邱博保险集团	CB UN	纽约证券交易所	美国	160	317,784.79	0.18
10 7	NEC Corp	日本电气 (NEC) 株式会社	6701 JT	日本证券交易所	日本	500	317,158.38	0.18
10 8	Royal Caribbean Cruises Ltd	皇家加勒比国际游轮有限公司	RCL UN	纽约证券交易所	美国	191	316,733.77	0.18
10 9	Sany Heavy Industry Co Ltd	三一重工股份有限公司	600031 CH	上海证券交易所	中国	19,100	314,768.00	0.18
11 0	Blackrock Inc	贝莱德股份有限公司	BLK UN	纽约证券交易所	美国	42	309,493.83	0.18
11 1	Huagong Tech Co Ltd	华工科技产业股份有限公司	000988 CH	深圳证券交易所	中国	7,100	307,430.00	0.17
11 2	International Business Machines Corp	国际商业机器公司	IBM UN	纽约证券交易所	美国	194	306,563.84	0.17
11 3	Plexus Corp	Plexus 有限公司	PLXS UW	纳斯达克证券交易所	美国	269	302,582.18	0.17
11	NatWest	国民西	NWG LN	伦敦证	英国	8,281	302,228.39	0.17

4	Group PLC	敏寺银行集团公共有限公司		券交易所				
115	NRG Energy Inc	NRG 能源股份有限公司	NRG UN	纽约证券交易所	美国	465	301,569.91	0.17
116	Weichai Power Co Ltd	潍柴动力股份有限公司	000338 CH	深圳证券交易所	中国	21,900	300,030.00	0.17
117	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	三菱重工	7011 JT	日本证券交易所	日本	2,900	298,050.28	0.17
118	Focus Media Information Technology Co Ltd	分众传媒信息技术股份有限公司	002027 CH	深圳证券交易所	中国	42,200	296,666.00	0.17
119	Apollo Global Management Inc	阿波罗全球管理股份有限公司	APO UN	纽约证券交易所	美国	248	294,434.56	0.17
120	Fortinet Inc	Fortinet 股份有限公司	FTNT UW	纳斯达克证券交易所	美国	432	293,397.13	0.17
121	Morgan Stanley	摩根士丹利	MS UN	纽约证券交易所	美国	322	290,999.66	0.17
122	China Energy Engineering Corp Ltd	中国能源建设股份有限公司	601868 CH	上海证券交易所	中国	106,100	242,969.00	0.14
122	China Energy Engineering Corp Ltd	中国能源建设股份有限公司	3996 HK	香港证券交易所	中国香港	50,000	47,691.06	0.03

12 3	Jiangsu Hengrui Pharmac euticals Co Ltd	江苏恒 瑞医药 股份有 限公司	600276 CH	上海证 券交易 所	中国	6,300	289,170.00	0.16
12 4	Flex Ltd	伟创力 国际有 限公司	FLEX UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,044	288,105.03	0.16
12 5	Home Depot Inc/The	家得宝	HD UN	纽约证 券交易 所	美国	103	288,010.22	0.16
12 6	Lam Research Corp	泛林集 团	LRCX UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	554	287,646.85	0.16
12 7	Freshpet Inc	Freshp et 公司	FRPT UQ	纳斯达 克证券 交易所	美国	270	287,461.96	0.16
12 8	Luxshare Precisi on Ind ustry Co Ltd	立讯精 密工业 股份有 限公司	002475 CH	深圳证 券交易 所	中国	7,000	285,320.00	0.16
12 9	Pop Mart Inter national Group Ltd	泡泡玛 特国际 集团有 限公司	9992 HK	香港证 券交易 所	中 国 香港	3,400	282,266.25	0.16
13 0	On Holding AG	On 控股 股份公 司	ONON UN	纽约证 券交易 所	美国	715	281,501.70	0.16
13 1	Boston S cientific Corp	波士顿 科学	BSX UN	纽约证 券交易 所	美国	438	281,225.73	0.16
13 2	Ameripris e Financ ial Inc	阿默普 莱斯金 融公司	AMP UN	纽约证 券交易 所	美国	73	279,394.35	0.16
13 3	Sea Ltd	Sea 有 限公司	SE UN	纽约证 券交易 所	美国	366	279,144.26	0.16
13 4	Hon Hai Precisi on Ind ustry Co Ltd	鸿海精 密工业 股份有 限公司	HHPD LI	伦敦证 券交易 所	英国	3,435	275,070.60	0.16

135	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	127	274,297.99	0.16
136	Aluminum Corp of China Ltd	中国铝业股份有限公司	601600 CH	上海证券交易所	中国	37,300	274,155.00	0.16
137	Konami Group Corp	科乐美控股株式会社	9766 JT	日本证券交易所	日本	400	273,699.36	0.16
138	China Shipbuilding Industry Co Ltd	中国船舶重工股份有限公司	601989 CH	上海证券交易所	中国	56,800	273,208.00	0.15
139	Banco Latinoamericano de Comercio Exterior SA	拉美出口银行	BLX UN	纽约证券交易所	美国	1,058	270,521.49	0.15
140	Altria Group Inc	高特利	MO UN	纽约证券交易所	美国	715	268,755.23	0.15
141	Sompo Holdings Inc	损保控股株式会社	8630 JT	日本证券交易所	日本	1,400	266,607.22	0.15
142	ExceleRate Energy Inc	ExceleRate Energy Inc	EE UN	纽约证券交易所	美国	1,226	266,592.60	0.15
143	Lens Technology Co Ltd	蓝思科技股份有限公司	300433 CH	深圳证券交易所	中国	12,100	264,990.00	0.15
144	Williams-Sonoma Inc	Williams-Sonoma 股份有限公司	WSM UN	纽约证券交易所	美国	199	264,898.43	0.15
145	HSBC Holdings PLC	汇丰控股有限公司	HSBA LN	伦敦证券交易所	英国	3,702	263,870.28	0.15

146	Ninestar Corp	纳思达股份有限公司	002180 CH	深圳证券交易所	中国	9,300	261,981.00	0.15
147	China Shipbuilding Industry Group Power Co Ltd	中国船舶重工集团动力股份有限公司	600482 CH	上海证券交易所	中国	10,600	259,382.00	0.15
148	Haier Smart Home Co Ltd	海尔智家股份有限公司	600690 CH	上海证券交易所	中国	9,100	259,077.00	0.15
149	New China Life Insurance Co Ltd	新华人寿保险股份有限公司	601336 CH	上海证券交易所	中国	4,500	223,650.00	0.13
149	New China Life Insurance Co Ltd	新华人寿保险股份有限公司	1336 HK	香港证券交易所	中国香港	1,600	34,967.27	0.02
150	DBS Group Holdings Ltd	星展集团	DBS SP	新加坡证券交易所	新加坡	1,100	255,916.77	0.15
151	Avary Holding Shenzhen Co Ltd	鹏鼎控股(深圳)股份有限公司	002938 CH	深圳证券交易所	中国	7,000	255,360.00	0.14
152	Poly Developments and Holdings Group Co Ltd	保利发展控股集团股份有限公司	600048 CH	上海证券交易所	中国	28,800	255,168.00	0.14
153	China National Chemical Engineering Co Ltd	中国化学工程股份有限公司	601117 CH	上海证券交易所	中国	30,600	253,674.00	0.14
154	Yunnan Yuntianhua Co Ltd	云南云天化股份有限公司	600096 CH	上海证券交易所	中国	11,300	251,990.00	0.14

155	Applied Industrial Technologies Inc	应用工业技术公司	AIT UN	纽约证券交易所	美国	146	251,325.30	0.14
156	Pentair PLC	Pentair 公共有限公司	PNR UN	纽约证券交易所	美国	347	251,033.88	0.14
157	Kroger Co/The	克罗格公司	KR UN	纽约证券交易所	美国	569	250,115.71	0.14
158	Pegasystems Inc	Pegasystems 股份有限公司	PEGA UW	纳斯达克证券交易所	美国	373	249,894.66	0.14
159	BOE Technology Group Co Ltd	京东方科技集团股份有限公司	000725 CH	深圳证券交易所	中国	56,900	249,791.00	0.14
160	Fast Retailing Co Ltd	迅销有限公司	9983 JT	日本证券交易所	日本	100	248,826.01	0.14
161	AVIC Airborne Systems Co Ltd	中航机载系统股份有限公司	600372 CH	上海证券交易所	中国	19,900	245,367.00	0.14
162	Beijing Roborock Technology Co Ltd	北京石头世纪科技股份有限公司	688169 CH	上海证券交易所	中国	1,114	244,289.06	0.14
163	Shandong Nanshan Aluminum Co Ltd	山东南山铝业股份有限公司	600219 CH	上海证券交易所	中国	62,100	242,811.00	0.14
164	T-Mobile US Inc	T-Mobile US 股份有限公司	TMUS UW	纳斯达克证券交易所	美国	153	242,764.42	0.14
165	Heidelberg Materials AG	海德堡材料股份公司	HEI GY	德国证券交易所	德国	269	241,512.51	0.14

166	AECC Aero-Engine Control Co Ltd	中国航发动力控制股份有限公司	000738 CH	深圳证券交易所	中国	10,768	239,480.32	0.14
167	Sunwoda Electronic Co Ltd	欣旺达电子股份有限公司	300207 CH	深圳证券交易所	中国	10,700	238,717.00	0.14
168	Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd	上海复星医药(集团)股份有限公司	600196 CH	上海证券交易所	中国	9,500	236,075.00	0.13
169	Itron Inc	爱拓利公司	ITRI UW	纳斯达克证券交易所	美国	302	235,715.97	0.13
170	Fairfax Financial Holdings Ltd	枫信金融控股有限公司	FFH CT	加拿大证券交易所	加拿大	23	232,290.80	0.13
171	Victoria's Secret & Co	维多利亚的秘密	VSCO UN	纽约证券交易所	美国	780	232,239.95	0.13
172	Tyler Technologies Inc	Tyler 科技公司	TYL UN	纽约证券交易所	美国	56	232,126.66	0.13
173	EMCOR Group Inc	埃姆科集团公司	EME UN	纽约证券交易所	美国	71	231,659.85	0.13
174	Allianz SE	安联保险有限公司	ALV GY	德国证券交易所	德国	104	231,592.88	0.13
175	DoorDash Inc	DoorDash 股份有限公司	DASH UW	纳斯达克证券交易所	美国	192	231,523.99	0.13
176	Arcsoft Corp Ltd	虹软科技股份有限公司	688088 CH	上海证券交易所	中国	6,000	231,360.00	0.13
177	Exxon Mobil Corp	埃克森美孚石油公司	XOM UN	纽约证券交易所	美国	299	231,203.60	0.13

178	Cie de Saint-Gobain SA	法国圣戈班公司	SGO FP	巴黎证券交易所	法国	358	230,892.99	0.13
179	SG Micro Corp	圣邦微电子(北京)股份有限公司	300661 CH	深圳证券交易所	中国	2,800	228,984.00	0.13
180	Qingdao TGOOD Electric Co Ltd	青岛特锐德电气股份有限公司	300001 CH	深圳证券交易所	中国	10,400	228,280.00	0.13
181	Howmet Aerospace Inc	Howmet 航空航天股份有限公司	HWM UN	纽约证券交易所	美国	289	227,210.44	0.13
182	Jafron Biomedical Co Ltd	健帆生物科技股份有限公司	300529 CH	深圳证券交易所	中国	7,700	225,918.00	0.13
183	WuXi AppTec Co Ltd	无锡药明康德新药开发股份有限公司	603259 CH	上海证券交易所	中国	4,100	225,664.00	0.13
184	Hubei Xingfa Chemicals Group Co Ltd	湖北兴发化工集团股份有限公司	600141 CH	上海证券交易所	中国	10,200	221,340.00	0.13
185	F5 Inc	F5 股份有限公司	FFIV UW	纳斯达克证券交易所	美国	122	220,535.37	0.13
186	Red Avenue New Materials Group Co Ltd	彤程新材料集团股份有限公司	603650 CH	上海证券交易所	中国	6,300	220,311.00	0.12
187	EssilorLuxottica SA	EssilorLuxottica 股	EL FP	巴黎证券交易所	法国	124	219,858.81	0.12

