

# 南方标普 500 交易型开放式指数证券 投资基金（QDII）2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2023 年 3 月 23 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

## 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	5
2.5 信息披露方式.....	5
2.6 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	11
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.10 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	15
§5 托管人报告.....	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 审计报告.....	16
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容.....	16
§7 年度财务报表.....	18
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	19
7.3 净资产变动表.....	21
7.4 报表附注.....	22
§8 投资组合报告.....	47
8.1 期末基金资产组合情况.....	47
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	48

8.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合.....	48
8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细.....	48
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	90
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	92
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.....	92
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细.....	92
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.....	92
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.....	92
8.11 投资组合报告附注.....	92
§9 基金份额持有人信息.....	93
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	93
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	93
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	94
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	94
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况.....	94
§10 开放式基金份额变动.....	94
§11 重大事件揭示.....	94
11.1 基金份额持有人大会决议.....	94
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.....	95
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	95
11.4 基金投资策略的改变.....	95
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	95
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.....	95
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	95
11.8 其他重大事件.....	97
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	99
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	99
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	99
§13 备查文件目录.....	100
13.1 备查文件目录.....	100
13.2 存放地点.....	100
13.3 查阅方式.....	100

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）
基金简称	南方标普 500ETF（QDII）
场内简称	标普 ETF；标普 500ETF 基金
基金主代码	513650
交易代码	513650
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 3 月 23 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	207,734,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2023 年 4 月 4 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采用复制策略、替代策略及其他适当的策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。主要投资策略包括：复制策略、替代策略、金融衍生品投资策略、债券投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、存托凭证投资策略、境外市场基金投资策略、境外回购交易及证券借贷交易策略等以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为经汇率调整后的标的指数收益率。本基金标的指数为标普 500 指数，及其未来可能发生的变更。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，一般而言，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的市场相似的风险收益特征。 本基金可投资于境外证券，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限	招商银行股份有限公司

		公司	
信息披露负责人	姓名	常克川	张姗
	联系电话	0755-82763888	400-61-95555
	电子邮箱	manager@southernfund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-889-8899	400-61-95555
传真		0755-82763889	0755-83195201
注册地址		深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518017	518040
法定代表人		周易	缪建民

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目	境外资产托管人	
名称	中文	美国花旗银行有限公司
	英文	Citibank N.A.
注册地址	701 East 60th Street North, Sioux Falls, SD57104, USA	
办公地址	40th Floor Champion Tower, Three Garden Road, Central, Hong Kong	
邮政编码	-	

## 2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址、基金上市交易的证券交易所(如有)

## 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

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

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、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；

3、本基金合同于 2023 年 3 月 23 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年。

#### 3.2 基金净值表现

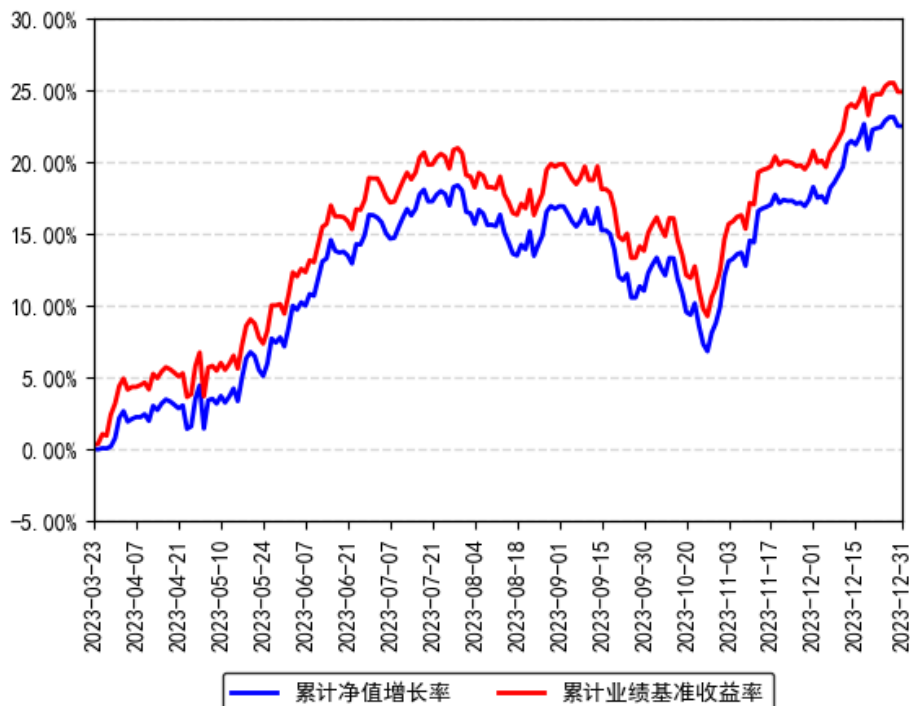
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	10.33%	0.75%	9.73%	0.76%	0.60%	-0.01%
过去六个月	5.32%	0.72%	5.06%	0.72%	0.26%	0.00%
自基金合同生效起至今	22.49%	0.75%	24.88%	0.76%	-2.39%	-0.01%

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

## 基准收益率变动的比较

南方标普500ETF (QDII) 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

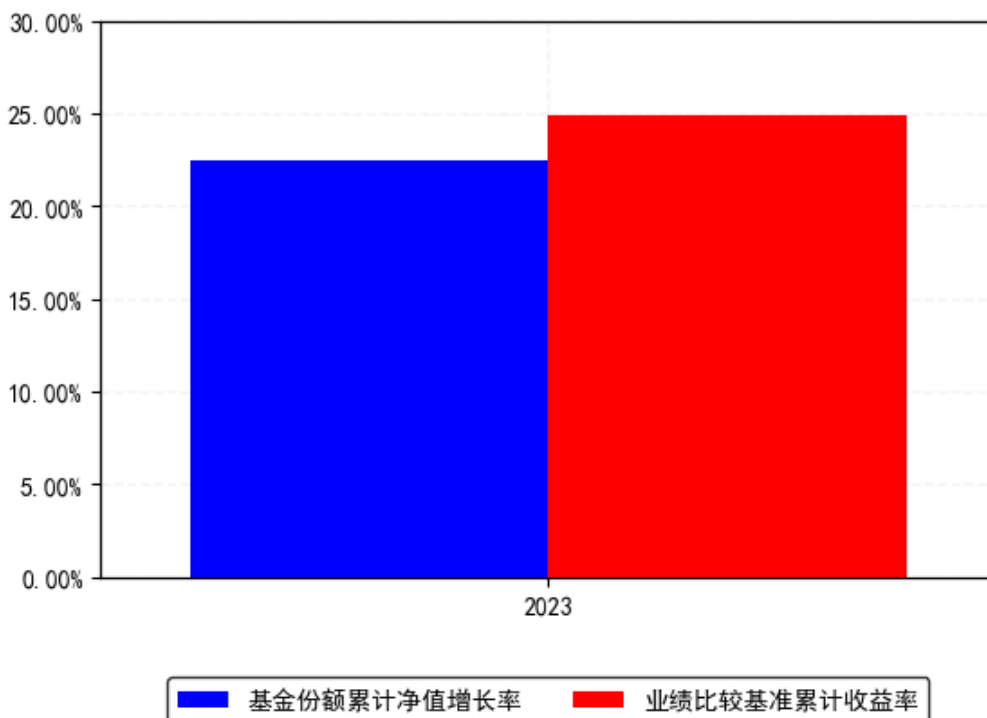


注: 本基金合同于 2023 年 3 月 23 日生效, 截至本报告期末基金成立未满一年; 自基金成立日起 6 个月内为建仓期, 建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

### 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



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



注：基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

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

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

1998 年 3 月 6 日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。

2018 年 1 月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。目前，公司总部设在深圳，在北京、上海、深圳、南京、成都、合肥等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

南方基金管理股份有限公司旗下管理公募基金、全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户组合，已发展成为产品种类丰富、业务领域全面、经营业绩优秀、资产管理规模位居前列的基金管理公司之一。

## 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李佳亮	本基金基金经理	2023 年 3 月 23 日	-	11 年	美国南加州大学金融工程硕士，特许金融分析师（CFA），具有基金从业资格。2012 年 8 月加入南方基金，任量化投资部研究员；2015 年 5 月 28 日至 2016 年 8 月 5 日，任投资经理助理；2017 年 4 月 13 日至 2018 年 9 月 4 日，任南方荣优基金经理；2016 年 8 月 5 日至 2019 年 1 月 18 日，任南方消费基金经理；2017 年 11 月 9 日至 2019 年 6 月 28 日，任大数据 100、大数据 300 基金经理；2016 年 11 月 23 日至 2021 年 11 月 12 日，任南方中证 500 增强基金经理；2017 年 11 月 9 日至 2021 年 11 月 12 日，任南方量化成长基金经理；2020 年 4 月 23 日至 2021 年 11 月 12 日，任南方上证 50 增强基金经理；2016 年 12 月 30 日至今，任南方绝对收益基金经理；2021 年 10 月 29 日至今，任南方 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF 基金经理；2022 年 1 月 10 日至今，任南方 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF 联接基金经理；2022 年 11 月 21 日至今，兼任投资经理；2022 年 12 月 16 日至今，任南方基金南方东英银河联昌富时亚太低碳精选 ETF（QDII）基金经理；2022 年 12 月 23 日至今，任南方北证 50 成份指数发起基金经理；2023 年 3 月 3 日至今，任南方中证主要消费 ETF 基金经理；2023 年 3 月 23 日至今，任南方标普 500ETF（QDII）基金经理；2023 年 4 月 13 日至今，任南方沪深 300ESG 基准 ETF 基金经理；2023 年 6 月 21 日至今，任南方中证国新央企科技引领 ETF 基金经理；2023 年 7 月 28 日至今，任南方中证通信服务 ETF 基金经理；2023 年 9 月 7 日至今，任南方中证 2000ETF 基金经理；2023 年 12 月 5 日至今，任南方中证电池主题指数发起基金经理。
杜冠豪	本基金基金经理助理	2023 年 10 月 23 日	-	4 年	北京大学金融学专业硕士，具有基金从业资格。2019 年 7 月加入南方基金，任指数投资部研究员；2023 年 10 月 23 日

					至今，任恒生 ETF、南方标普 500ETF（QDII）、南方中证创新药产业 ETF 基金经理助理。
--	--	--	--	--	--

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
李佳亮	公募基金	12	4,986,039,295.03	2016年08月05日
	私募资产管理计划	-	-	-
	其他组合	-	-	-
	合计	12	4,986,039,295.03	-

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

公司基金经理薪酬由工资、奖金等构成。工资由基金经理任职的职位职级决定，重点体现员工能力和职位价值导向原则；奖金由员工的绩效贡献决定，重点体现绩效导向与差异化原则。对于兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理，公司对私募资产管理计划产生的超额业绩报酬实施对应激励，并依据其管理产品的长期业绩与个人综合贡献情况实施分配。为贯彻激励约束相结合、激励与约束并重的管理理念，鼓励长期任职，防范经营风险，公司对基金经理奖金实施递延发放。同时，为加强员工利益与持有人利益相捆绑及一致性，公司对基金经理实施了跟投购基机制，有效引导基金经理为客户持续创造价值。

#### 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金无境外投资顾问。

#### 4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

#### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.4.1 公平交易制度和控制方法

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

#### 4.4.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。

本报告期内,两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在,并且交易占比也没有明显异常,未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

##### 4.4.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

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

#### 4.4.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为25次,是由于指数投资组合的投资策略导致。

### 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,标普500指数自产品2023年3月23日成立以来上涨21.15%。期间我们通过自建的“指数化交易系统”、“日内择时交易模型”、“跟踪误差归因分析系统”、“ETF现金流精算系统”等,将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平,并通过严格的风险管理流程,确保了本ETF基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

- （1）接受申购赎回所带来的仓位偏离，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；
- （2）股指期货和现货之间的偏离带来的本基金与基准的偏离；
- （3）申购赎回过程中的美元汇率变动，实际换汇汇率与结算汇率的差异；
- （4）根据指数成份股调整进行的基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，将跟踪误差控制在理想范围内。

#### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.2249 元，报告期内，份额净值增长率为 22.49%，同期业绩基准增长率为 24.88%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年，美股市场表现优异。虽然美联储 2023 年的持续加息造成的美股分母端贴现利率变大，但美股强劲的盈利使得分子端自由现金流增速更高。2023 年末，美联储议息会议的预测基本表明本轮加息周期已经基本结束，为进入 2024 年的美国股市和经济定下基调。展望 2024 年，美联储这轮加息周期已进入尾声，美股分母端的贴现利率即将迎来改善，美国或进入新一轮的景气循环。回顾历史，历次加息结束后美股均取得较好表现。我们继续维持对美股市场谨慎偏乐观的看法。

#### 4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、监管要求、自律规则和业务发展情况，严格遵守包括《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》在内的公募基金行业各项法律法规及其他规范要求，有效落实了 2023 年度发布的《重要货币市场基金监管暂行规定》《基金从业人员管理规则》和《证券期货经营机构投资管理人员注册登记规则》等公募基金相关新法律法规。

本基金管理人坚持从保护基金份额持有人利益出发，树立并坚守“全员合规、合规从高层做起、合规创造价值、合规是公司生存基础、合规为先、行稳致远”的合规理念。严守底线，始终把内控和合规管理作为规范化管理的重点，通过有效过程管控，将合规管理全面深度嵌入流程与业务，积极推动主动合规风控管理，持续加强业务风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，有效保障了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期内，本基金管理人结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展实际情况，积极推动监管新规落实，持续完善内部控制体系和内部控制制度、业务流程，制订和修订了

包括《合规手册》《数据合规管理规定》《从业人员个人投资管理办法》《防控内幕信息及交易管理制度》《信息和保密管理制度》《离任审计及审查制度》等一系列与监察稽核和合规内控相关的管理制度。

在进一步优化制度体系的基础上,本基金管理人贯彻“合规为先,行稳致远”的合规理念,着力创新文化宣传方式,提升宣导效果;优化员工行为检查方式,加强员工行为规范检查力度,严格进行合规问责,强化全员合规、主动合规理念;对投研交易、市场销售、后台运营及人员管理等业务和相关部门开展了定期稽核、专项稽核及多项自查,通过专项稽核和合规检查工作识别问题、防范风险、推动解决,促进公司业务合规运作、稳健经营;根据监管形势和市场形势的变化并结合业务发展的实际情况、各类组合或者业务特点,完善投资合规管理机制,采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作,持续完善投资合规风控制度流程和系统,加强流动性指标等重要指标的监控和内幕交易防控,有效确保投研交易业务合规运作;全面履行新产品、新业务合规评估程序,保障新产品、新业务合规开展;积极开展合规审核工作,不断强化销售合规风险管控,督促落实投资者适当性管理制度;完成各项信息披露工作,保障所披露信息的真实性、准确性和完整性;开展各类监管组织的投教活动,提升投教质效;监督和落实客户投诉处理,重视媒体监督和投资者关系管理。

本基金管理人高度重视反洗钱相关工作,贯彻风险为本,自评估驱动,反洗钱重点问题解决方案实现落地推进。从制度建设、系统功能建设、业务流程规范、宣传培训、监督检查等方面入手,将反洗钱工作贯穿于公司各项业务流程,有效提升了公司反洗钱工作的合规水平。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,积极健全全部管理制度,不断提高监察稽核及合规管理工作的科学性和有效性,持续全面推进合规数字化工作在更广范围应用并与合规管理工作深度融合,努力防范和管理各类风险,切实维护基金资产的安全与利益。

#### 4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定,本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度,明确基金估值的程序和技术;建立了估值委员会,组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、固定收益研究部总经理、指数投资部总经理、现金及债券指数投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统,估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术,导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的,对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核

责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，以及本基金的实际运作情况，本基金报告期末未进行利润分配。在符合分红条件的前提下，本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

#### 4.10 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个交易日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本报告中利润分配情况真实、准确。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人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,认为复核内容真实、准确、完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 23132 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(以下简称“南方标普 500ETF 基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了南方标普 500ETF 基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。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。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于南方标普 500ETF 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-



其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>南方标普 500ETF 基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估南方标普 500ETF 基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算南方标普 500ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督南方标普 500ETF 基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对南方标普 500ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致南方标普 500ETF 基金不能持续经营。</p>