		份公司						
188	Virtu Financial Inc	Virtu 金融股份有限公司	VIRT UW	纳斯达克证券交易所	美国	849	217,753.31	0.12
189	KLA Corp	KLA 公司	KLAC UW	纳斯达克证券交易所	美国	48	217,418.62	0.12
190	ITOCHU Corp	伊藤忠商事	8001 JT	日本证券交易所	日本	600	217,258.11	0.12
191	Mizuho Financial Group Inc	瑞穗金融集团	8411 JT	日本证券交易所	日本	1,200	214,872.49	0.12
192	Chipotle Mexican Grill Inc	Chipotle Mexican Grill 股份有限公司	CMG UN	纽约证券交易所	美国	495	214,562.96	0.12
193	Hangzhou Lion Microelectronics Co Ltd	杭州立昂微电子股份有限公司	605358 CH	上海证券交易所	中国	8,600	213,022.00	0.12
194	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	733	212,516.96	0.12
195	Sangfor Technologies Inc	深信服科技股份有限公司	300454 CH	深圳证券交易所	中国	3,700	212,380.00	0.12
196	State Street Corp	道富集团	STT UN	纽约证券交易所	美国	300	211,662.44	0.12
197	Xingtong Shipping Co Ltd	兴通海运股份有限公司	603209 CH	上海证券交易所	中国	13,200	210,936.00	0.12
198	China Southern Power Group	南方电网储能股份有限公司	600995 CH	上海证券交易所	中国	20,700	209,484.00	0.12

	rid Energy Storage Co Ltd	限公司						
199	Coca-Cola Consolidated Inc	可口可乐装瓶有限公司	COKE UW	纳斯达克证券交易所	美国	23	208,318.18	0.12
200	Shannon Semiconductor Technology Co Ltd	香农芯创科技股份有限公司	300475 CH	深圳证券交易所	中国	7,300	207,977.00	0.12
201	Palo Alto Networks Inc	Palo Alto Networks 股份有限公司	PANW UW	纳斯达克证券交易所	美国	159	207,972.20	0.12
202	UCB SA	优时比股份公司	UCB BB	布鲁塞尔证券交易所	比利时	143	206,840.85	0.12
203	TJX Cos Inc/The	TJX 公司	TJX UN	纽约证券交易所	美国	238	206,686.48	0.12
204	Mr Cooper Group Inc	Mr Cooper 集团股份有限公司	COOP UR	纳斯达克证券交易所	美国	298	205,667.17	0.12
205	Pandora A/S	潘多拉公司	PANDY UV	纽约证券交易所	美国	611	204,233.23	0.12
206	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd	深圳迈瑞生物医疗电子股份有限公司	300760 CH	深圳证券交易所	中国	800	204,000.00	0.12
207	Zhejiang Asia-Pacific Mechanical	浙江亚太机电股份有限公司	002284 CH	深圳证券交易所	中国	26,200	202,788.00	0.11

	& Electronic Co Ltd							
208	Sinoma Science & Technology Co Ltd	中材科技股份有限公司	002080 CH	深圳证券交易所	中国	15,500	202,740.00	0.11
209	Xizi Clean Energy Equipment Manufacturing Co Ltd	西子清洁能源装备制造股份有限公司	002534 CH	深圳证券交易所	中国	18,100	201,091.00	0.11
210	Milkyway Intelligent Supply Chain Service Group Co Ltd	密尔克卫智能供应链服务集团股份有限公司	603713 CH	上海证券交易所	中国	3,900	199,680.00	0.11
211	Hangzhou Hikvision Digital Technology Co Ltd	杭州海康威视数字技术股份有限公司	002415 CH	深圳证券交易所	中国	6,500	199,550.00	0.11
212	Kingnet Network Co Ltd	恺英网络股份有限公司	002517 CH	深圳证券交易所	中国	14,600	198,706.00	0.11
213	Brown & Brown Inc	Brown & Brown 股份有限公司	BRO UN	纽约证券交易所	美国	270	198,007.35	0.11
214	Doximity Inc	Doximity Inc	DOCS UN	纽约证券交易所	美国	512	196,499.80	0.11
215	BYD Electronic International C	比亚迪电子（国际）有	285 HK	香港证券交易所	中国香港	5,000	194,699.91	0.11

	o Ltd	限公司						
21 6	Dick's Sporting Goods Inc	迪克体育用品股份有限公司	DKS UN	纽约证券交易所	美国	118	194,109.23	0.11
21 7	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	281	194,086.07	0.11
21 8	Zions Bancorp NA	锡安银行	ZION UW	纳斯达克证券交易所	美国	496	193,425.47	0.11
21 9	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	143	191,536.28	0.11
22 0	Goldwind Science & Technology Co Ltd	金风科技股份有限公司	002202 CH	深圳证券交易所	中国	18,400	190,072.00	0.11
22 1	ASML Holding NV	阿斯麦控股公司	ASML NA	阿姆斯特丹交易所	荷兰	37	188,984.63	0.11
22 2	Trane Technologies PLC	特灵科技公共有限公司	TT UN	纽约证券交易所	美国	71	188,507.52	0.11
22 3	Constellation Energy Corp	美国联合能源公司	CEG UW	纳斯达克证券交易所	美国	116	186,541.57	0.11
22 4	Q2 Holdings Inc	Q2 控股股份有限公司	QTWO UN	纽约证券交易所	美国	256	185,219.19	0.11
22 5	United Therapeutics Corp	联合治疗公司	UTHR UW	纳斯达克证券交易所	美国	73	185,153.92	0.10
22 6	Flutter Entertainment PLC	Flutter 娱乐公共有限公司	FLTR LN	伦敦证券交易所	英国	98	184,303.78	0.10
22	Mitsui &	三井物	8031 JT	日本证	日本	1,200	183,692.96	0.10

7	Co Ltd	产		券交易 所				
22 8	Build-A-B ear Work shop I nc	金泰迪 工作室 股份有 限公司	BBW UN	纽约证 券交易 所	美国	553	183,017.53	0.10
22 9	DocuSign Inc	DocuSi gn 股份 有限公 司	DOCU UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	283	182,966.49	0.10
23 0	Enova In ternation al Inc	Enova Intern ationa l 公司	ENVA UN	纽约证 券交易 所	美国	265	182,644.30	0.10
23 1	Trade Desk Inc/The	Trade Desk 股 份有限 公司	TTD UQ	纳斯达 克证券 交易所	美国	216	182,488.17	0.10
23 2	Raymond James Financial Inc	Raymon d Jam es 金融股 份有限 公司	RJF UN	纽约证 券交易 所	美国	161	179,768.44	0.10
23 3	China Ho ngqiao G roup L td	中国宏 桥集团 有限公 司	1378 HK	香港证 券交易 所	中 国 香港	16,500	179,688.80	0.10
23 4	Assurant Inc	安信龙 集团	AIZ UN	纽约证 券交易 所	美国	116	177,794.44	0.10
23 5	Poste Italiane SpA	意大利 邮政集 团	PST IM	意大利 证券交 易所	意 大 利	1,733	177,632.56	0.10
23 6	Gartner Inc	Gartne r 公司	IT UN	纽约证 券交易 所	美国	51	177,610.77	0.10
23 7	Swiss Re AG	瑞士再 保险股 份有限 公司	SREN SE	瑞士证 券交易 所	瑞士	169	177,331.40	0.10
23 8	Synchrony Financial	同步金 融公司	SYF UN	纽约证 券交易 所	美国	378	176,618.99	0.10

23 9	Cal-Maine Foods Inc	Cal-Maine 食品股份有限公司	CALM UW	纳斯达克 证券交易所	美国	238	176,079.57	0.10
24 0	Capital One Financial Corp	第一资本金融	COF UN	纽约证 券交易 所	美国	137	175,611.46	0.10
24 1	Yongjin Technology Group Co Ltd	甬金科技集团 股份有限公司	603995 CH	上海证 券交易 所	中国	9,600	175,584.00	0.10
24 2	Discover Financial Services	Discover 金融 服务公司	DFS UN	纽约证 券交易 所	美国	139	173,089.27	0.10
24 3	Jiangxi Copper Co Ltd	江西铜业股份 有限公司	358 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	15,000	173,076.88	0.10
24 4	Xiaomi Corp	小米集团	1810 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	5,400	172,521.25	0.10
24 5	Ubiquiti Inc	Ubiquiti 股份 有限公司	UI UN	纽约证 券交易 所	美国	72	171,795.28	0.10
24 6	Erste Group Bank AG	奥地利第一储 蓄银行股份公 司	EBS AV	维也纳 证券交 易所	奥地 利	382	171,511.61	0.10
24 7	Sinotruk Hong Kong Ltd	中国重汽（香 港）有限公 司	3808 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	8,000	168,909.70	0.10
24 8	Quanta Services Inc	Quanta 服务股 份有限公 司	PWR UN	纽约证 券交易 所	美国	74	168,120.14	0.10
24 9	Panasonic Holdings Corp	Panasonic 株 式会社	6752 JT	日本证 券交易 所	日本	2,200	167,113.80	0.09

250	Will Semiconductor Co Ltd Shanghai	上海韦尔半导体股份有限公司	603501 CH	上海证券交易所	中国	1,600	167,056.00	0.09
251	Willis Towers Watson PLC	韦莱韬睿惠悦公共有限公司	WTW UW	纳斯达克证券交易所	美国	74	166,625.39	0.09
252	CSW Industrials Inc	CSW 工业股份有限公司	CSWI UW	纳斯达克证券交易所	美国	65	164,844.39	0.09
253	Siemens AG	西门子	SIE GY	德国证券交易所	德国	115	163,190.29	0.09
254	Gildan Activewear Inc	吉尔丹运动服装股份有限公司	GIL CT	加拿大证券交易所	加拿大	476	162,610.63	0.09
255	Beijing Kawin Technology Share-Holding Co Ltd	北京凯因科技股份有限公司	688687 CH	上海证券交易所	中国	7,524	162,367.92	0.09
256	Allison Transmission Holdings Inc	艾里逊变速箱控股公司	ALSN UN	纽约证券交易所	美国	209	162,346.71	0.09
257	Cameco Corp	Cameco 公司	CCO CT	加拿大证券交易所	加拿大	434	161,982.13	0.09
258	Wix.com Ltd	Wix.com 有限公司	WIX UW	纳斯达克证券交易所	美国	105	161,938.48	0.09
259	SkyWest Inc	SkyWest 股份有限公司	SKYW UW	纳斯达克证券交易所	美国	224	161,229.49	0.09
260	Unum Group	尤纳姆集团	UNM UN	纽约证券交易所	美国	306	160,640.47	0.09

261	Shopify Inc	Shopify 股份有限公司	SHOP UN	纽约证券交易所	美国	209	159,747.60	0.09
262	Kontoor Brands Inc	Kontoor Brands Inc	KTB UN	纽约证券交易所	美国	257	157,788.04	0.09
263	Bank of New York Mellon Corp /The	纽约梅隆银行	BK UN	纽约证券交易所	美国	285	157,401.16	0.09
264	Grab Holdings Ltd	Grab 控股有限公司	GRAB UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,609	156,379.90	0.09
265	eBay Inc	eBay 股份有限公司	EBAY UW	纳斯达克证券交易所	美国	350	155,862.48	0.09
266	McKesson Corp	McKesson 公司	MCK UN	纽约证券交易所	美国	38	155,676.16	0.09
267	Recruit Holdings Co Ltd	Recruit Holdings 株式会社	6098 JT	日本证券交易所	日本	300	154,580.04	0.09
268	DaVita Inc	DaVita 股份有限公司	DVA UN	纽约证券交易所	美国	143	153,728.61	0.09
269	CGN Power Co Ltd	中国广核电力股份有限公司	1816 HK	香港证券交易所	中国香港	58,000	153,074.41	0.09
270	Agnico Eagle Mines Ltd	阿哥尼可老鹰矿场有限公司	AEM CT	加拿大证券交易所	加拿大	269	152,765.24	0.09
271	MasTec Inc	MasTec 股份有限公司	MTZ UN	纽约证券交易所	美国	156	152,666.09	0.09
272	ACI Worldwide Inc	ACI Worldwide 公司	ACIW UW	纳斯达克证券交易所	美国	400	149,259.94	0.08

27 3	Generali	忠意集团	G IM	意大利证券交易所	意大利	725	148,788.73	0.08
27 4	PNC Financial Services Group Inc/The	PNC 财务服务	PNC UN	纽约证券交易所	美国	107	148,332.27	0.08
27 5	AbbVie Inc	艾伯维股份有限公司	ABBV UN	纽约证券交易所	美国	116	148,175.93	0.08
27 6	Burlington Stores Inc	伯灵顿商店股份有限公司	BURL UN	纽约证券交易所	美国	72	147,537.02	0.08
27 7	Unisplendour Corp Ltd	紫光股份有限公司	000938 CH	深圳证券交易所	中国	5,300	147,499.00	0.08
27 8	Automatic Data Processing Inc	ADP 公司	ADP UW	纳斯达克证券交易所	美国	70	147,298.22	0.08
27 9	Zebra Technologies Corp	斑马技术公司	ZBRA UW	纳斯达克证券交易所	美国	53	147,144.10	0.08
28 0	Williams Cos Inc/The	威廉姆斯公司	WMB UN	纽约证券交易所	美国	378	147,055.69	0.08
28 1	Parker-Hannifin Corp	派克汉尼汾公司	PH UN	纽约证券交易所	美国	32	146,305.22	0.08
28 2	Muyuan Foods Co Ltd	牧原食品股份有限公司	002714 CH	深圳证券交易所	中国	3,800	146,072.00	0.08
28 3	Commvault Systems Inc	CommVault 系统股份有限公司	CVLT UW	纳斯达克证券交易所	美国	132	143,193.79	0.08
28 4	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	4	142,859.96	0.08