	(五) 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。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	张振波	吴玲玮
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2024 年 3 月 28 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日
资产：		
货币资金	7.4.7.1	14,535,105.96
结算备付金		8,073,541.40
存出保证金		1,493,918.50
交易性金融资产	7.4.7.2	232,147,790.38
其中：股票投资		232,147,790.38
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
债权投资	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		17,943,020.23
应收股利		241,512.11
应收申购款		-

递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.8	-
资产总计		274,434,888.58
负债和净资产	附注号	本期末 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		8,668.51
应付赎回款		-
应付管理人报酬		155,347.76
应付托管费		38,836.93
应付销售服务费		-
应付投资顾问费		-
应交税费		49,519.93
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.9	19,722,590.43
负债合计		19,974,963.56
净资产:		
实收基金	7.4.7.10	207,734,000.00
其他综合收益	7.4.7.11	-
未分配利润	7.4.7.12	46,725,925.02
净资产合计		254,459,925.02
负债和净资产总计		274,434,888.58

注：1. 报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2249 元，基金份额总额 207,734,000.00 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2023 年 03 月 23 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)

本报告期：2023 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		73,392,762.64
1.利息收入		155,017.10

其中：存款利息收入	7.4.7.13	155,017.10
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		45,367,948.36
其中：股票投资收益	7.4.7.14	38,245,336.48
基金投资收益	7.4.7.15	-
债券投资收益	7.4.7.16	-
资产支持证券投资	7.4.7.17	-
贵金属投资收益	7.4.7.18	-
衍生工具收益	7.4.7.19	2,833,989.09
股利收益	7.4.7.20	4,288,622.79
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	27,299,904.56
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		441,668.09
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.22	128,224.53
减：二、营业总支出		2,450,360.24
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	1,904,133.27
其中：暂估管理人报酬		-
2.托管费	7.4.10.2.2	476,033.26
3.销售服务费	7.4.10.2.3	-
4.投资顾问费		-
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.信用减值损失	7.4.7.23	-
7.税金及附加		10,228.14
8.其他费用	7.4.7.24	59,965.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		70,942,402.40
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		70,942,402.40
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		70,942,402.40

### 7.3 净资产变动表

会计主体：南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)

本报告期：2023 年 3 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	420,734,000.00	-	-	420,734,000.00
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-213,000,000.00	-	46,725,925.02	-166,274,074.98
(一)、综合收益总额	-	-	70,942,402.40	70,942,402.40
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-213,000,000.00	-	-24,216,477.38	-237,216,477.38
其中：1.基金申购款	349,000,000.00	-	52,598,790.92	401,598,790.92
2.基金赎回款	-562,000,000.00	-	-76,815,268.30	-638,815,268.30
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动 (净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	207,734,000.00	-	46,725,925.02	254,459,925.02

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_杨小松\_\_\_\_                      \_\_\_\_常克川\_\_\_\_                      \_\_\_\_徐超\_\_\_\_  
基金管理人负责人                      主管会计工作负责人                      会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(QDII) (以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]1698 号《关于准予南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)注册的批复》注册,由南方基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 420,734,000.00 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第 0190 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》于 2023 年 3 月 23 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 420,734,000.00 份基金份额,无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司,境外资产托管人为美国花旗银行有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2023]60 号审核同意,本基金 420,734,000.00 份基金份额于 2023 年 4 月 4 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标普 500 指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股(包括已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证等),与标的指数相关的公募基金、上市交易型基金(含 ETF)、中国证监会允许投资的结构化产品及金融衍生产品等。此外,为更好地实现投资目标,本基金可参与其他境外市场投资工具和境内市场投资工具投资。境内市场投资工具包括少量非成份股(包含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册发行的股票以及存托凭证)、衍生工具(股指期货、股票期权等)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、政府机构债券、地方政府债券、次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。境外市场投资工具包括在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金(含 ETF);已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证;政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭

支持证券、资产支持证券及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金可以进行境外证券借贷交易、境外正回购交易、逆回购交易。有关证券借贷交易的内容以专门签署的三方或多方协议约定为准。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，本基金年化跟踪误差不超过 4%。本基金的业绩比较基准为经汇率调整后的标普 500 指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司于 2024 年 3 月 28 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日止期间的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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

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

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

#### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

#### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

#### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具（主要为股票投资）按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认



金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中（该类别次于其他所有工具类别），所有工具具有相同的特征（例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同）；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5)

该工具在存续期内的预计现金流量总额,应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

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

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

本基金将实收基金分类为权益工具,列报于净资产。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算, 实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1% 以上时, 可进行收益分配。本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。收益分配不须以弥补浮动亏损为前提, 收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

#### 7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部, 以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分: (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用; (2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果, 以决定向其配置资源、评价其业绩; (3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征, 并且满足一定条件的, 则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作, 不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

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

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

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	14,535,105.96
等于：本金	14,534,175.20
加：应计利息	930.76
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	14,535,105.96

货币资金中包括以下外币余额：

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		
	外币金额	汇率	折合人民币
美元	1,565,350.23	7.0827	11,086,906.07
合计			11,086,906.07

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	205,420,247.66	-	232,147,790.38	26,727,542.72
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-

	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计	205,420,247.66	-	-	232,147,790.38	26,727,542.72

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			备注
	合同/名义金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-21,722,396.47	-	-	-
一指期货	-21,722,396.47	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-21,722,396.47	-	-	-

#### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值	公允价值变动
ES2403	ES2403	13.00	22,294,758.31	572,361.84
合计				572,361.84
减：可抵销期货暂收款				572,361.84
净额				-

注：

1、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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

#### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

#### 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

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 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

### 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

### 7.4.7.6 其他债权投资

#### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

#### 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

### 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

#### 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

### 7.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

### 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
应退退补款	19,667,590.43
预提费用	55,000.00
应付指数使用费	-
可退替代款	-
合计	19,722,590.43

### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	420,734,000.00	420,734,000.00
本期申购	349,000,000.00	349,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-562,000,000.00	-562,000,000.00



基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	207,734,000.00	207,734,000.00

注：1. 红利再投及转入份额计入本期申购，转出份额计入本期赎回。

2. 本基金自 2023 年 1 月 30 日至 2023 年 3 月 20 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 420,734,000.00 元，折合 420,734,000.00 份基金份额。根据《南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)招募说明书》的规定，本基金无认购资金利息折合基金份额。

3. 根据《南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》、《南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)招募说明书》及《南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)开放日常申购与赎回业务的公告》的相关规定，本基金于 2023 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2023 年 4 月 3 日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务和赎回业务自 2023 年 4 月 4 日起开始办理。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	43,642,497.84	27,299,904.56	70,942,402.40
本期基金份额交易产生的变动数	-16,514,861.94	-7,701,615.44	-24,216,477.38
其中：基金申购款	9,276,410.19	43,322,380.73	52,598,790.92
基金赎回款	-25,791,272.13	-51,023,996.17	-76,815,268.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	27,127,635.90	19,598,289.12	46,725,925.02

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	94,059.74
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-

结算备付金利息收入	-
其他	60,957.36
合计	155,017.10

#### 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 2023 年 3 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	38,245,336.48
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	38,245,336.48

##### 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 2023 年 3 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	525,576,951.70
减：卖出股票成本总额	487,103,285.65
减：交易费用	228,329.57
买卖股票差价收入	38,245,336.48

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

##### 7.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

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

##### 7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

##### 7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无证券出借差价收入。

#### 7.4.7.15 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

#### 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

本基金本报告期内无债券投资收益。

##### 7.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无买卖债券差价收入。

#### 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

##### 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

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

##### 7.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

##### 7.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

#### 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

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

##### 7.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

##### 7.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

#### 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

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 12 月 31 日
股指期货-投资收益	2,833,989.09

**7.4.7.20 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	4,288,622.79
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,288,622.79

**7.4.7.21 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 3 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	26,727,542.72
——股票投资	26,727,542.72
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	572,361.84
——权证投资	-
——期货投资	572,361.84
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	27,299,904.56

**7.4.7.22 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-
替代损益	128,224.53
合计	128,224.53

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

**7.4.7.23 信用减值损失****7.4.7.24 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	55,000.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	4,965.57
合计	59,965.57

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日, 本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日, 本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司("南方基金")	基金管理人
招商银行股份有限公司("招商银行")	基金托管人
美国花旗银行有限公司("美国花旗银行")	境外资产托管人
华泰证券股份有限公司("华泰证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司("兴业证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
南方资本管理有限公司("南方资本")	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司("南方东英")	基金管理人的子公司
厦门国际信托有限公司("厦门国际信托")	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司("深圳投资控股")	基金管理人的股东
厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东

注: 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.10.1.2 基金交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的基金交易。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

#### 7.4.10.1.4 债券回购交易

#### 7.4.10.1.5 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,904,133.27
其中：应支付销售机构的客户维护费	7,420.38
应支付基金管理人的净管理费	1,896,712.89

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.60% ÷ 当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	476,033.26

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.15% ÷ 当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期内无支付给各关联方的销售服务费。

### 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

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 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

本基金本报告期内无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。

#### 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

本基金本报告期内无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。

#### 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

本基金的基金管理人于本基金本报告期内未运用固有资金投资本基金。

##### 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

本基金本报告期末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
美国花旗银行	194,011.42	6,538.98
招商银行	14,341,094.54	87,520.76

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行股份有限公司和境外托管人美国花旗银行有限公司保管，按银行约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 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

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止, 本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金, 紧密跟踪标普 500 指数, 具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征, 属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外, 本基金还面临汇率风险、境外市场风险、市场制度以及交易规则不同等境外证券市场投资所面临的特有风险。本基金采用完全复制法, 跟踪标普 500 指数, 以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则, 进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况 (如流动性不足等) 导致无法获得足够数量的股票时, 基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代, 力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设, 建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会, 负责制定风险管理的宏观政策, 审议通过风险控制的总体措施等; 在管理层层面设立风险控制委员会, 讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施; 在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责, 协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估, 督察长负责组织指导监察稽核工作。

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

#### 7.4.13.2 信用风险



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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人开立的托管账户或其他大中型商业银行开立的存款账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。

本基金在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，在境内交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金净资产的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

于本期末，本基金无债券投资。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金为履行与金融负债有关的义务而调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，可能产生基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的进行期货投资，以对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

本基金力争利用期货的杠杆作用，降低投资组合的股票仓位频繁调整整体风险的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

于本期末，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产净值的 15%。于本期末,本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合该要求。

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

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产存在相应的利率风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	14,535,105.96	-	-	-	14,535,105.96
结算备付金	8,073,541.40	-	-	-	8,073,541.40
存出保证金	-	-	-	1,493,918.50	1,493,918.50
交易性金融	-	-	-	232,147,790.	232,147,790.

资产				38	38
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	17,943,020.23	17,943,020.23
应收股利	-	-	-	241,512.11	241,512.11
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	22,608,647.36	-	-	251,826,241.22	274,434,888.58
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	8,668.51	8,668.51
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	155,347.76	155,347.76
应付托管费	-	-	-	38,836.93	38,836.93
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	49,519.93	49,519.93
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	19,722,590.43	19,722,590.43
负债总计	-	-	-	19,974,963.5	19,974,963.5

				6	6
利率敏感度	22,608,647.3	-	-	231,851,277.	254,459,925.
缺口	6			66	02

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） 本期末（2023年12月31日）
	1.市场利率平行上升 25 个基点	0.00
	2.市场利率平行下降 25 个基点	0.00

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产或负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

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

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

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票, 所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响, 也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用完全复制法, 跟踪标普 500 指数, 以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则, 通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中, 标普 500 指数成份股和备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%, 且不低于非现金基金资产的 80%。此外, 本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控, 定期运用多种定量方法对基金进行风险度量, 来测试本基金面临的潜在价格风险, 及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位: 人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	232,147,790.38	91.23
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	232,147,790.38	91.23

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次: 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次: 相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位: 人民币元

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

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

###### 7.4.14.2.3 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

###### 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

###### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末, 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额 (人民币元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	232,147,790.38	84.59
	其中: 普通股	226,666,589.47	82.59
	存托凭证	5,481,200.91	2.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中: 债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中: 远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付 金合计	22,608,647.36	8.24
8	其他资产	19,678,450.84	7.17
9	合计	274,434,888.58	100.00

### 8.2 期末在各个国家 (地区) 证券市场的权益投资分布

国家 (地区)	公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
美国	232,147,790.38	91.23
合计	232,147,790.38	91.23

### 8.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

### 8.3.1 报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
能源	9,242,164.80	3.63
材料	5,593,374.29	2.20
工业	18,604,241.22	7.31
非必需消费品	24,295,884.78	9.55
必需消费品	14,297,232.27	5.62
医疗保健	29,313,722.45	11.52
金融	22,640,730.82	8.90
科技	75,202,566.78	29.55
通讯	21,878,686.09	8.60
公用事业	5,433,153.83	2.14
房地产	5,646,033.05	2.22
政府	-	-
合计	232,147,790.38	91.23

本基金对以上行业分类采用彭博行业分类标准。

### 8.3.2 报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的权益投资。

## 8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

### 8.4.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

#### 8.4.1.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家 (地区)	数量 (股)	公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
1	Apple Inc	苹果公司	AAPL UW	纳斯达克 证券交易所	美国	11,974	16,328, 132.33	6.42
2	Microsoft Corp	微软公司	MSFT UW	纳斯达克 证券交易所	美国	6,087	16,211, 984.98	6.37
3	Alphabet Inc	Alphabet 公司	GOOG L UW	纳斯达克 证券交易所	美国	4,847	4,795,5 36.31	1.88
4	Alphabet Inc	Alphabet 公司	GOOG UW	纳斯达克 证券交易所	美国	4,079	4,071,5 14.67	1.60
5	Amazon	亚马逊	AMZN	纳斯达克	美国	7,448	8,015,1	3.15



	.com Inc	公司	UW	克证券 交易所			31.22	
6	NVIDI A Corp	英伟达	NVDA UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,023	7,095,6 61.77	2.79
7	Meta Platfor ms Inc	Meta 平 台股份 有限公司	META UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,818	4,557,7 12.35	1.79
8	Tesla Inc	特斯拉 公司	TSLA UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,265	3,986,1 94.56	1.57
9	Berkshir e Hathaw ay Inc	伯克希 尔哈撒 韦公司	BRK/B UN	纽约证 券交易 所	美国	1,490	3,763,9 12.52	1.48
10	JPMorg an Chase & Co	摩根大 通	JPM UN	纽约证 券交易 所	美国	2,368	2,852,8 88.90	1.12
11	Broadco m Inc	博通股 份有限 公司	AVGO UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	360	2,846,1 83.00	1.12
12	UnitedH ealth Group Inc	联合健 康集团	UNH UN	纽约证 券交易 所	美国	758	2,826,4 52.43	1.11
13	Eli Lilly & Co	礼来	LLY UN	纽约证 券交易 所	美国	653	2,696,0 06.81	1.06
14	Visa Inc	维萨公 司	V UN	纽约证 券交易 所	美国	1,306	2,408,2 39.11	0.95
15	Exxon Mobil Corp	埃克森 美孚石 油公司	XOM UN	纽约证 券交易 所	美国	3,281	2,323,3 69.10	0.91
16	Johnson & Johnson	强生	JNJ UN	纽约证 券交易 所	美国	1,972	2,189,2 00.81	0.86
17	Masterc ard Inc	万事达 股份有 限公司	MA UN	纽约证 券交易 所	美国	678	2,048,1 31.13	0.80
18	Home Depot	家得宝	HD UN	纽约证 券交易	美国	819	2,010,2 43.43	0.79

	Inc/The			所				
19	Procter & Gamble Co/The	宝洁	PG UN	纽约证券交易所	美国	1,930	2,003,144.80	0.79
20	Costco Wholesale Corp	开市客	COST UW	纳斯达克证券交易所	美国	363	1,697,078.95	0.67
21	Merck & Co Inc	默克	MRK UN	纽约证券交易所	美国	2,075	1,602,223.60	0.63
22	AbbVie Inc	艾伯维公司	ABBV UN	纽约证券交易所	美国	1,446	1,587,138.30	0.62
23	Adobe Inc	奥多比	ADBE UW	纳斯达克证券交易所	美国	373	1,576,125.98	0.62
24	Chevron Corp	雪佛龙	CVX UN	纽约证券交易所	美国	1,438	1,519,183.06	0.60
25	Salesforce Inc	Salesforce 股份有限公司	CRM UN	纽约证券交易所	美国	797	1,485,402.12	0.58
26	Advanced Micro Devices Inc	AMD 公司	AMD UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,323	1,381,292.45	0.54
27	PepsiCo Inc	百事可乐	PEP UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,126	1,354,494.41	0.53
28	Bank of America Corp	美国银行公司	BAC UN	纽约证券交易所	美国	5,639	1,344,757.76	0.53
29	Coca-Cola Co/The	可口可乐	KO UN	纽约证券交易所	美国	3,187	1,330,201.25	0.52
30	Walmart Inc	沃尔玛股份有限公司	WMT UN	纽约证券交易所	美国	1,168	1,304,174.38	0.51
31	Accenture PLC	埃森哲公司	ACN UN	纽约证券交易所	美国	514	1,277,490.59	0.50