285	Datadog Inc	Datadog 股份有限公司	DDOG UW	纳斯达克证券交易所	美国	139	142,773.92	0.08
286	Nomura Holdings Inc	野村控股	8604 JT	日本证券交易所	日本	3,300	142,087.42	0.08
287	ExlService Holdings Inc	ExlService 控股公司	EXLS UW	纳斯达克证券交易所	美国	445	141,964.43	0.08
288	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	西屋制动公司	WAB UN	纽约证券交易所	美国	104	141,736.27	0.08
289	Nasdaq Inc	纳斯达克股份有限公司	NDAQ UW	纳斯达克证券交易所	美国	255	141,712.48	0.08
290	Allstate Corp/The	好事达保险公司	ALL UN	纽约证券交易所	美国	102	141,356.87	0.08
291	Yum China Holdings Inc	百胜中国控股有限公司	YUMC UN	纽约证券交易所	美国	407	140,929.95	0.08
292	Mueller Industries Inc	美乐工业有限公司	MLI UN	纽约证券交易所	美国	246	140,335.97	0.08
293	ZTE Corp	中兴通讯股份有限公司	000063 CH	深圳证券交易所	中国	2,900	117,160.00	0.07
293	ZTE Corp	中兴通讯股份有限公司	763 HK	香港证券交易所	中国香港	1,000	22,549.07	0.01
294	International Paper Co	国际纸业	IP UN	纽约证券交易所	美国	360	139,276.69	0.08
295	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	78	138,581.43	0.08

		司						
29 6	Kinder Morgan Inc	特拉华 州金德 摩根公 司	KMI UN	纽约证 券交易 所	美国	693	136,494.78	0.08
29 7	Liberty Media Co rp-Libert y Formul a One	Libert y 传媒 公司 -Liber ty 一级 方程式	FWONK UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	154	102,575.88	0.06
29 7	Liberty Media Co rp-Libert y Formul a One	Libert y 传媒 公司 -Liber ty 一级 方程式	FWONA UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	56	33,830.34	0.02
29 8	HubSpot Inc	HubSpo t 公司	HUBS UN	纽约证 券交易 所	美国	27	135,233.86	0.08
29 9	Jiangsu Linyang Energy Co Ltd	江苏林 洋能源 股份有 限公司	601222 CH	上海证 券交易 所	中国	19,100	135,037.00	0.08
30 0	IEIT Systems Co Ltd	浪潮电 子信息 产业股 份有限 公司	000977 CH	深圳证 券交易 所	中国	2,600	134,888.00	0.08
30 1	Louisiana -Pacific Corp	路易斯 安娜太 平洋	LPX UN	纽约证 券交易 所	美国	180	133,984.59	0.08
30 2	Standard Charter ed PLC	渣打集 团有限 公司	STAN LN	伦敦证 券交易 所	英国	1,459	130,916.44	0.07
30 3	Yizumi H oldings Co Ltd	伊之密 股份有 限公司	300415 CH	深圳证 券交易 所	中国	6,500	130,390.00	0.07
30 4	Brookfiel d Asset Manag ement Lt d	博枫资 产管理 有限公 司	BAM CT	加拿大 证券交 易所	加 拿 大	331	130,308.88	0.07
30 5	Axis Cap ital Hol	阿克西 斯资本	AXS UN	纽约证 券交易	美国	204	129,955.35	0.07

	dings Ltd	控股有限公司		所				
306	China Pacific Insurance Group Co Ltd	中国太平洋保险(集团)股份有限公司	601601 CH	上海证券交易所	中国	3,800	129,504.00	0.07
307	Cardinal Health Inc	嘉德诺健康集团	CAH UN	纽约证券交易所	美国	152	129,226.15	0.07
308	Zhangzhou Pient zehuang Pharmaceutical Co Ltd	漳州片仔癀药业股份有限公司	600436 CH	上海证券交易所	中国	600	128,700.00	0.07
309	Autodesk Inc	欧特克	ADSK UW	纳斯达克证券交易所	美国	60	127,480.52	0.07
310	BOC Hong Kong Holdings Ltd	中银香港(控股)有限公司	2388 HK	香港证券交易所	中国香港	5,500	127,075.84	0.07
311	Frontdoor Inc	Frontdoor 股份有限公司	FTDR UW	纳斯达克证券交易所	美国	317	124,577.78	0.07
312	TDK Corp	TDK 株式会社	6762 JT	日本证券交易所	日本	1,300	124,563.26	0.07
313	Sprouts Farmers Market Inc	Sprouts Farmers Market 股份有限公司	SFM UW	纳斯达克证券交易所	美国	132	120,572.76	0.07
314	ONEOK Inc	Oneok 股份有限公司	OKE UN	纽约证券交易所	美国	167	120,526.47	0.07
315	Natera Inc	Natera 股份有限公司	NTRA UW	纳斯达克证券交易所	美国	105	119,481.99	0.07
31	Canon Inc	佳能	7751 JT	日本证	日本	500	119,304.26	0.07

6				券交易所				
317	Bristol-Myers Squibb Co	百时美施贵宝公司	BMY UN	纽约证券交易所	美国	292	118,720.16	0.07
318	Metallurgical Corp of China Ltd	中国冶金科工股份有限公司	1618 HK	香港证券交易所	中国香港	78,000	118,459.04	0.07
319	Carvana Co	Carvana 公司	CVNA UN	纽约证券交易所	美国	81	118,408.47	0.07
320	CBRE Group Inc	世邦魏理仕	CBRE UN	纽约证券交易所	美国	124	117,026.86	0.07
321	AAON Inc	AAON 股份有限公司	AAON UW	纳斯达克证券交易所	美国	138	116,738.47	0.07
322	Wingtech Technology Co Ltd	闻泰科技股份有限公司	600745 CH	上海证券交易所	中国	3,000	116,340.00	0.07
323	Safran SA	赛峰股份有限公司	SAF FP	巴黎证券交易所	法国	72	114,926.47	0.07
324	Wolters Kluwer NV	威科集团	WKL NA	阿姆斯特丹交易所	荷兰	95	114,676.62	0.07
325	Beijing Kingsoft Office Software Inc	北京金山办公软件股份有限公司	688111 CH	上海证券交易所	中国	400	114,556.00	0.06
326	Gilead Sciences Inc	吉利德科学	GILD UW	纳斯达克证券交易所	美国	172	114,206.71	0.06
327	WW Grainger Inc	固安捷股份有限公司	GWV UN	纽约证券交易所	美国	15	113,654.00	0.06
328	Investor AB	瑞典银瑞达集团	INVEB SS	斯德哥尔摩证券交易所	瑞典	591	113,559.84	0.06

329	Cloudflare Inc	Cloudflare 股份有限公司	NET UN	纽约证券交易所	美国	146	113,010.85	0.06
330	SK Hynix Inc	SK 海力士株式会社	HY9H GF	法兰克福证券交易所	德国	135	112,772.61	0.06
331	Jefferies Financial Group Inc	杰富瑞金融集团	JEF UN	纽约证券交易所	美国	200	112,714.11	0.06
332	Entergy Corp	Entergy 公司	ETR UN	纽约证券交易所	美国	206	112,275.04	0.06
333	Constellation Software Inc/Canada	Constellation 软件 (加拿大)	CSU CT	加拿大证券交易所	加拿大	5	112,229.53	0.06
334	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	挪威邮轮控股有限公司	NCLH UN	纽约证券交易所	美国	606	112,084.26	0.06
335	Public Service Enterprise Group Inc	公共服务企业集团	PEG UN	纽约证券交易所	美国	184	111,752.02	0.06
336	Equitable Holdings Inc	Equitable 控股股份有限公司	EQH UN	纽约证券交易所	美国	329	111,556.28	0.06
337	Houlihan Lokey Inc	华利安股份有限公司	HLI UN	纽约证券交易所	美国	89	111,102.04	0.06
338	BILL Holdings Inc	Bill 控股股份有限公司	BILL UN	纽约证券交易所	美国	182	110,825.14	0.06
339	Imperial Brands PLC	帝国品牌公共有限公司	IMB LN	伦敦证券交易所	英国	477	110,531.89	0.06

340	Electronic Arts Inc	电子艺界	EA UN	纳斯达克证券交易所	美国	105	110,424.61	0.06
341	Charles Schwab Corp/The	嘉信理财	SCHW UN	纽约证券交易所	美国	206	109,594.78	0.06
342	Stifel Financial Corp	斯迪富融资公司	SF UN	纽约证券交易所	美国	142	108,281.46	0.06
343	Zhejiang Huayou Cobalt Co Ltd	浙江华友钴业股份有限公司	603799 CH	上海证券交易所	中国	3,700	108,262.00	0.06
344	US Bancorp	美国合众银行	USB UN	纽约证券交易所	美国	314	107,959.85	0.06
345	Honda Motor Co Ltd	本田	7267 JT	日本证券交易所	日本	1,500	106,451.48	0.06
346	Stryker Corp	史赛克	SYK UN	纽约证券交易所	美国	41	106,115.52	0.06
347	Piper Sandler Cos	Piper Sandler 公司	PIPR UN	纽约证券交易所	美国	49	105,651.87	0.06
348	Great Wall Motor Co Ltd	长城汽车股份有限公司	601633 CH	上海证券交易所	中国	4,000	105,320.00	0.06
349	Sherwin-Williams Co/The	宣伟公司	SHW UN	纽约证券交易所	美国	43	105,072.77	0.06
350	DT Midstream Inc	DT Midstream Inc	DTM UN	纽约证券交易所	美国	147	105,067.16	0.06
351	Waste Management Inc	废品管理	WM UN	纽约证券交易所	美国	72	104,439.40	0.06
352	Reinsurance Group of America Inc	RGA 美国再保险公司	RGA UN	纽约证券交易所	美国	68	104,424.74	0.06

	nc							
353	Applied Materials Inc	应用材料	AMAT UW	纳斯达克证券交易所	美国	89	104,045.40	0.06
354	Travelers Cos Inc/The	旅行家集团	TRV UN	纽约证券交易所	美国	60	103,896.82	0.06
355	Citizens Financial Group Inc	公民金融集团股份有限公司	CFG UN	纽约证券交易所	美国	330	103,806.25	0.06
356	Digital Realty Trust Inc	数字房地产信托有限公司	DLR UN	纽约证券交易所	美国	81	103,252.24	0.06
357	Abercrombie & Fitch Co	阿贝克隆比&费奇公司	ANF UN	纽约证券交易所	美国	96	103,147.21	0.06
358	Keyera Corp	Keyera Corp	KEY CT	加拿大证券交易所	加拿大	463	102,781.00	0.06
359	Fair Isaac Corp	费埃哲公司	FICO UN	纽约证券交易所	美国	7	100,181.21	0.06
360	Advanced Micro Devices Inc	AMD 公司	AMD UW	纳斯达克证券交易所	美国	115	99,852.99	0.06
361	Insulet Corp	Insulet 股份有限公司	PODD UW	纳斯达克证券交易所	美国	53	99,463.81	0.06
362	Pure Storage Inc	Pure 储存股份有限公司	PSTG UN	纽约证券交易所	美国	225	99,356.27	0.06
363	Brinker International Inc	Brinker 国际股份有限公司	EAT UN	纽约证券交易所	美国	103	97,948.20	0.06
364	Honeywell International	霍尼韦尔	HON UW	纳斯达克证券交易所	美国	60	97,427.26	0.06

	Inc							
365	MTU Aero Engines AG	MTU Aero 发动机股份有限公司	MTX GY	德国证券交易所	德国	40	96,931.02	0.05
366	United Overseas Bank Ltd	新加坡大华银行	UOB SP	新加坡证券交易所	新加坡	500	96,663.23	0.05
367	Interactive Brokers Group Inc	盈透证券集团股份有限公司	IBKR UW	纳斯达克证券交易所	美国	76	96,518.07	0.05
368	Lennox International Inc	雷诺士国际有限公司	LII UN	纽约证券交易所	美国	22	96,357.63	0.05
369	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	MS&AD 保险集团控股株式会社	8725 JT	日本证券交易所	日本	600	95,674.57	0.05
370	Zoom Communications Inc	Zoom 通信股份有限公司	ZM UW	纳斯达克证券交易所	美国	161	94,449.90	0.05
371	China Tourism Group Duty Free Corp Ltd	中国旅游集团中免股份有限公司	601888 CH	上海证券交易所	中国	1,400	93,814.00	0.05
372	Crane Co	Crane Co	CR UN	纽约证券交易所	美国	86	93,812.21	0.05
373	Qifu Technology Inc	奇富科技股份有限公司	QFIN UW	纳斯达克证券交易所	美国	337	92,975.20	0.05
374	Citigroup Inc	花旗集团	C UN	纽约证券交易所	美国	183	92,596.44	0.05
375	Pharmaron Beijing	康龙化成(北	300759 CH	深圳证券交易所	中国	3,600	92,520.00	0.05

	Co L td	京)新 药技术 股份有 限公司		所				
37 6	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴 巴集团 控股有 限公司	9988 HK	香港证 券交易 所	中 国 香港	1,100	83,936.27	0.05
37 6	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴 巴集团 控股有 限公司	BABA UN	纽约证 券交易 所	美国	11	6,704.55	0.00
37 7	MSCI Inc	MSCI 明晟	MSCI UN	纽约证 券交易 所	美国	21	90,575.35	0.05
37 8	Climb Gl obal S olutions Inc	Climb Glob al Soluti ons 公 司	CLMB UQ	纳斯达 克证券 交易所	美国	99	90,201.84	0.05
37 9	Aier Eye Hospita l Group Co Ltd d	爱尔眼 科医院 集团股 份有限 公司	300015 CH	深圳证 券交易 所	中国	6,700	88,775.00	0.05
38 0	Fisher & Paykel Health care Co rp Ltd	费雪派 克医疗 保健有 限公司	FPH NZ	新西兰 证券交 易所	新 西 兰	564	88,698.70	0.05
38 1	Coca-Cola Co/The	可口可 乐	KO UN	纽约证 券交易 所	美国	198	88,614.86	0.05
38 2	Alaska Air Group Inc	阿拉斯 加航空 集团	ALK UN	纽约证 券交易 所	美国	190	88,435.29	0.05
38 3	Jason Fu rniture Hangzho u Co Ltd d	顾家家 居股份 有限公 司	603816 CH	上海证 券交易 所	中国	3,200	88,256.00	0.05
38 4	Ingredion Inc	宜瑞安 公司	INGR UN	纽约证 券交易 所	美国	89	88,006.43	0.05

385	Ralph Lauren Corp	拉夫劳伦	RL UN	纽约证券交易所	美国	53	87,999.96	0.05
386	Rheinmetall AG	德国莱茵金属股份有限公司	RHM GY	德国证券交易所	德国	19	87,880.61	0.05
387	Kingsoft Corp Ltd	金山软件有限公司	3888 HK	香港证券交易所	中国香港	2,800	87,251.49	0.05
388	Mitsubishi Electric Corp	三菱电机	6503 JT	日本证券交易所	日本	700	86,959.65	0.05
389	Zhejiang Weiming Environment Protection Co Ltd	浙江伟明环保股份有限公司	603568 CH	上海证券交易所	中国	4,000	86,520.00	0.05
390	Kyndryl Holdings Inc	Kyndryl Holdings Inc	KD UN	纽约证券交易所	美国	346	86,056.65	0.05
391	Group 1 Automotive Inc	第一汽车集团公司	GPI UN	纽约证券交易所	美国	28	84,833.47	0.05
392	Vertex Inc	Vertex 股份有限公司	VERX UQ	纳斯达克证券交易所	美国	221	84,753.75	0.05
393	Eve Energy Co Ltd	惠州亿纬锂能股份有限公司	300014 CH	深圳证券交易所	中国	1,800	84,132.00	0.05
394	Atlassian Corp	Atlassian Corp	TEAM UW	纳斯达克证券交易所	美国	48	83,976.61	0.05
395	TKO Group Holdings Inc	TKO Group Holdings Inc	TKO UN	纽约证券交易所	美国	82	83,766.57	0.05
396	Cheniere Energy	Cheniere 能源	LNG UN	纽约证券交易所	美国	54	83,406.86	0.05

	Inc	股份有 限公司		所				
39 7	Snowflake Inc	Snowfl ake 股 份有限 公司	SNOW UN	纽约证 券交易 所	美国	75	83,247.06	0.05
39 8	Enbridge Inc	Enbrid ge 股 份有限 公司	ENB CT	加拿大 证券交 易所	加 拿 大	270	83,183.84	0.05
39 9	Prosus NV	Prosus 公众有 限公司	PRX NA	阿姆斯特 丹交易 所	荷兰	286	82,542.63	0.05
40 0	Mueller Water Products Inc	穆勒水 制品有 限公司	MWA UN	纽约证 券交易 所	美国	510	82,486.89	0.05
40 1	Xcel Energy Inc	Xcel 能源	XEL UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	169	82,025.97	0.05
40 2	Live Nat ion En tertainme nt Inc	Live Nation 娱乐公 司	LYV UN	纽约证 券交易 所	美国	88	81,919.01	0.05
40 3	BOK Financial Corp	BOK 金 融公司	BOKF UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	107	81,876.95	0.05
40 4	Royal Bank of Canada	加拿大 皇家银 行	RY CT	加拿大 证券交 易所	加 拿 大	93	81,396.51	0.05
40 5	Brookfiel d Corp	博枫公 司	BN CT	加拿大 证券交 易所	加 拿 大	195	81,356.82	0.05
40 6	Canadian Imperia l Bank of Com merce	加拿大 帝国商 业银行 /加拿 大	CM CT	加拿大 证券交 易所	加 拿 大	177	81,274.56	0.05
40 7	Dorman Products Inc	Dorman 产品公 司	DORM UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	87	81,019.38	0.05
40 8	Komatsu Ltd	小松制 作所	6301 JT	日本证 券交易 所	日本	400	80,445.42	0.05

409	Cummins Inc	康明斯	CMI UN	纽约证券交易所	美国	32	80,188.04	0.05
410	TC Energy Corp	TC 能源公司	TRP CT	加拿大证券交易所	加拿大	237	80,173.81	0.05
411	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	华侨银行有限公司	OCBC SP	新加坡证券交易所	新加坡	900	79,932.75	0.05
412	Okta Inc	Okta Inc	OKTA UW	纳斯达克证券交易所	美国	141	79,868.87	0.05
413	Progress Software Corp	Progress 软件公司	PRGS UW	纳斯达克证券交易所	美国	170	79,615.12	0.05
414	Ameren Corp	Ameren 公司	AEE UN	纽约证券交易所	美国	124	79,455.97	0.05
415	Blue Owl Capital Inc	蓝猫头鹰资本公司	OWL UN	纽约证券交易所	美国	475	79,421.04	0.05
416	Simon Property Group Inc	西蒙房地产集团公司	SPG UN	纽约证券交易所	美国	64	79,226.52	0.04
417	MetLife Inc	大都会集团	MET UN	纽约证券交易所	美国	134	78,870.55	0.04
418	Wolverine World Wide Inc	Wolverine World Wide 股份有限公司	WWW UN	纽约证券交易所	美国	494	78,833.75	0.04
419	HealthEquity Inc	Health equity 有限公司	HQY UW	纳斯达克证券交易所	美国	114	78,628.88	0.04
420	Grindr Inc	Grindr Inc	GRND UN	纽约证券交易所	美国	612	78,483.53	0.04
42	Corpay	Corpay	CPAY UN	纽约证	美国	32	77,846.35	0.04

1	Inc	股份有 限公司		券交易 所				
42 2	Anglogold Ashanti Plc	安格鲁 阿山帝 黄金公 共有限 公司	AU UN	纽约证 券交易 所	美国	468	77,645.07	0.04
42 3	Verisk Analytics Inc	Verisk 分析公 司	VRSK UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	39	77,216.14	0.04
42 4	Viatrix Inc	晖致	VTRS UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	861	77,055.69	0.04
42 5	Quest Diagnosti cs Inc	Quest Diagnosti cs 股份 有限公司	DGX UN	纽约证 券交易 所	美国	71	76,995.38	0.04
42 6	Inner Mo ngolia Y uan Xi ng Energ y Co Lt d	内蒙古 远兴能 源股份 有限公司	000683 CH	深圳证 券交易 所	中国	13,700	76,583.00	0.04
42 7	StepStone Group Inc	StepStone 集 团股份 有限公司	STEP UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	184	76,555.88	0.04
42 8	Box Inc	Box 股份 有限公司	BOX UN	纽约证 券交易 所	美国	336	76,323.56	0.04
42 9	Gen Digital Inc	Gen Digital 股份 有限公司	GEN UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	386	75,971.90	0.04
43 0	Murphy USA Inc	Murphy 美国股 份有限 公司	MUSA UN	纽约证 券交易 所	美国	21	75,742.37	0.04
43 1	Hancock Whitney Corp	Hancock Whitne	HWC UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	192	75,523.06	0.04

		y 公司						
43 2	Texas Roadhouse Inc	Texas Roadhouse 股 份有限公 司	TXRH UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	58	75,226.17	0.04
43 3	S&P Global Inc	标普全 球	SPGI UN	纽约证 券交易 所	美国	21	75,180.82	0.04
43 4	Truist Financial Corp	Truist 金融公 司	TFC UN	纽约证 券交易 所	美国	240	74,839.87	0.04
43 5	Fifth Third Bancorp	五三银 行	FITB UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	246	74,765.69	0.04
43 6	Procter & Gamble Co/The	宝洁	PG UN	纽约证 券交易 所	美国	62	74,718.39	0.04
43 7	Shanghai Foreign Service Holding Group Co Ltd	上海外 服控股 集团股 份有限 公司	600662 CH	上海证 券交易 所	中国	14,700	74,529.00	0.04
43 8	Wendel SE	温德尔 集团	MF FP	巴黎证 券交易 所	法国	106	74,148.46	0.04
43 9	Sterling Infra structure Inc	Sterling 基 础设施 股份有 限公司	STRL UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	61	73,864.04	0.04
44 0	Coherent Corp	相干公 司	COHR UN	纽约证 券交易 所	美国	106	72,181.46	0.04
44 1	CH Robin son Worl dwide Inc	罗宾逊 全球物 流有限 公司	CHRW UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	97	72,042.43	0.04
44 2	Newmont Corp	纽蒙黄 金公司	NEM UN	纽约证 券交易 所	美国	269	71,971.55	0.04
44	CyberArk	CyberA	CYBR UW	纳斯达	美国	30	71,844.46	0.04

3	Software Ltd	rk 软件有限公司		克证券交易所				
444	Sumec Corp Ltd	苏美达股份有限公司	600710 CH	上海证券交易所	中国	7,700	71,610.00	0.04
445	Victory Giant Technology Huizhou Co Ltd	胜宏科技(惠州)股份有限公司	300476 CH	深圳证券交易所	中国	1,700	71,553.00	0.04
446	Encompass Health Corp	南方保健公司	EHC UN	纽约证券交易所	美国	107	71,031.82	0.04
447	Fastenal Co	法思诺公司	FAST UW	纳斯达克证券交易所	美国	137	70,817.74	0.04
448	Vita Coco Co Inc/The	Vita Coco Co Inc/The	COCO UW	纳斯达克证券交易所	美国	265	70,310.82	0.04
449	AVICOPTER PLC	中航直升机股份有限公司	600038 CH	上海证券交易所	中国	1,800	69,408.00	0.04
450	Foxconn Industrial Internet Co Ltd	富士康工业互联网股份有限公司	601138 CH	上海证券交易所	中国	3,200	68,800.00	0.04
451	Fuyao Glass Industry Group Co Ltd	福耀玻璃工业集团股份有限公司	600660 CH	上海证券交易所	中国	1,100	68,640.00	0.04
452	TEGNA Inc	TEGNA 股份有限公司	TGNA UN	纽约证券交易所	美国	522	68,630.39	0.04
453	O'Reilly Automotive Inc	O'Reilly 汽车股份有限公司	ORLY UW	纳斯达克证券交易所	美国	8	68,192.04	0.04
454	Global Business	Global Busi	GBTG UN	纽约证券交易所	美国	1,015	67,708.98	0.04

	Travel Group I	ness Travel Group I		所				
455	CNO Financial Group Inc	CNO 金融集团公司	CNO UN	纽约证券交易所	美国	247	66,067.65	0.04
456	Yangtze Optical Fibre & Cable Joint Stock Ltd Co	长飞光纤光缆股份有限公司	601869 CH	上海证券交易所	中国	2,200	65,758.00	0.04
457	UGI Corp	UGI 公司	UGI UN	纽约证券交易所	美国	324	65,748.84	0.04
458	EPAM Systems Inc	EPAM 系统公司	EPAM UN	纽约证券交易所	美国	39	65,550.88	0.04
459	InterContinental Hotels Group PLC	洲际酒店集团	IHG LN	伦敦证券交易所	英国	71	64,146.71	0.04
460	Aristocrat Leisure Ltd	Aristocrat 休闲有限公司	ALL AT	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	208	64,084.49	0.04
461	AXA SA	安盛集团	CS FP	巴黎证券交易所	法国	246	63,537.38	0.04
462	SoFi Technologies Inc	SoFi Technologies 股份有限公司	SOFI UW	纳斯达克证券交易所	美国	573	63,431.88	0.04
463	ASM International NV	ASM 国际有限公司	ASM NA	阿姆斯特丹交易所	荷兰	15	63,080.42	0.04
464	Aegon Ltd	荷兰全球保险集团	AGN NA	阿姆斯特丹交易所	荷兰	1,444	62,159.87	0.04

465	Merit Medical Systems Inc	Merit 医疗系统股份有限公司	MMSI UW	纳斯达克证券交易所	美国	89	61,878.32	0.04
466	Publicis Groupe SA	阳狮集团股份有限公司	PUB FP	巴黎证券交易所	法国	78	60,461.47	0.03
467	Block Inc	Block 股份有限公司	SQ UN	纽约证券交易所	美国	98	59,872.33	0.03
468	Vitesse Energy Inc	Vitesse Energy Inc	VTS UN	纽约证券交易所	美国	333	59,843.43	0.03
469	Intesa Sanpaolo SpA	意大利联合圣保罗银行股份有限公司	ISP IM	意大利证券交易所	意大利	2,032	59,073.89	0.03
470	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	慕尼黑再保险公司	MUV2 GY	德国证券交易所	德国	16	58,652.30	0.03
471	Comfort Systems USA Inc	美国舒适系统公司	FIX UN	纽约证券交易所	美国	19	57,917.95	0.03
472	Hithink RoyalFlush Information Network Co Ltd	浙江核新同花顺网络信息股份有限公司	300033 CH	深圳证券交易所	中国	200	57,500.00	0.03
473	DuPont de Nemours Inc	杜邦公司	DD UN	纽约证券交易所	美国	104	57,004.01	0.03
474	Toho Co Ltd/Tokyo	东宝	9602 JT	日本证券交易所	日本	200	56,903.58	0.03