32	McDonald's Corp	麦当劳	MCD UN	纽约证券交易所	美国	594	1,247,454.28	0.49
33	Netflix Inc	奈飞公司	NFLX UW	纳斯达克证券交易所	美国	358	1,234,536.14	0.49
34	Intel Corp	英特尔	INTC UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,453	1,228,942.30	0.48
35	Thermo Fisher Scientific Inc	Thermo Fisher Scientific 公司	TMO UN	纽约证券交易所	美国	316	1,187,978.72	0.47
36	Cisco Systems Inc	思科系统股份有限公司	CSCO UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,318	1,187,240.14	0.47
37	Linde PLC	Linde PLC	LIN UW	纳斯达克证券交易所	美国	397	1,154,847.48	0.45
38	Abbott Laboratories	雅培制药	ABT UN	纽约证券交易所	美国	1,421	1,107,801.35	0.44
39	Wells Fargo & Co	富国银行	WFC UN	纽约证券交易所	美国	2,974	1,036,767.61	0.41
40	Comcast Corp	康卡斯特公司	CMCSA UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,289	1,021,485.76	0.40
41	Intuit Inc	Intuit 股份有限公司	INTU UW	纳斯达克证券交易所	美国	230	1,018,187.00	0.40
42	Oracle Corp	甲骨文	ORCL UN	纽约证券交易所	美国	1,301	971,494.51	0.38
43	Walt Disney Co/The	华特迪士尼公司	DIS UN	纽约证券交易所	美国	1,499	958,605.98	0.38
44	Pfizer Inc	辉瑞制药	PFE UN	纽约证券交易所	美国	4,625	943,088.07	0.37
45	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM UW	纳斯达克证券交易所	美国	912	934,226.26	0.37

46	Verizon Communication s Inc	Verizon 通信股 份有限 公司	VZ UN	纽约证 券交易 所	美国	3,443	919,342 .25	0.36
47	Texas Instrum ents Inc	德州仪 器	TXN UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	744	898,243 .88	0.35
48	Amgen Inc	安进公 司	AMGN UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	438	893,502 .15	0.35
49	Danaher Corp	丹纳赫	DHR UN	纽约证 券交易 所	美国	539	883,157 .87	0.35
50	Caterpil lar Inc	卡特彼 勒	CAT UN	纽约证 券交易 所	美国	418	875,351 .32	0.34
51	Union Pacific Corp	联合太 平洋	UNP UN	纽约证 券交易 所	美国	499	868,086 .73	0.34
52	Internati onal Busines s Machin es Corp	国际商 业机器	IBM UN	纽约证 券交易 所	美国	748	866,464 .94	0.34
53	Boeing Co/The	波音	BA UN	纽约证 券交易 所	美国	466	860,318 .29	0.34
54	Philip Morris Internati onal Inc	菲利普 莫里斯 国际集 团公司	PM UN	纽约证 券交易 所	美国	1,271	846,918 .67	0.33
55	Service Now Inc	Service Now 公 司	NOW UN	纽约证 券交易 所	美国	168	840,647 .93	0.33
56	S&P Global Inc	标普全 球	SPGI UN	纽约证 券交易 所	美国	265	826,818 .82	0.32
57	General Electric Co	通用电 气	GE UN	纽约证 券交易 所	美国	891	805,432 .82	0.32
58	Honeyw ell Internati	霍尼韦 尔	HON UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	540	802,069 .03	0.32

	onal Inc							
59	Conoco Phillips	康菲石油	COP UN	纽约证券交易所	美国	973	799,892.59	0.31
60	Applied Materials Inc	应用材料	AMAT UW	纳斯达克证券交易所	美国	685	786,306.83	0.31
61	NIKE Inc	耐克公司	NKE UN	纽约证券交易所	美国	1,003	771,275.65	0.30
62	Lowe's Cos Inc	劳氏	LOW UN	纽约证券交易所	美国	473	745,568.56	0.29
63	Uber Technologies Inc	优步技术股份有限公司	UBER UN	纽约证券交易所	美国	1,685	734,797.90	0.29
64	Goldman Sachs Group Inc/The	高盛	GS UN	纽约证券交易所	美国	267	729,522.28	0.29
65	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	29	728,592.96	0.29
66	NextEra Energy Inc	新纪元能源公司	NEE UN	纽约证券交易所	美国	1,680	722,741.37	0.28
67	Prologis Inc	安博	PLD UN	纽约证券交易所	美国	757	714,701.80	0.28
68	RTX Corp	RTX 公司	RTX UN	纽约证券交易所	美国	1,178	702,015.41	0.28
69	AT&T Inc	美国电话电报公司	T UN	纽约证券交易所	美国	5,856	695,972.17	0.27
70	Intuitive Surgical Inc	直觉外科手术公司	ISRG UW	纳斯达克证券交易所	美国	288	688,152.87	0.27
71	Morgan Stanley	摩根士丹利	MS UN	纽约证券交易所	美国	1,035	683,577.94	0.27
72	BlackR	贝莱德	BLK	纽约证	美国	115	661,219	0.26

	ock Inc	有限公司	UN	券交易所			.62	
73	United Parcel Service Inc	联合包裹服务股份有限公司	UPS UN	纽约证券交易所	美国	592	659,258 .85	0.26
74	Elevance Health Inc	Elevance 健康股份有限公司	ELV UN	纽约证券交易所	美国	192	641,264 .26	0.25
75	Starbucks Corp	星巴克公司	SBUX UW	纳斯达克证券交易所	美国	936	636,489 .39	0.25
76	Medtronic PLC	美敦力	MDT UN	纽约证券交易所	美国	1,090	635,985 .38	0.25
77	American Express Co	美国运通	AXP UN	纽约证券交易所	美国	472	626,284 .06	0.25
78	TJX Cos Inc/The	TJX 公司	TJX UN	纽约证券交易所	美国	937	622,569 .12	0.24
79	Deere & Co	迪尔	DE UN	纽约证券交易所	美国	219	620,242 .88	0.24
80	Vertex Pharmaceuticals Inc	福泰制药	VRTX UW	纳斯达克证券交易所	美国	211	608,076 .64	0.24
81	Bristol-Myers Squibb Co	百时美施贵宝公司	BMY UN	纽约证券交易所	美国	1,667	605,810 .03	0.24
82	Lam Research Corp	泛林集团	LRCX UW	纳斯达克证券交易所	美国	108	599,140 .33	0.24
83	Charles Schwab Corp/The	嘉信理财	SCHW UN	纽约证券交易所	美国	1,219	594,006 .22	0.23
84	CVS Health Corp	CVS 健康公司	CVS UN	纽约证券交易所	美国	1,052	588,330 .99	0.23

85	Stryker Corp	史赛克	SYK UN	纽约证券交易所	美国	277	587,512.94	0.23
86	Gilead Sciences Inc	吉利德科学	GILD UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,021	585,818.69	0.23
87	American Tower Corp	美国发射塔公司	AMT UN	纽约证券交易所	美国	382	584,083.07	0.23
88	Lockheed Martin Corp	洛克希德马丁	LMT UN	纽约证券交易所	美国	181	581,039.49	0.23
89	Analog Devices Inc	亚德诺半导体	ADI UW	纳斯达克证券交易所	美国	408	573,787.09	0.23
90	Mondelēz International Inc	亿滋国际	MDLZ UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,114	571,481.96	0.22
91	Citigroup Inc	花旗集团	C UN	纽约证券交易所	美国	1,568	571,275.85	0.22
92	Eaton Corp PLC	伊顿	ETN UN	纽约证券交易所	美国	327	557,749.45	0.22
93	Automatic Data Processing Inc	ADP 公司	ADP UW	纳斯达克证券交易所	美国	337	556,069.08	0.22
94	Regeneron Pharmaceuticals Inc	再生元制药股份有限公司	REGN UW	纳斯达克证券交易所	美国	88	547,418.48	0.22
95	Micron Technology Inc	美光科技股份有限公司	MU UW	纳斯达克证券交易所	美国	900	543,993.86	0.21
96	Marsh & McLennan Cos Inc	Marsh & McLennan 股份有限公司	MMC UN	纽约证券交易所	美国	404	542,151.50	0.21