				所				
47 5	Semicondu ctor M anufactur ing Inte rnational Corp	中芯国 际集成 电路制 造有限 公司	688981 CH	上海证 券交易 所	中国	600	56,772.00	0.03
47 6	NetApp Inc	美国网 域存储 技术有 限公司	NTAP UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	68	56,741.20	0.03
47 7	Aflac Inc	家庭人 寿保险	AFL UN	纽约证 券交易 所	美国	76	56,511.18	0.03
47 8	RadNet Inc	RadNet 股份有 限公司	RDNT UQ	纳斯达 克证券 交易所	美国	108	54,220.09	0.03
47 9	Ensign Group Inc/The	Ensign 集团股 份有限 公司	ENSG UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	56	53,482.85	0.03
48 0	COSCO SH IPPING Holdings Co Ltd	中远海 运控股 股份有 限公司	601919 CH	上海证 券交易 所	中国	3,400	52,700.00	0.03
48 1	Bandai N amco Hol dings Inc	万代南 梦宫控 股公司	7832 JT	日本证 券交易 所	日本	300	52,414.35	0.03
48 2	Chefs' W arehouse Inc/The	Chefs' W arehous e 股份 有限公 司	CHEF UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	146	51,761.66	0.03
48 3	LPL Fina ncial Holdings Inc	LPL 金 融控股 公司	LPLA UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	22	51,635.86	0.03
48 4	Leonardo SpA	Leonar do 公共 有限公 司	LDO IM	意大利 证券交 易所	意大利	264	51,517.33	0.03
48	Dropbox	Dropbo	DBX UW	纳斯达	美国	238	51,393.61	0.03

5	Inc	x 股份 有限公司		克证券 交易所				
48 6	Boot Barn Holdings Inc	Boot Barn 控 股有限 公司	BOOT UN	纽约证 券交易 所	美国	47	51,293.12	0.03
48 7	Snap-on Inc	实耐宝	SNA UN	纽约证 券交易 所	美国	21	51,246.68	0.03
48 8	ResMed Inc	瑞思迈 股份有 限公司	RMD UN	纽约证 券交易 所	美国	31	50,961.37	0.03
48 9	Toray Industrie s Inc	东丽	3402 JT	日本证 券交易 所	日本	1,100	50,932.58	0.03
49 0	Knife River Corp	Knife River Corp	KNF UN	纽约证 券交易 所	美国	69	50,413.40	0.03
49 1	Workiva Inc	Workiv a 股份 有限公 司	WK UN	纽约证 券交易 所	美国	64	50,376.31	0.03
49 2	Schindler Holding AG	迅达控 股有限 公司	SCHP SE	瑞士证 券交易 所	瑞士	25	50,065.60	0.03
49 3	MonotaRO Co Ltd	Monota RO 有限 公司	3064 JT	日本证 券交易 所	日本	400	49,413.83	0.03
49 4	Qantas Airways Ltd	澳大利 亚航空 有限公 司	QAN AT	澳大利 亚证券 交易所	澳 大 利亚	1,209	48,877.20	0.03
49 5	Ferrari NV	法拉利	RACE UN	纽约证 券交易 所	美国	16	48,862.72	0.03
49 6	Northern Trust Corp	北美信 托	NTRS UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	66	48,629.53	0.03
49 7	Molson C oors Bev erage Co	莫尔森 库尔斯 饮料公 司	TAP UN	纽约证 券交易 所	美国	116	47,796.53	0.03
49	Talen	Talen	TLN UW	纳斯达	美国	33	47,792.15	0.03

8	Energy Corp	能源公司		克证券交易所				
499	Viant Technology Inc	Viant Technology Inc	DSP UN	纳斯达克证券交易所	美国	350	47,777.70	0.03
500	George Weston Ltd	乔治韦斯顿有限公司	WN CT	加拿大证券交易所	加拿大	42	47,410.96	0.03
501	Ecolab Inc	艺康集团	ECL UN	纽约证券交易所	美国	28	47,162.80	0.03
502	Corning Inc	康宁公司	GLW UN	纽约证券交易所	美国	138	47,139.80	0.03
503	Packaging Corp of America	美国包装公司	PKG UN	纽约证券交易所	美国	29	46,931.41	0.03
504	Teledyne Technologies Inc	Teledyne 科技股份有限公司	TDY UN	纽约证券交易所	美国	14	46,708.93	0.03
505	OGE Energy Corp	OGE 能源公司	OGE UN	纽约证券交易所	美国	157	46,553.88	0.03
506	Duke Energy Corp	杜克能源	DUK UN	纽约证券交易所	美国	60	46,468.69	0.03
507	AIB Group PLC	爱尔兰联合银行集团公共有限公司	AIBG ID	爱尔兰证券交易所	爱尔兰	1,157	46,409.56	0.03
508	Invesco Ltd	景顺有限公司	IVZ UN	纽约证券交易所	美国	367	46,114.74	0.03
509	M&T Bank Corp	M&T 银行	MTB UN	纽约证券交易所	美国	34	45,950.70	0.03
510	Suncorp Group Ltd	Suncorp-Metway 有限公司	SUN AT	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	536	45,923.45	0.03

51 1	Lazard Inc	Lazard 股份有 限公司	LAZ UN	纽约证 券交易 所	美国	123	45,517.24	0.03
51 2	Broadridg e Financ ial So lutions Inc	布罗德 里奇金 融解决 方案股 份有限 公司	BR UN	纽约证 券交易 所	美国	28	45,506.31	0.03
51 3	Youngor Fashion Co Ltd	雅戈尔 时尚股 份有限 公司	600177 CH	上海证 券交易 所	中国	5,100	45,390.00	0.03
51 4	Travel + Leisure Co	Travel + Leisur e 公司	TNL UN	纽约证 券交易 所	美国	125	45,331.85	0.03
51 5	American Financi al Gro up Inc/O H	美国金 融集团 公司/ 俄亥俄 州	AFG UN	纽约证 券交易 所	美国	46	45,278.15	0.03
51 6	Pinnacle West C apital Corp	Pinnac le 西 部资本	PNW UN	纽约证 券交易 所	美国	74	45,092.69	0.03
51 7	Waste Connectio ns Inc	Waste Co nnecti ons 股 份有限 公司	WCN CT	加拿大 证券交 易所	加 拿 大	36	44,830.10	0.03
51 8	Astera Labs Inc	Astera Labs Inc	ALAB UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	47	44,748.87	0.03
51 9	PulteGrou p Inc	Pulte 集团公 司	PHM UN	纽约证 券交易 所	美国	57	44,620.56	0.03
52 0	Home Ban cShares Inc/AR	阿肯色 Home BancSh ares 公 司	HOMB UN	纽约证 券交易 所	美国	218	44,348.11	0.03
52 1	Valmont Industrie	维蒙特 工业公	VMI UN	纽约证 券交易	美国	20	44,089.33	0.03

	s Inc	司		所				
52 2	Taylor Morrison Home Corp	Taylor Morrison 房屋公司	TMHC UN	纽约证券交易所	美国	100	44,000.20	0.02
52 3	PG&E Corp	太平洋煤气电力	PCG UN	纽约证券交易所	美国	300	43,518.57	0.02
52 4	Natural Grocers by Vitamin Cottage Inc	Natural Grocers by Vitamin Cottage 股份有限公司	NGVC UN	纽约证券交易所	美国	152	43,399.53	0.02
52 5	Regions Financial Corp	Regions 金融公司	RF UN	纽约证券交易所	美国	254	42,944.08	0.02
52 6	Advantest Corp	爱德万测试	6857 JT	日本证券交易所	日本	100	42,525.11	0.02
52 7	Linde PLC	Linde PLC	LIN UW	纳斯达克证券交易所	美国	14	42,133.94	0.02
52 8	China Life Insurance Co Ltd	中国人寿保险股份有限公司	2628 HK	香港证券交易所	中国香港	3,000	40,782.80	0.02
52 9	National Bank of Canada	加拿大国民银行	NA CT	加拿大证券交易所	加拿大	61	40,365.27	0.02
53 0	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	40	39,959.06	0.02
53 1	Moog Inc	穆格公司	MOG/A UN	纽约证券交易所	美国	28	39,619.01	0.02
53 2	Xometry Inc	Xometry Inc	XMTR UW	纳斯达克证券交易所	美国	129	39,558.77	0.02
53	Altair E	Altair	ALTR UW	纳斯达克	美国	50	39,216.32	0.02

3	ngineerin g Inc	En gineer ing 股 份有限 公司		克 证 券 交 易 所				
53 4	London S tock Exc hange Group PL C	伦敦证 券交易 所	LSEG LN	伦 敦 证 券 交 易 所	英 国	37	37,898.47	0.02
53 5	Banco BPM SpA	BPM 银 行公共 有限公司	BAMI IM	意 大 利 证 券 交 易 所	意 大 利	643	37,802.49	0.02
53 6	China Ra ilway Construct ion Corp Ltd	中国铁 建股份 有限公司	1186 HK	香 港 证 券 交 易 所	中 国 香 港	7,000	37,143.46	0.02
53 7	Crowdstri ke Holdi ngs Inc	CrowdS trike 控股股 份有限 公司	CRWD UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	15	36,893.74	0.02
53 8	Tapestry Inc	TPR-DR S-RS	TPR UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	78	36,630.22	0.02
53 9	Imeik Te chnology Devel opment C o Ltd	爱美客 技术发 展股份 有限公司	300896 CH	深 圳 证 券 交 易 所	中 国	200	36,500.00	0.02
54 0	Argenx SE	Argenx 公司	ARGX BB	布 鲁 塞 尔 证 券 交 易 所	比 利 时	8	36,123.36	0.02
54 1	Prudentia l Financ ial Inc	保德信 金融集 团	PRU UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	42	35,785.72	0.02
54 2	DXP Ente rprises Inc/TX	德克萨 斯州 DXP Ente rprise s 公司	DXPE UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	60	35,634.34	0.02

543	Armstrong World Industries Inc	阿姆斯壮世界工业有限公司	AWI UN	纽约证券交易所	美国	35	35,557.78	0.02
544	Accenture PLC	埃森哲公司	ACN UN	纽约证券交易所	美国	14	35,403.30	0.02
545	Bath & Body Works Inc	Bath & Body Works 股份有限公司	BBWI UN	纽约证券交易所	美国	126	35,115.48	0.02
546	Clorox Co/The	高乐氏公司	CLX UN	纽约证券交易所	美国	30	35,024.04	0.02
547	AvePoint Inc	AvePoint Inc	AVPT UW	纳斯达克证券交易所	美国	295	35,010.74	0.02
548	Hermes International SCA	爱马仕国际股份有限公司合伙企业	RMS FP	巴黎证券交易所	法国	2	34,949.35	0.02
549	Primo Brands Corp	Primo Brands Corp	PRMB UN	纽约证券交易所	美国	158	34,947.56	0.02
550	Esquire Financial Holdings Inc	Esquire Financial Holdings Inc	ESQ UR	纳斯达克证券交易所	美国	61	34,860.15	0.02
551	Five Below Inc	Five Below 股份有限公司	FIVE UW	纳斯达克证券交易所	美国	46	34,706.75	0.02
552	Johnson Controls International plc	江森自控国际有限公司	JCI UN	纽约证券交易所	美国	61	34,610.21	0.02
553	FactSet Research Systems	FactSet 研究系统股	FDS UN	纽约证券交易所	美国	10	34,524.45	0.02

	ms Inc	份有限公司						
554	Rush Street Interactive Inc	Rush Street Interactive Inc	RSI UN	纽约证券交易所	美国	350	34,518.70	0.02
555	Ares Management Corp	阿瑞斯管理公司	ARES UN	纽约证券交易所	美国	27	34,359.19	0.02
556	Jabil Inc	捷普集团	JBL UN	纽约证券交易所	美国	33	34,135.56	0.02
557	Planet Fitness Inc	Planet Fitness 股份有限公司	PLNT UN	纽约证券交易所	美国	48	34,114.42	0.02
558	Cincinnati Financial Corp	辛辛那提金融	CINF UW	纳斯达克证券交易所	美国	33	34,088.11	0.02
559	GEO Group Inc/The	GEO 集团公司	GEO UN	纽约证券交易所	美国	169	33,991.21	0.02
560	OneSpaWorld Holdings Ltd	OneSpaWorld Holdings Ltd	OSW UR	纳斯达克证券交易所	美国	237	33,902.65	0.02
561	Thomson Reuters Corp	汤森路透	TRI CT	加拿大证券交易所	加拿大	29	33,802.25	0.02
562	Robinhood Markets Inc	罗宾汉市场股份公司	HOOD UW	纳斯达克证券交易所	美国	126	33,747.81	0.02
563	ia Financial Corp Inc	ia Financial Corp 股份有限公司	IAG CT	加拿大证券交易所	加拿大	50	33,661.97	0.02
564	Intapp Inc	Intapp Inc	INTA UW	纳斯达克证券交易所	美国	73	33,631.43	0.02