97	Progressive Corp/The	前进保险公司	PGR UN	纽约证券交易所	美国	479	540,375.45	0.21
98	Blackstone Inc	黑石集团股份有限公司	BX UN	纽约证券交易所	美国	582	539,669.44	0.21
99	Chubb Ltd	邱博保险集团	CB UN	纽约证券交易所	美国	334	534,630.53	0.21
100	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	255	532,579.38	0.21
101	Zoetis Inc	硕腾股份有限公司	ZTS UN	纽约证券交易所	美国	376	525,615.10	0.21
102	Cigna Group/The	信诺集团	CI UN	纽约证券交易所	美国	240	509,019.48	0.20
103	Boston Scientific Corp	波士顿科学	BSX UN	纽约证券交易所	美国	1,199	490,931.61	0.19
104	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	417	473,532.39	0.19
105	Fiserv Inc	Fiserv 公司	FI UN	纽约证券交易所	美国	492	462,906.01	0.18
106	KLA Corp	KLA 公司	KLAC UW	纳斯达克证券交易所	美国	111	457,006.26	0.18
107	Synopsys Inc	新思科技公司	SNPS UW	纳斯达克证券交易所	美国	125	455,869.13	0.18
108	Southern Co/The	南方公司	SO UN	纽约证券交易所	美国	893	443,498.56	0.17
109	CME Group	芝加哥商业交	CME UW	纳斯达克证	美国	295	440,026.90	0.17



	Inc	易所		交易所				
110	Equinix Inc	Equinix 有限公司	EQIX US	美国证券交易所	美国	77	439,233.85	0.17
111	Duke Energy Corp	杜克能源	DUK UN	纽约证券交易所	美国	631	433,689.59	0.17
112	Schlumberger NV	斯伦贝谢公众有限公司	SLB UN	纽约证券交易所	美国	1,170	431,242.94	0.17
113	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	223	430,192.64	0.17
114	Intercontinental Exchange Inc	洲际交易所 (ICE)	ICE UN	纽约证券交易所	美国	469	426,617.01	0.17
115	Sherwin-Williams Co/The	宣伟公司	SHW UN	纽约证券交易所	美国	193	426,355.17	0.17
116	Illinois Tool Works Inc	伊利诺伊工具股份有限公司	ITW UN	纽约证券交易所	美国	224	415,574.31	0.16
117	Altria Group Inc	高特利	MO UN	纽约证券交易所	美国	1,449	414,002.65	0.16
118	Becton Dickinson & Co	碧迪	BDX UN	纽约证券交易所	美国	238	411,019.99	0.16
119	EOG Resources Inc	EOG 资源	EOG UN	纽约证券交易所	美国	478	409,479.93	0.16
120	CSX Corp	CSX 公司	CSX UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,619	397,557.12	0.16
121	US Bancorp	美国合众银行	USB UN	纽约证券交易所	美国	1,275	390,837.55	0.15
122	Northro	诺斯洛	NOC	纽约证	美国	116	384,620	0.15

	p Grumm an Corp	普格鲁 门公司	UN	券交易 所			.64	
123	PayPal Holdings Inc	Paypal 控股股 份有限 公司	PYPL UN	纳斯达 克证券 交易所	美国	883	384,059 .62	0.15
124	Target Corp	塔吉特 公司	TGT UN	纽约证 券交易 所	美国	378	381,295 .45	0.15
125	Waste Manage ment Inc	废品管 理	WM UN	纽约证 券交易 所	美国	300	380,553 .47	0.15
126	Colgate- Palmoli ve Co	高露洁 棕榄	CL UN	纽约证 券交易 所	美国	674	380,514 .80	0.15
127	PNC Financia l Services Group Inc/The	PNC 财 务服务	PNC UN	纽约证 券交易 所	美国	326	357,542 .49	0.14
128	McKess on Corp	McKess on 公 司	MCK UN	纽约证 券交易 所	美国	109	357,427 .18	0.14
129	Moody's Corp	穆迪	MCO UN	纽约证 券交易 所	美国	129	356,842 .29	0.14
130	Chipotle Mexica n Grill Inc	Chipotle Mexica n Grill 股份有 限公司	CMG UN	纽约证 券交易 所	美国	22	356,352 .74	0.14
131	Air Product s and Chemic als Inc	空气产 品公司	APD UN	纽约证 券交易 所	美国	183	354,881 .52	0.14
132	Freeport -McMo Ran Inc	自由港 迈克墨 伦股份 有限公司	FCX UN	纽约证 券交易 所	美国	1,174	353,973 .37	0.14

133	3M Co	3M 公司	MMM UN	纽约证券交易所	美国	452	349,974 .91	0.14
134	Amphenol Corp	安费诺公司	APH UN	纽约证券交易所	美国	490	344,032 .94	0.14
135	Arista Networks Inc	Arista 网络股份有限公司	ANET UN	纽约证券交易所	美国	206	343,617 .62	0.14
136	Airbnb Inc	爱彼迎股份有限公司	ABNB UW	纳斯达克证券交易所	美国	356	343,269 .00	0.13
137	NXP Semiconductors NV	恩智浦半导体公司	NXPI UW	纳斯达克证券交易所	美国	211	343,245 .21	0.13
138	Parker-Hannifin Corp	派克汉尼汾公司	PH UN	纽约证券交易所	美国	105	342,614 .99	0.13
139	General Dynamics Corp	通用动力	GD UN	纽约证券交易所	美国	186	342,084 .64	0.13
140	Lululemon Athletica Inc	Lululemon Athletica 股份有限公司	LULU UW	纳斯达克证券交易所	美国	94	340,403 .49	0.13
141	Phillips 66	Phillips 66	PSX UN	纽约证券交易所	美国	360	339,476 .64	0.13
142	FedEx Corp	联邦快递	FDX UN	纽约证券交易所	美国	189	338,633 .31	0.13
143	Aon PLC	怡安集团	AON UN	纽约证券交易所	美国	164	338,038 .01	0.13
144	Roper Technologies Inc	儒博技术公司	ROP UW	纳斯达克证券交易所	美国	87	335,930 .97	0.13
145	Humana Inc	Humana 股份有	HUM UN	纽约证 券交易	美国	101	327,495 .62	0.13

		限公司		所				
146	Marathon Petroleum Corp	马拉松石油公司	MPC UN	纽约证券交易所	美国	311	326,795.49	0.13
147	Trane Technologies PLC	特灵科技公共有限公司	TT UN	纽约证券交易所	美国	187	323,036.99	0.13
148	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	48	322,998.32	0.13
149	Marriott International Inc/MD	万豪国际	MAR UW	纳斯达克证券交易所	美国	202	322,638.37	0.13
150	TransDigm Group Inc	TransDigm 集团公司	TDG UN	纽约证券交易所	美国	45	322,418.67	0.13
151	Emerson Electric Co	艾默生电气	EMR UN	纽约证券交易所	美国	467	321,930.74	0.13
152	HCA Healthcare Inc	HCA 医疗保健有限公司	HCA UN	纽约证券交易所	美国	162	310,577.53	0.12
153	Norfolk Southern Corp	诺福克南方	NSC UN	纽约证券交易所	美国	185	309,728.60	0.12
154	Pioneer Natural Resources Co	Pioneer 自然资源公司	PXD UN	纽约证券交易所	美国	191	304,216.70	0.12
155	Cintas Corp	CINTAS 公司	CTAS UW	纳斯达克证券交易所	美国	71	303,060.66	0.12
156	Autodesk Inc	欧特克	ADSK UW	纳斯达克证券交易所	美国	175	301,786.76	0.12
157	Motorola	摩托罗拉解决	MSI UN	纽约证券交易所	美国	136	301,583.07	0.12