				交易所				
56 5	Cisco Systems Inc	思科	CSCO UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	79	33,618.71	0.02
56 6	CoreCivic Inc	CoreCivic 股份有限公司	CXW UN	纽约证 券交易 所	美国	215	33,599.30	0.02
56 7	Marsh & McLennan Cos Inc	Marsh & McLennan 股份有限公司	MMC UN	纽约证 券交易 所	美国	22	33,591.54	0.02
56 8	Onto Innovation Inc	Onto 创新股份有限公司	ONTO UN	纽约证 券交易 所	美国	28	33,546.54	0.02
56 9	Interface Inc	英特飞 股份有 限公司	TILE UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	191	33,432.17	0.02
57 0	General Motors Co	通用汽 车公司	GM UN	纽约证 券交易 所	美国	87	33,314.57	0.02
57 1	Adtalem Global Educati on Inc	Adtalem 环球 教育股 份有限 公司	ATGE UN	纽约证 券交易 所	美国	51	33,306.37	0.02
57 2	CRH PLC	CRH 公 共股份 公司	CRH UN	纽约证 券交易 所	美国	50	33,253.54	0.02
57 3	Hubbell Inc	哈贝尔 公司	HUBB UN	纽约证 券交易 所	美国	11	33,122.64	0.02
57 4	Five9 Inc	Five9 股份有限公司	FIVN UQ	纳斯达 克证券 交易所	美国	113	33,011.43	0.02
57 5	PJT Partners Inc	PJT 合 伙股份 有限公 司	PJT UN	纽约证 券交易 所	美国	29	32,897.64	0.02
57 6	Walt Disney	华特迪 士尼公	DIS UN	纽约证 券交易	美国	41	32,817.56	0.02

	Co/The	司		所				
577	Hannover Rueck SE	汉诺威再保险有限公司	HNR1 GY	德国证券交易所	德国	18	32,700.67	0.02
578	Vimeo Inc	Vimeo Inc	VME0 UW	纳斯达克证券交易所	美国	710	32,664.09	0.02
579	Garmin Ltd	佳明有限公司	GRMN UN	纽约证券交易所	美国	22	32,618.95	0.02
580	Kellanova	Kellanova	K UN	纽约证券交易所	美国	56	32,594.51	0.02
581	3M Co	3M 公司	MMM UN	纽约证券交易所	美国	35	32,478.27	0.02
582	Universal Health Services Inc	Universal 保健服务股份有限公司	UHS UN	纽约证券交易所	美国	25	32,243.57	0.02
583	Hanesbrands Inc	Hanesbrands 股份有限公司	HBI UN	纽约证券交易所	美国	549	32,123.95	0.02
584	Masimo Corp	Masimo 公司	MASI UW	纳斯达克证券交易所	美国	27	32,082.55	0.02
585	Waters Corp	沃特世公司	WAT UN	纽约证券交易所	美国	12	32,001.03	0.02
586	MDU Resources Group Inc	MDU 资源集团股份有限公司	MDU UN	纽约证券交易所	美国	246	31,865.60	0.02
587	Wintrust Financial Corp	Wintrust 金融公司	WTFC UW	纳斯达克证券交易所	美国	35	31,376.29	0.02
588	PPL Corp	PPL 公司	PPL UN	纽约证券交易所	美国	134	31,266.95	0.02
58	Aurora	Aurora	AUR UW	纳斯达克	美国	687	31,112.11	0.02

9	Innovation Inc	Innovation Inc		克证券交易所				
590	Trimble Inc	天宝股份有限公司	TRMB UW	纳斯达克证券交易所	美国	61	30,983.87	0.02
591	RLI Corp	RLI 公司	RLI UN	纽约证券交易所	美国	26	30,806.46	0.02
592	Arch Capital Group Ltd	阿契资本集团	ACGL UW	纳斯达克证券交易所	美国	46	30,537.04	0.02
593	First Citizens BancShares Inc/NC	第一公民银行（北卡）	FCNCA UW	纳斯达克证券交易所	美国	2	30,378.47	0.02
594	Chevron Corp	雪佛龙	CVX UN	纽约证券交易所	美国	29	30,193.87	0.02
595	China Taiping Insurance Holdings Co Ltd	中国太平保险控股有限公司	966 HK	香港证券交易所	中国香港	2,800	30,129.64	0.02
596	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	43	29,599.53	0.02
597	Avnet Inc	安富利股份有限公司	AVT UW	纳斯达克证券交易所	美国	78	29,335.57	0.02
598	Toyota Motor Corp	丰田汽车	7203 JT	日本证券交易所	日本	200	29,089.80	0.02
599	Obayashi Corp	大林组	1802 JT	日本证券交易所	日本	300	29,029.70	0.02
600	RELX PLC	励讯集团	REL LN	伦敦证券交易所	英国	87	28,656.60	0.02
601	Cohen & Steers Inc	Cohen & Steers	CNS UN	纽约证券交易所	美国	43	28,542.40	0.02

		股份有限公司						
602	Clearwater Analytics Holdings Inc	Clearwater Analytics Holdings Inc	CWAN UN	纽约证券交易所	美国	144	28,486.77	0.02
603	Synovus Financial Corp	Synovus 金融	SNV UN	纽约证券交易所	美国	76	27,987.89	0.02
604	Atmus Filtration Technologies Inc	Atmus Filtration Technologies Inc	ATMU UN	纽约证券交易所	美国	99	27,882.51	0.02
605	BellRing Brands Inc	BellRing Brands Inc	BRBR UN	纽约证券交易所	美国	51	27,620.28	0.02
606	Coca-Cola Europacific Partners PLC	可口可乐欧洲合伙公开股份公司	CCEP UW	纳斯达克证券交易所	美国	50	27,607.05	0.02
607	ARM Holdings PLC	ARM Holdings PLC	ARM UW	纳斯达克证券交易所	美国	31	27,489.59	0.02
608	Manhattan Associates Inc	曼哈顿联合软件公司	MANH UW	纳斯达克证券交易所	美国	14	27,196.31	0.02
609	Tokio Marine Holdings Inc	东京海上控股株式会社	8766 JT	日本证券交易所	日本	100	26,482.26	0.02
610	Westpac Banking Corp	西太平洋银行公司	WBC AT	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	181	26,365.59	0.01
611	Toast Inc	Toast 股份有限公司	TOST UN	纽约证券交易所	美国	100	26,201.72	0.01

61 2	Guangdong Marubi Biote chnology Co Ltd	广东丸 美生物 技术股 份有限 公司	603983 CH	上海证 券交易 所	中国	800	25,808.00	0.01
61 3	Tyson Foods Inc	泰森食 品公司	TSN UN	纽约证 券交易 所	美国	62	25,599.91	0.01
61 4	JD.com Inc	京东集 团股份 有限公 司	9618 HK	香港证 券交易 所	中 国 香港	200	25,188.29	0.01
61 5	Accor SA	雅高股 份公司	AC FP	巴黎证 券交易 所	法国	71	25,134.63	0.01
61 6	Mirion T echnologi es Inc	Mirion Tech nologi es Inc	MIR UN	纽约证 券交易 所	美国	200	25,087.52	0.01
61 7	Revelyst Inc	Revely st Inc	GEAR UN	纽约证 券交易 所	美国	179	24,743.69	0.01
61 8	Daiwa Se curities Group Inc	大和证 券	8601 JT	日本证 券交易 所	日本	500	24,226.09	0.01
61 9	CITIC Se curities Co L td	中信证 券股份 有限公 司	600030 CH	上海证 券交易 所	中国	800	23,336.00	0.01
62 0	Yunnan A luminium Co L td	云南铝 业股份 有限公 司	000807 CH	深圳证 券交易 所	中国	1,700	23,001.00	0.01
62 1	NN Group NV	NN 集团 公众有 限公司	NN NA	阿姆斯特 丹交易 所	荷兰	69	21,845.83	0.01
62 2	Pilgrim's Pride Corp	Pilgri m's Pride 公司	PPC UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	66	21,534.58	0.01
62 3	Tesco PLC	特易购	TSCO LN	伦敦证 券交易 所	英国	629	21,026.71	0.01

62 4	ROBLOX Corp	Roblox 公司	RBLX UN	纽约证 券交易 所	美国	50	20,796.04	0.01
62 5	Arthur J Gallagher & Co	亚瑟加拉格尔 有限公司	AJG UN	纽约证 券交易 所	美国	10	20,404.27	0.01
62 6	Northrop Grumman Corp	诺斯洛 普格鲁 门公司	NOC UN	纽约证 券交易 所	美国	6	20,240.67	0.01
62 7	KeyCorp	KeyCorp 公司	KEY UN	纽约证 券交易 所	美国	164	20,206.30	0.01
62 8	SITC International Holdings Co Ltd	海丰国际控股 有限公司	1308 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	1,000	19,169.03	0.01
62 9	LVMH Moët Hennessey Louis Vuitton SE	LVMH 集团 公司	MC FP	巴黎证 券交易 所	法国	4	19,130.33	0.01
63 0	Japan Tobacco Inc	日本烟草产业 株式会社	2914 JT	日本证 券交易 所	日本	100	18,863.06	0.01
63 1	Darden Restaurants Inc	达登餐 饮公司	DRI UN	纽约证 券交易 所	美国	14	18,788.03	0.01
63 2	Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc	Ulta 美 容产品 公司	ULTA UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	6	18,758.70	0.01
63 3	BXP Inc	波士顿 地产公 司	BXP UN	纽约证 券交易 所	美国	35	18,708.53	0.01
63 4	COSCO SHIPPING Development Co Ltd	中远海 运发展 股份有 限公司	2866 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	19,000	18,298.55	0.01
63 5	John Bean Tech	卓缤科 技公司	JBT UN	纽约证 券交易	美国	20	18,272.91	0.01

	nologies Corp			所				
636	CareTrust REIT Inc	CareTrust REIT 有限公司	CTRE UN	纽约证券交易所	美国	93	18,083.50	0.01
637	Edwards Lifesciences Corp	爱德华生命科学公司	EW UN	纽约证券交易所	美国	33	17,561.19	0.01
638	Vail Resorts Inc	范尔度假村股份有限公司	MTN UN	纽约证券交易所	美国	13	17,517.05	0.01
639	Hewlett Packard Enterprise Co	慧与公司	HPE UN	纽约证券交易所	美国	114	17,495.85	0.01
640	Paychex Inc	Paychex 公司	PAYX UW	纳斯达克证券交易所	美国	17	17,135.28	0.01
641	Veracyte Inc	Veracyte 股份有限公司	VCYT UQ	纳斯达克证券交易所	美国	60	17,079.64	0.01
642	Sysco Corp	Sysco 公司	SYN UN	纽约证券交易所	美国	31	17,038.38	0.01
643	Infinera Corp	Infinera 公司	INFN UW	纳斯达克证券交易所	美国	360	17,002.00	0.01
644	Sinotrans Ltd	中国外运股份有限公司	598 HK	香港证券交易所	中国香港	5,000	16,992.83	0.01
645	A10 Networks Inc	A10 网络公司	ATEN UN	纽约证券交易所	美国	127	16,797.85	0.01
646	FormFactor Inc	FormFactor 股份有限公司	FORM UW	纳斯达克证券交易所	美国	53	16,763.35	0.01
647	United Airlines	美国联合航空	UAL UW	纳斯达克证券交易所	美国	24	16,751.85	0.01

	Holding s Inc	控股股 份有限 公司		交易所				
64 8	Dayforce Inc	Dayfor ce 股份 有限公司	DAY UN	纽约证 券交易 所	美国	32	16,709.29	0.01
64 9	PriceSmar t Inc	PriceS mart 股 份有限 公司	PSMT UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	25	16,563.87	0.01
65 0	West Pha rmaceutic al Ser vices In c	西氏医 药服务 公司	WST UN	纽约证 券交易 所	美国	7	16,482.43	0.01
65 1	Kratos D efense & Secu rity Sol utions I nc	Kratos 国防与 安全解 决方案 公司	KTOS UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	86	16,308.18	0.01
65 2	Addus HomeCare Corp	爱德斯 家庭护 理公司	ADUS UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	18	16,219.19	0.01
65 3	National Fuel Gas Co	国家燃 气公司	NFG UN	纽约证 券交易 所	美国	37	16,139.11	0.01
65 4	HEICO Corp	海科航 空公司	HEI/A UN	纽约证 券交易 所	美国	12	16,051.41	0.01
65 5	Cavco Industrie s Inc	Cavco 工业股 份有限 公司	CVCO UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	5	16,038.40	0.01
65 6	Evercore Inc	Everco re 股份 有限公司	EVR UN	纽约证 券交易 所	美国	8	15,940.42	0.01
65 7	Super Mi cro Comp uter I nc	Super Micr o C ompute r 股份 有限公	SMCI UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	72	15,775.38	0.01

		司						
658	NIKE Inc	耐克公司	NKE UN	纽约证券交易所	美国	29	15,774.44	0.01
659	RB Global Inc	利氏兄弟全球股份有限公司	RBA CT	加拿大证券交易所	加拿大	24	15,723.87	0.01
660	Choice Hotels International Inc	精品国际酒店集团	CHH UN	纽约证券交易所	美国	15	15,309.14	0.01
661	Grand Canyon Education Inc	Grand Canyon 教育股份有限公司	LOPE UW	纳斯达克证券交易所	美国	13	15,306.98	0.01
662	ENEOS Holdings Inc	ENEOS 控股株式会社	5020 JT	日本证券交易所	日本	400	15,280.93	0.01
663	Ryan Specialty Holdings Inc	Ryan Specialty 控股股份有限公司	RYAN UN	纽约证券交易所	美国	32	14,758.65	0.01
664	Molina Healthcare Inc	Molina Healthcare 股份有限公司	MOH UN	纽约证券交易所	美国	7	14,645.29	0.01
665	Dave Inc	Dave Inc	DAVE UQ	纳斯达克证券交易所	美国	23	14,370.76	0.01
666	Meituan	美团	3690 HK	香港证券交易所	中国香港	100	14,048.03	0.01
667	Resideo Technologies Inc	Resideo Technologies Inc	REZI UN	纽约证券交易所	美国	84	13,918.18	0.01
668	Toll Brothers	托尔兄弟公司	TOL UN	纽约证券交易所	美国	15	13,580.68	0.01

	Inc			所				
669	Seres Group Co Ltd	赛力斯集团股份有限公司	601127 CH	上海证券交易所	中国	100	13,339.00	0.01
670	Jangho Group Co Ltd	江河创建集团股份有限公司	601886 CH	上海证券交易所	中国	2,400	12,960.00	0.01
671	SharkNinja Inc	SharkNinja Inc	SN UN	纽约证券交易所	美国	18	12,597.53	0.01
672	TE Connectivity PLC	TE Connectivity 公共有限公司	TEL UN	纽约证券交易所	美国	12	12,332.71	0.01
673	Concordia Financial Group Ltd	Concordia 金融集团有限公司	7186 JT	日本证券交易所	日本	300	12,082.07	0.01
674	Atmos Energy Corp	Atmos 能源公司	ATO UN	纽约证券交易所	美国	12	12,013.54	0.01
675	Yunnan Baiyao Group Co Ltd	云南白药集团股份有限公司	000538 CH	深圳证券交易所	中国	200	11,990.00	0.01
676	Revolve Group Inc	Revolve Group Inc	RVLV UN	纽约证券交易所	美国	49	11,796.24	0.01
677	Hartford Financial Services Group Inc/The	哈特福德金融服务	HIG UN	纽约证券交易所	美国	15	11,796.16	0.01
678	Energizer Holdings Inc	劲量控股股份有限公司	ENR UN	纽约证券交易所	美国	43	10,784.54	0.01
679	Lowe's Cos Inc	劳氏	LOW UN	纽约证券交易所	美国	6	10,644.58	0.01

680	Moelis & Co	Moelis 公司	MC UN	纽约证券交易所	美国	20	10,621.58	0.01
681	Fidelity National Information Services Inc	繁德信息技术有限公司	FIS UN	纽约证券交易所	美国	18	10,450.93	0.01
682	OppFi Inc	OppFi Inc	OPFI UN	纽约证券交易所	美国	163	8,975.29	0.01
683	Juniper Networks Inc	瞻博网络股份有限公司	JNPR UN	纽约证券交易所	美国	33	8,883.78	0.01
684	EnerSys	艾诺斯集团	ENS UN	纽约证券交易所	美国	13	8,637.51	0.00
685	RH	RH	RH UN	纽约证券交易所	美国	3	8,487.85	0.00
686	CEVA Inc	CEVA 股份有限公司	CEVA UW	纳斯达克证券交易所	美国	37	8,391.38	0.00
687	Teradyne Inc	泰瑞达	TER UW	纳斯达克证券交易所	美国	9	8,146.47	0.00
688	Cantaloupe Inc	Cantaloupe 股份有限公司	CTLP UW	纳斯达克证券交易所	美国	117	7,998.32	0.00
689	Rambus Inc	Rambus 股份有限公司	RMBS UW	纳斯达克证券交易所	美国	21	7,979.56	0.00
690	BrightSphere Investment Group Inc	BrightSphere 投资集团有限公司	BSIG UN	纽约证券交易所	美国	42	7,952.38	0.00
691	AvalonBay Communities Inc	AvalonBay 社区股份有限公司	AVB UN	纽约证券交易所	美国	5	7,906.16	0.00

69 2	Liquidity Service s Inc	流动性 服务股 份有限 公司	LQDT UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	34	7,891.86	0.00
69 3	United N atural F oods I nc	联合天 然食品 股份有 限公司	UNFI UN	纽约证 券交易 所	美国	40	7,852.61	0.00
69 4	UBS Group AG	瑞银集 团	UBSG SE	瑞士证 券交易 所	瑞士	34	7,540.39	0.00
69 5	Roku Inc	Roku 股 份有限 公司	ROKU UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	14	7,481.40	0.00
69 6	Thermo F isher Scientifi c Inc	Thermo Fisher Scienti fic 公 司	TMO UN	纽约证 券交易 所	美国	2	7,479.24	0.00
69 7	China Ra ilway Gr oup Ltd	中国中 铁股份 有限公 司	390 HK	香港证 券交易 所	中 国 香港	2,000	7,334.24	0.00
69 8	Fresenius SE & Co KGaA	费森尤 斯集团	FRE GY	德国证 券交易 所	德国	29	7,319.95	0.00
69 9	Eagle Materials Inc	鹰牌材 料有限 公司	EXP UN	纽约证 券交易 所	美国	4	7,095.24	0.00
70 0	Dollarama Inc	Dollar ama 股 份有限 公司	DOL CT	加拿大 证券交 易所	加 拿 大	10	7,083.86	0.00
70 1	Modine M anufactur ing Co	摩丁制 造公司	MOD UN	纽约证 券交易 所	美国	8	6,666.81	0.00
70 2	Brookfiel d Infr astruc ture Corp	Brookf ield Infr astruc ture Corp	BIPC UN	纽约证 券交易 所	美国	23	6,614.98	0.00
70	PVH Corp	PVH 公	PVH UN	纽约证	美国	8	6,081.39	0.00

3		司		券交易 所				
70 4	Southern Co/The	南方公 司	SO UN	纽约证 券交易 所	美国	10	5,917.49	0.00
70 5	Air Liquide SA	液化空 气集团	AI FP	巴黎证 券交易 所	法国	5	5,904.66	0.00
70 6	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	68	5,858.17	0.00
70 7	Enel SpA	意大利 国家电 力公司	ENEL IM	意大利 证券交 易所	意 大 利	112	5,804.05	0.00
70 8	Vertex Pharmac euticals Inc	福泰制 药	VRTX UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2	5,789.54	0.00
70 9	Merck & Co Inc	默克	MRK UN	纽约证 券交易 所	美国	8	5,720.82	0.00
71 0	United Rentals Inc	联合租 赁公司	URI UN	纽约证 券交易 所	美国	1	5,063.80	0.00
71 1	Copart Inc	Copart 股份有 限公司	CPRT UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	12	4,950.51	0.00
71 2	Legal & Genera l Grou p PLC	法通集 团公共 有限公司	LGEN LN	伦敦证 券交易 所	英国	232	4,839.05	0.00
71 3	Illumina Inc	Illumi na 公司	ILMN UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	5	4,802.93	0.00
71 4	Corteva Inc	科迪华 公司	CTVA UN	纽约证 券交易 所	美国	11	4,503.96	0.00
71 5	Texas Instrumen ts Inc	德州仪 器	TXN UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	3	4,043.69	0.00
71 6	ON Semicondu ctor Corp	安森美 半导体 公司	ON UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	8	3,625.83	0.00
71	Sodexo SA	索迪斯	SW FP	巴黎证	法国	6	3,592.02	0.00

7		股份有 限公司		券交易 所				
71 8	PDD Holdings Inc	拼多多	PDD UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	5	3,486.01	0.00
71 9	TransUnio n	环联有 限责任 公司	TRU UN	纽约证 券交易 所	美国	5	3,332.18	0.00
72 0	Insurance Austral ia Gro up Ltd	澳大利 亚保险 集团有 限公司	IAG AT	澳大利 亚证券 交易所	澳 大 利亚	80	3,050.34	0.00
72 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	3	2,460.90	0.00
72 2	Morningst ar Inc	晨星公 司	MORN UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1	2,420.77	0.00
72 3	ATI Inc	冶联科 技股份 有限公 司	ATI UN	纽约证 券交易 所	美国	6	2,373.90	0.00
72 4	Duolingo Inc	多邻国	DUOL UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1	2,330.69	0.00
72 5	British American Tobac co PLC	英美烟 草	BATS LN	伦敦证 券交易 所	英国	8	2,091.23	0.00
72 6	Matson Inc	美森股 份有限 公司	MATX UN	纽约证 券交易 所	美国	2	1,938.57	0.00
72 7	C3.ai Inc	C3.ai Inc	AI UN	纽约证 券交易 所	美国	7	1,732.48	0.00
72 8	NBT Bancorp Inc	NBT 银 行股份 有限公 司	NBTB UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	5	1,716.59	0.00
72 9	MKS Instrumen ts Inc	MKS Instru ments 股份有	MKSI UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2	1,500.79	0.00

		限公司						
730	Take-Two Interactive Software Inc	Take-Two 互动软件股份有限公司	TTWO UW	纳斯达克证券交易所	美国	1	1,323.24	0.00
731	Pinnacle Financial Partners Inc	Pinnacle 财务合伙人股份有限公司	PNFP UW	纳斯达克证券交易所	美国	1	822.28	0.00
732	T Rowe Price Group Inc	普徕仕	TROW UW	纳斯达克证券交易所	美国	1	812.94	0.00
733	Banco Santander SA	桑坦德	SAN SQ	西班牙证券交易所	西班牙	23	772.74	0.00
734	Carlyle Group Inc/The	凯雷集团股份有限公司	CG UW	纳斯达克证券交易所	美国	2	725.88	0.00
735	CarMax Inc	CarMax 股份有限公司	KMX UN	纽约证券交易所	美国	1	587.72	0.00

注：本表所使用的证券代码为彭博代码。

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	Alphabet Inc	GOOGL UW	1,740,659.89	1.06
1	Alphabet Inc	GOOG UW	1,393,691.66	0.85
2	Kweichow Moutai Co Ltd	600519 CH	2,412,856.00	1.47
3	Wuliangye Yibin Co Ltd	000858 CH	1,764,483.64	1.08
4	Berkshire Hathaway Inc	BRK/B UN	1,749,207.11	1.07
5	Industrial & Commercial Bank of China Ltd	601398 CH	1,708,188.00	1.04
6	Broadcom Inc	AVGO UW	1,610,435.53	0.98

7	Walmart Inc	WMT UN	1,575,026.13	0.96
8	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	601318 CH	1,531,632.00	0.93
8	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	2318 HK	40,513.73	0.02
9	Tesla Inc	TSLA UW	1,571,575.19	0.96
10	Eli Lilly & Co	LLY UN	1,568,958.83	0.96
11	Exxon Mobil Corp	XOM UN	1,466,893.96	0.90
12	Industrial Bank Co Ltd	601166 CH	1,398,670.00	0.85
13	Meta Platforms Inc	META UW	1,365,991.71	0.83
14	Celestica Inc	CLS UN	1,357,528.92	0.83
15	BOE Technology Group Co Ltd	000725 CH	1,346,230.00	0.82
16	Shanghai Pudong Development Bank Co Ltd	600000 CH	1,302,886.00	0.80
17	China Merchants Bank Co Ltd	600036 CH	1,191,232.00	0.73
17	China Merchants Bank Co Ltd	3968 HK	83,919.69	0.05
18	Mastercard Inc	MA UN	1,249,529.15	0.76
19	China Everbright Bank Co Ltd	601818 CH	1,235,056.00	0.75
20	China Yangtze Power Co Ltd	600900 CH	1,209,744.00	0.74

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	NVIDIA Corp	NVDA UW	6,498,108.95	3.97
2	Microsoft Corp	MSFT UW	4,509,929.83	2.75
3	Apple Inc	AAPL UW	4,203,928.38	2.57
4	Alphabet Inc	GOOGL UW	3,230,362.07	1.97
5	Advanced Micro Devices Inc	AMD UW	3,101,715.25	1.89
6	Eli Lilly & Co	LLY UN	2,673,730.24	1.63
7	Meta Platforms Inc	META UW	2,180,968.33	1.33
8	ASML Holding NV	ASML UW	1,686,565.95	1.03
8	ASML Holding NV	ASML NA	391,232.30	0.24
9	General Electric Co	GE UN	2,040,554.58	1.25

10	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	TSM UN	2,018,097.51	1.23
11	Tesla Inc	TSLA UW	1,586,438.52	0.97
12	Amazon.com Inc	AMZN UW	1,542,279.72	0.94
13	Wuliangye Yibin Co Ltd	000858 CH	1,502,386.88	0.92
14	Novo Nordisk A/S	NVO UN	1,109,526.36	0.68
14	Novo Nordisk A/S	NOVOB DC	383,392.60	0.23
15	China Everbright Bank Co Ltd	601818 CH	1,274,440.00	0.78
15	China Everbright Bank Co Ltd	6818 HK	140,050.41	0.09
16	Industrial Bank Co Ltd	601166 CH	1,411,671.00	0.86
17	Kweichow Moutai Co Ltd	600519 CH	1,407,959.00	0.86
18	China Railway Special Cargo Logistics Co Ltd	001213 CH	1,390,708.00	0.85
19	HSBC Holdings PLC	HSBA LN	1,086,223.10	0.66
19	HSBC Holdings PLC	5 HK	262,406.96	0.16
20	Applied Materials Inc	AMAT UW	1,285,175.87	0.78