	Solution s Inc	方案股 份有限 公司		所				
158	PACCA R Inc	帕卡	PCAR UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	428	296,015 .78	0.12
159	Ecolab Inc	艺康集 团	ECL UN	纽约证 券交易 所	美国	208	292,209 .54	0.11
160	Capital One Financia l Corp	第一资 本金融	COF UN	纽约证 券交易 所	美国	312	289,749 .29	0.11
161	Crown Castle Inc	冠城股 份有限 公司	CCI UN	纽约证 券交易 所	美国	355	289,628 .96	0.11
162	Welltow er Inc	Welltow er Inc	WELL UN	纽约证 券交易 所	美国	453	289,307 .12	0.11
163	Truist Financia l Corp	Truist 金融公 司	TFC UN	纽约证 券交易 所	美国	1,092	285,550 .67	0.11
164	General Motors Co	通用汽 车公司	GM UN	纽约证 券交易 所	美国	1,122	285,448 .68	0.11
165	Microch ip Technol ogy Inc	微芯科 技股份 有限公司	MCHP UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	443	282,952 .02	0.11
166	Arthur J Gallag her & Co	亚瑟加 拉格尔 有限公司	AJG UN	纽约证 券交易 所	美国	177	281,918 .09	0.11
167	Public Storage	Public Storage	PSA UN	纽约证 券交易 所	美国	130	280,829 .06	0.11
168	Carrier Global Corp	开利全 球公司	CARR UN	纽约证 券交易 所	美国	687	279,541 .07	0.11
169	Ford Motor Co	福特汽 车	F UN	纽约证 券交易 所	美国	3,221	278,095 .06	0.11
170	Dexcom Inc	Dexcom 股份有	DXCM UW	纳斯达 克证券	美国	316	277,729 .95	0.11

		限公司		交易所				
171	Newmont Corp	纽蒙黄金公司	NEM UN	纽约证券交易所	美国	944	276,736.39	0.11
172	American International Group Inc	美国国际集团	AIG UN	纽约证券交易所	美国	575	275,915.43	0.11
173	Sempra	Sempra	SRE UN	纽约证券交易所	美国	515	272,584.44	0.11
174	Ross Stores Inc	罗斯百货股份有限公司	ROST UW	纳斯达克证券交易所	美国	277	271,508.43	0.11
175	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	210	270,834.66	0.11
176	Simon Property Group Inc	西蒙房地产集团公司	SPG UN	纽约证券交易所	美国	267	269,743.78	0.11
177	Edwards Lifesciences Corp	爱德华生命科学公司	EW UN	纽约证券交易所	美国	497	268,407.77	0.11
178	IDEXX Laboratories Inc	爱德士股份有限公司	IDXX UW	纳斯达克证券交易所	美国	68	267,325.18	0.11
179	DR Horton Inc	霍顿房屋公司	DHI UN	纽约证券交易所	美国	247	265,877.90	0.10
180	MSCI Inc	MSCI 明晟	MSCI UN	纽约证券交易所	美国	65	260,411.40	0.10
181	Valero Energy Corp	Valero 能源	VLO UN	纽约证券交易所	美国	279	256,889.53	0.10
182	AutoZoo	AutoZoo	AZO	纽约证	美国	14	256,383	0.10

	ne Inc	ne 股份 有限公司	UN	券交易 所			.40	
183	Aflac Inc	家庭人 寿保险	AFL UN	纽约证 券交易 所	美国	436	254,764 .72	0.10
184	TE Connect ivity Ltd	泰科电 子公司	TEL UN	纽约证 券交易 所	美国	255	253,755 .43	0.10
185	Traveler s Cos Inc/The	旅行家 集团	TRV UN	纽约证 券交易 所	美国	187	252,297 .32	0.10
186	Copart Inc	Copart 股份有 限公司	CPRT UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	716	248,489 .45	0.10
187	America n Electric Power Co Inc	美国电 力	AEP UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	431	247,935 .72	0.10
188	Nucor Corp	纽柯公 司	NUE UN	纽约证 券交易 所	美国	201	247,767 .29	0.10
189	Monster Beverag e Corp	怪兽饮 料公司	MNST UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	605	246,860 .78	0.10
190	IQVIA Holdings Inc	艾昆纬	IQV UN	纽约证 券交易 所	美国	150	245,819 .27	0.10
191	William s Cos Inc/The	威廉姆 斯公司	WMB UN	纽约证 券交易 所	美国	996	245,703 .68	0.10
192	Realty Income Corp	Realty Income 公司	O UN	纽约证 券交易 所	美国	596	242,386 .43	0.10
193	MetLife Inc	大都会 集团	MET UN	纽约证 券交易 所	美国	509	238,404 .89	0.09
194	Kimberly-Clark Corp	金佰利	KMB UN	纽约证 券交易 所	美国	277	238,391 .43	0.09
195	ONEOK Inc	Oneok 股份有 限公司	OKE UN	纽约证 券交易 所	美国	477	237,234 .61	0.09

196	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	248	236,391.06	0.09
197	Agilent Technologies Inc	安捷伦	A UN	纽约证券交易所	美国	240	236,329.87	0.09
198	Bank of New York Mellon Corp/The	纽约梅隆银行股份有限公司	BK UN	纽约证券交易所	美国	630	232,252.36	0.09
199	L3Harris Technologies Inc	L3Harris Technologies 股份有限公司	LHX UN	纽约证券交易所	美国	155	231,222.53	0.09
200	Hess Corp	赫斯公司	HES UN	纽约证券交易所	美国	226	230,755.50	0.09
201	Centene Corp	Centene 公司	CNC UN	纽约证券交易所	美国	438	230,215.94	0.09
202	Occidental Petroleum Corp	西方石油	OXY UN	纽约证券交易所	美国	541	228,793.24	0.09
203	Dominion Energy Inc	Dominion 能源股份有限公司	D UN	纽约证券交易所	美国	685	228,027.53	0.09
204	United Rentals Inc	联合租赁公司	URI UN	纽约证券交易所	美国	56	227,436.26	0.09
205	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	557	227,393.48	0.09
206	Constellation Brands	星座品牌股份有限公司	STZ UN	纽约证券交易所	美国	132	226,016.04	0.09



	Inc	司						
207	Charter Communications Inc	Charter 通信公司	CHTR UW	纳斯达克证券交易所	美国	82	225,738 .11	0.09
208	Archer-Daniels-Midland Co	Archer-Daniels-Midland 公司	ADM UN	纽约证券交易所	美国	437	223,531 .00	0.09
209	Ameriprise Financial Inc	阿默普莱斯金融公司	AMP UN	纽约证券交易所	美国	83	223,288 .42	0.09
210	PG&E Corp	太平洋煤气电力	PCG UN	纽约证券交易所	美国	1,747	223,093 .79	0.09
211	Dow Inc	陶氏公司	DOW UN	纽约证券交易所	美国	574	222,950 .36	0.09
212	Paychex Inc	Paychex 公司	PAYX UW	纳斯达克证券交易所	美国	263	221,872 .16	0.09
213	AMETEK Inc	阿美特克股份有限公司	AME UN	纽约证券交易所	美国	189	220,726 .75	0.09
214	Cognizant Technology Solutions Corp	高知特科技公司	CTSH UW	纳斯达克证券交易所	美国	411	219,867 .05	0.09
215	General Mills Inc	通用磨坊	GIS UN	纽约证券交易所	美国	476	219,610 .73	0.09
216	Biogen Inc	渤健公司	BIIB UW	纳斯达克证券交易所	美国	119	218,102 .04	0.09
217	Prudential Financial Inc	保德信金融集团	PRU UN	纽约证券交易所	美国	296	217,425 .86	0.09
218	Constellation	美国联合能源	CEG UW	纳斯达克证券交易所	美国	262	216,908 .96	0.09