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	308,597,625.44
卖出收入（成交）总额	330,682,311.83

注：8.5.1 项“买入金额”、8.5.2 项“卖出金额”及 8.5.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

债券信用等级	公允价值	占基金资产净值比例（%）
AAA	—	—
AA+	—	—
AA	—	—
AA-	—	—
A+	11,606,767.61	6.58
A	—	—
A-	—	—
BBB+	—	—

BBB	—	—
BBB-	—	—
BB+	—	—
BB	—	—
BB-	—	—
B+	—	—
B	—	—
B-	—	—
CCC+	—	—
CCC	—	—
CCC-	—	—

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

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019740	24 国债 09	5,300,000	5,366,960.05	3.04
2	019758	24 国债 21	4,600,000	4,620,137.92	2.62
3	019723	23 国债 20	700,000	710,122.38	0.40
4	019730	23 国债 27	500,000	506,442.60	0.29
5	019749	24 国债 15	400,000	403,104.66	0.23

注：数量列示债券面值，以外币计价的债券面值按照期末中国人民银行公布的人民币兑外币汇率中间价折算为人民币。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

无。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

无。

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	SPDR Gold Shares	ETF	交易型开放式	State Street Global Advisors Inc	320,257.02	0.18
2	Global X	ETF	交易型开放	Global X	67,217.87	0.04

	Artificial Intelligen ce & Technology ETF		式	Management Co LLC		
3	iShares MSCI India ETF	ETF	交易型开放 式	BlackRock Fund Advisors	35,190.96	0.02
4	Invesco QQQ Trust Series 1	ETF	交易型开放 式	Invesco Capital Management LLC	14,699.70	0.01
5	iShares MSCI ACWI ETF	ETF	交易型开放 式	BlackRock Fund Advisors	844.64	0.00

注：报告期末，本基金仅持有上述 5 只基金。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	8,238.38
2	应收清算款	23,839.99
3	应收股利	84,169.49
4	应收利息	-
5	应收申购款	639,043.85
6	其他应收款	183,248.32
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	938,540.03

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
嘉实全球价值股票（QDII）人民币	13,667	10,381.40	52,217,341.21	36.80	89,665,187.86	63.20
嘉实全球价值股票（QDII）美元现汇	43	2,977.24	—	—	128,021.34	100.00
合计	13,706	10,361.20	52,217,341.21	36.77	89,793,209.20	63.23

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	嘉实全球价值股票（QDII）人民币	849,993.44	0.60
	嘉实全球价值股票（QDII）美元现汇	—	—
	合计	849,993.44	0.60

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	嘉实全球价值股票（QDII）人民币	10~50
	嘉实全球价值股票（QDII）美元现汇	0
	合计	10~50

本基金基金经理持有 本开放式基金	嘉实全球价值股票（QDII） 人民币	10~50
	嘉实全球价值股票（QDII） 美元现汇	0
	合计	10~50

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

无。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实全球价值股票（QDII）人民币	嘉实全球价值股票（QDII）美元现汇
基金合同生效日 （2021 年 11 月 23 日）基金份额总额	237,958,337.73	281,215.89
本报告期期初基金份 额总额	160,486,513.62	249,499.68
本报告期基金总申购 份额	96,922,824.74	114,101.65
减：本报告期基金总 赎回份额	115,526,809.29	235,579.99
本报告期基金拆分变 动份额	—	—
本报告期期末基金份 额总额	141,882,529.07	128,021.34

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

（1）基金管理人的重大人事变动情况

2024 年 8 月 9 日本基金管理人发布公告，赵学军先生辞任公司董事长，由联席董事长安国勇先生代行公司董事长职责。

2024 年 9 月 19 日本基金管理人发布公告，安国勇先生任公司董事长。

2024 年 12 月 4 日本基金管理人发布公告，张峰先生离任公司副总经理、郭杰先生离任机构

首席投资官。

2024 年 12 月 19 日本基金管理人发布公告，鲁令飞先生任公司副总经理、张敏女士任公司副总经理。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、本基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。报告年度应支付安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费 23,000.00 元，该审计机构已连续 3 年为本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
野村证券 NOMURA	—	206,472,215.53	32.35	86,694.41	25.62	—
广发证券股份有限公司 GF Securities Co., Ltd	—	130,336,171.65	20.42	60,453.14	17.87	—
海通证券股份有限公司	—	82,134,768.56	12.87	53,049.66	15.68	—

公司 Haitong Securitie s CO., LTD						
摩根大通 证券（亚 太）有限公 司 J. P. Morga n Secu rities (Asia Pa cific) L imited	-	41,940,173.3 1	6.57	14,432.69	4.27	-
国盛证券 有限责任 公司 Guosheng Securit ies Co ., Ltd	-	35,855,919.3 2	5.62	23,159.59	6.84	-
长江证券 Changjian g Securi ties C ompany L imited	-	23,281,084.9 5	3.65	10,147.43	3.00	-
花旗环球 金融亚洲 有限公司 Citigroup Global Marke ts Asia Limited	-	18,806,154.4 1	2.95	6,377.73	1.88	-
东方财富 证券 Eastmoney Securit ies CO ., LTD	-	15,858,261.2 6	2.48	10,243.12	3.03	-
元大证券 （香港）有 限公司	-	15,096,431.1 5	2.37	29,658.16	8.77	-

Yuanta Securities (Hong Kong) Company Limited						
中信证券 CITIC Securities Co., Ltd	-	14,163,143.12	2.22	6,272.95	1.85	-
美林证券公司 Bank of America Merrill Lynch	-	14,088,652.96	2.21	10,054.31	2.97	-
国泰君安证券 Guotai Junan Securities Co., Ltd	-	13,348,209.00	2.09	5,818.95	1.72	-
极讯欧洲有限公司 Instinet Europe Limited	-	6,497,677.57	1.02	8,353.66	2.47	-
中国国际金融香港证券有限公司 China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	-	5,670,017.39	0.89	5,518.36	1.63	-
瑞银集团 Union Bank of	-	4,274,575.35	0.67	2,815.84	0.83	-

Switzerland						
招商证券 (香港)有限公司 China Merchants Securities (HK) Co., Ltd.	-	3,243,299.93	0.51	1,039.88	0.31	-
美林(亚太)有限公司 Merrill Lynch (Asia Pacific) Limited	-	2,345,370.64	0.37	1,646.09	0.49	-
里昂证券有限公司 CLSA Limited	-	2,008,191.41	0.31	805.86	0.24	-
高盛(亚洲)有限责任公司 Goldman Sachs (Asia) L.L.C	-	1,449,082.86	0.23	579.55	0.17	-
摩根士丹利亚洲有限公司 Morgan Stanley Asia Limited	-	587,994.83	0.09	291.60	0.09	-
富瑞金融集团 Jefferies Hong Kong Limited	-	557,197.59	0.09	835.80	0.25	-
国信证券股份有限公司	-	154,562.00	0.02	108.19	0.03	-

公司 GUOSEN SECURITIES CO., LTD.						
中国银河 证券股份 有限公司 China Galaxy International Financials Holdings	-	-	-	-	-	-
开源证券 Kaiyuan Securities CO., LTD	-	-	-	-	-	-
华兴证券 有限公司 China Renaissance Security	-	-	-	-	-	-
申万宏源 证券 Shenwan Hongyuan Securities CO., LTD	-	-	-	-	-	-
瑞士信贷 (香港)有 限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-
盛博香港 有限公司 Sanford C. Bernstein	-	-	-	-	-	-

(Hong Kong) Limited						
长城证券 Greatwall Securities Co., LTD	-	-	-	-	-	-
香港上海汇丰银行有限公司 The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	-	-	-	-	-	-
法国巴黎兴业银行 SOCIETE GENERALE Corporate and Investment Banking	-	-	-	-	-	-
信达国际证券有限公司 CINDA INTERNATIONAL SECURITIES LIMITED	-	-	-	-	-	-

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）合规风控能力较强；
- （4）研究、交易等服务能力较强；

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。

3. 本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致；本公司网站披露的《嘉实基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）》的报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日。敬请投资者关注上述报告统计时间区间的口径差异。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例(%)
野村证券 NOMURA	-	-	-	-	-	-	2,207,061.32	74.73
广发证券股份有限公司 GF Securities Co., Ltd	26,946,483.00	46.80	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司 Haitong Securities CO., LTD	24,423,736.00	42.42	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券（亚太）有限公司 J.P.Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-	172,333.73	5.84
国盛证券有限责任公司 Guosheng Securities Co., Ltd	1,700,912.00	2.95	-	-	-	-	-	-

长江证券 Changjiang Securities Company Limited	4,505,564.30	7.83	-	-	-	-	-	-
花旗环球金融亚洲有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券 Eastmoney Securities CO.,LTD	-	-	-	-	-	-	-	-
元大证券（香港）有限公司 Yuanta Securities (Hong Kong) Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券 CITIC Securities Co., Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
美林证券公司 Bank of America Merrill Lynch	-	-	-	-	-	-	273,961.77	9.28
国泰君安证券 Guotai Junan Securities Co., Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
极讯欧洲有限公司 Instinet Europe Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
中国国际金融香港证券有限公司 China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	-	-	-	-	-	-	253,655.24	8.59
瑞银集团 Union Bank of Switzerland	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券（香港）有限公司 China Merchants Securities (HK) Co., Ltd.	-	-	-	-	-	-	46,289.21	1.57
美林（亚太）有限公司 Merrill Lynch (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
里昂证券有限公司 CLSA Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛（亚洲）有限责任公司 Goldman Sachs (Asia) L.L.C	-	-	-	-	-	-	-	-
摩根士丹利亚洲有限公司 Morgan Stanley Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
富瑞金融集团 Jefferies Hong Kong Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司 GUOSEN SECURITIES CO.,LTD.	-	-	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司 China Galaxy International Financials Holdings	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券 Kaiyuan Securities CO.,LTD	-	-	-	-	-	-	-	-
华兴证券有限公司 China Renaissance Security	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券 Shenwan Hongyuan Securities CO.,LTD	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞士信贷（香港）有限公司 Credit Suisse	-	-	-	-	-	-	-	-

(Hong Kong) Limited								
盛博香港有限公司 Sanford C. Bernstein (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券 Greatwall Securities CO.,LTD	-	-	-	-	-	-	-	-
香港上海汇丰银行有限公司 The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
法国巴黎兴业银行 SOCIETE GENERALE Corporate and Investment Banking	-	-	-	-	-	-	-	-
信达国际证券有限公司 CINDA INTERNATIONAL SECURITIES LIMITED	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于嘉实全球价值股票（QDII）2024 年 1 月 15 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	2024 年 1 月 11 日
2	关于嘉实全球价值股票（QDII）2024 年 2 月 19 日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 2 月 7 日
3	嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）暂停大额申购（含定期定额投资）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	2024 年 3 月 23 日
4	关于嘉实全球价值股票（QDII）2024 年 3 月 29 日、4 月 1 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	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	2024 年 3 月 27 日
5	关于嘉实全球价值股票（QDII）2024 年 5 月 6 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	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	2024 年 4 月 29 日
6	关于嘉实全球价值股票（QDII）2024 年 5 月 27 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	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	2024 年 5 月 23 日
7	关于嘉实全球价值股票（QDII）2024 年 6 月 19 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	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	2024 年 6 月 17 日
8	关于嘉实全球价值股票（QDII）2024 年 7 月 4 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	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	2024 年 7 月 2 日
9	嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）调整大额申购（含定期定额投资）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	2024 年 7 月 12 日
10	关于嘉实全球价值股票（QDII）2024	中国证券报、基金管理	2024 年 8 月 22 日

	年 8 月 26 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
11	关于嘉实全球价值股票（QDII）2024 年 9 月 2 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	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	2024 年 8 月 29 日
12	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	2024 年 9 月 19 日
13	嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）调整大额申购（含定期定额投资）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	2024 年 11 月 14 日
14	关于嘉实全球价值股票（QDII）2024 年 11 月 28 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	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	2024 年 11 月 26 日
15	关于新增嘉实全球价值股票（QDII）基金经理的公告	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	2024 年 12 月 3 日
16	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	2024 年 12 月 4 日
17	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	2024 年 12 月 19 日
18	关于嘉实全球价值股票（QDII）2024 年 12 月 25 日、12 月 26 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	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	2024 年 12 月 23 日
19	嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）调整大额申购（含定期定额投资）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	2024 年 12 月 26 日

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- （1）中国证监会准予嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）注册的批复文件。
- （2）《嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）基金合同》；
- （3）《嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）托管协议》；
- （4）《嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）招募说明书》；
- （5）基金管理人业务资格批件、营业执照；
- （6）报告期内嘉实全球价值机会股票型证券投资基金（QDII）公告的各项原稿。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

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

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

嘉实基金管理有限公司

2025 年 3 月 28 日