	Energy Corp	公司		交易所				
219	Lennar Corp	Lennar 公司	LEN UN	纽约证 券交易 所	美国	205	216,399 .15	0.09
220	Fortinet Inc	Fortinet 股份有 限公司	FTNT UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	522	216,395 .32	0.09
221	Kenvue Inc	Kenvue Inc	KVUE UN	纽约证 券交易 所	美国	1,412	215,316 .63	0.08
222	Fastenal Co	法思诺 公司	FAST UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	468	214,693 .35	0.08
223	Sysco Corp	Sysco 公司	SY UN	纽约证 券交易 所	美国	413	213,916 .59	0.08
224	Yum! Brands Inc	百胜餐 饮集团	YUM UN	纽约证 券交易 所	美国	230	212,847 .88	0.08
225	Otis Worldwide Corp	奥的斯 电梯公 司	OTIS UN	纽约证 券交易 所	美国	335	212,285 .87	0.08
226	Allstate Corp/Th e	好事达 保险公 司	ALL UN	纽约证 券交易 所	美国	214	212,167 .38	0.08
227	WW Grainger Inc	固安捷 股份有 限公司	GW UN	纽约证 券交易 所	美国	36	211,297 .06	0.08
228	Old Dominion Freight Line Inc	Old Dominion Freight Line 股 份有限 公司	ODFL UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	73	209,570 .65	0.08
229	ON Semiconductor Corp	安森美 半导体 公司	ON UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	353	208,841 .13	0.08
230	Exelon Corp	Exelon 公司	EXC UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	815	207,229 .18	0.08
231	CoStar	CoStar	CSGP	纳斯达	美国	334	206,731	0.08

	Group Inc	集团股份有限公司	UW	克证 券交易所			.69	
232	Rockwell Automation Inc	罗克韦尔自动化	ROK UN	纽约证 券交易所	美国	94	206,709 .45	0.08
233	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	485	206,347 .03	0.08
234	Gartner Inc	Gartner 公司	IT UN	纽约证 券交易所	美国	64	204,484 .92	0.08
235	PPG Industries Inc	PPG 工 业	PPG UN	纽约证 券交易所	美国	193	204,429 .03	0.08
236	Verisk Analytics Inc	Verisk 分析公 司	VRSK UW	纳斯达 克证 券交易所	美国	119	201,321 .07	0.08
237	Baker Hughes Co	贝克休 斯公司	BKR UW	纳斯达 克证 券交易所	美国	824	199,479 .43	0.08
238	Cencora Inc	Cencora 股份有 限公司	COR UN	纽约证 券交易所	美国	137	199,286 .35	0.08
239	Xcel Energy Inc	Xcel 能 源	XEL UW	纳斯达 克证 券交易所	美国	452	198,197 .46	0.08
240	Kinder Morgan Inc	特拉华 州金德 摩根公 司	KMI UN	纽约证 券交易所	美国	1,584	197,903 .10	0.08
241	Cummins Inc	康明斯	CMI UN	纽约证 券交易所	美国	116	196,829 .08	0.08
242	Estee Lauder Cos Inc/The	雅诗兰 黛	EL UN	纽约证 券交易所	美国	190	196,810 .53	0.08
243	Extra Space	Extra Space	EXR UN	纽约证 券交易	美国	173	196,453 .49	0.08

	Storage Inc	Storage 有限公司		所				
244	Republic Services Inc	公共服务公司	RSG UN	纽约证券交易所	美国	168	196,225.35	0.08
245	Corteva Inc	科迪华公司	CTVA UN	纽约证券交易所	美国	577	195,835.52	0.08
246	Keurig Dr Pepper Inc	Keurig Dr Pepper 有限公司	KDP UW	纳斯达克证券交易所	美国	825	194,696.34	0.08
247	Electronic Arts Inc	电子艺界	EA UW	纳斯达克证券交易所	美国	200	193,796.84	0.08
248	DuPont de Nemours Inc	杜邦公司	DD UN	纽约证券交易所	美国	352	191,794.98	0.08
249	Global Payments Inc	环汇有限公司	GPN UN	纽约证券交易所	美国	213	191,594.12	0.08
250	Moderna Inc	莫德纳公司	MRNA UW	纳斯达克证券交易所	美国	272	191,589.87	0.08
251	VICI Properties Inc	VICI Properties 股份有限公司	VICI UN	纽约证券交易所	美国	847	191,249.62	0.08
252	Halliburton Co	哈利伯顿	HAL UN	纽约证券交易所	美国	733	187,677.03	0.07
253	ANSYS Inc	ANSYS 股份有限公司	ANSS UW	纳斯达克证券交易所	美国	71	182,482.08	0.07
254	Consolidated Edison Inc	联合爱迪生	ED UN	纽约证券交易所	美国	283	182,340.64	0.07
255	Quanta	Quanta	PWR	纽约证	美国	119	181,885	0.07

	Services Inc	服务股份有限公司	UN	券交易所			.15	
256	Ingersoll Rand Inc	英格索兰股份有限公司	IR UN	纽约证券交易所	美国	332	181,861.64	0.07
257	Martin Marietta Materials Inc	Martin Marietta 材料股份有限公司	MLM UN	纽约证券交易所	美国	51	180,215.12	0.07
258	CDW Corp/DE	特拉华 CDW 公司	CDW UW	纳斯达克证券交易所	美国	110	177,104.33	0.07
259	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	193	177,007.79	0.07
260	Equifax Inc	Equifax 股份有限公司	EFX UN	纽约证券交易所	美国	101	176,899.57	0.07
261	Public Service Enterprise Group Inc	公共服务企业集团	PEG UN	纽约证券交易所	美国	408	176,707.70	0.07
262	GE Healthcare Technologies Inc	GE Healthcare Technologies Inc	GEHC UW	纳斯达克证券交易所	美国	321	175,790.63	0.07
263	Kroger Co/The	克罗格公司	KR UN	纽约证券交易所	美国	542	175,472.62	0.07
264	Vulcan Materials Co	Vulcan 材料	VMC UN	纽约证券交易所	美国	109	175,254.97	0.07
265	Monolithic Power	芯源系统有限公司	MPWR UW	纳斯达克证券交易所	美国	39	174,237.39	0.07

	Systems Inc							
266	Dollar General Corp	达乐公司	DG UN	纽约证券交易所	美国	180	173,320.75	0.07
267	Dollar Tree Inc	美元树公司	DLTR UW	纳斯达克证券交易所	美国	171	172,042.68	0.07
268	Kraft Heinz Co/The	卡夫亨氏公司	KHC UW	纳斯达克证券交易所	美国	653	171,032.61	0.07
269	Devon Energy Corp	戴文能源	DVN UN	纽约证券交易所	美国	525	168,444.31	0.07
270	Fair Isaac Corp	费埃哲公司	FICO UN	纽约证券交易所	美国	20	164,886.67	0.06
271	CBRE Group Inc	世邦魏理仕	CBRE UN	纽约证券交易所	美国	250	164,832.14	0.06
272	Keysight Technologies Inc	是德科技公司	KEYS UN	纽约证券交易所	美国	145	163,384.08	0.06
273	Discover Financial Services	Discover 金融服务公司	DFS UN	纽约证券交易所	美国	205	163,199.57	0.06
274	Hershey Co/The	好时公司	HSY UN	纽约证券交易所	美国	123	162,421.33	0.06
275	Diamondback Energy Inc	Diamondback 能源股份有限公司	FANG UW	纳斯达克证券交易所	美国	147	161,462.61	0.06
276	Arch Capital Group Ltd	阿契资本集团	ACGL UW	纳斯达克证券交易所	美国	306	160,965.83	0.06
277	Xylem Inc/NY	赛莱默公司	XYL UN	纽约证券交易所	美国	197	159,565.58	0.06

				所				
278	Edison International	爱迪生国际	EIX UN	纽约证券交易所	美国	314	158,991.46	0.06
279	SBA Communications Corp	SBA 通信公司	SBAC UW	纳斯达克证券交易所	美国	88	158,119.29	0.06
280	Mettler-Toledo International Inc	梅特勒-托利多国际股份有限公司	MTD UN	纽约证券交易所	美国	18	154,638.57	0.06
281	Avalon Bay Communities Inc	Avalon Bay 社区股份有限公司	AVB UN	纽约证券交易所	美国	116	153,818.68	0.06
282	WEC Energy Group Inc	WEC 能源集团股份有限公司	WEC UN	纽约证券交易所	美国	258	153,806.92	0.06
283	West Pharmaceutical Services Inc	西氏医药服务公司	WST UN	纽约证券交易所	美国	61	152,131.58	0.06
284	HP Inc	惠普	HPQ UN	纽约证券交易所	美国	712	151,740.33	0.06
285	Fortive Corp	福迪威公司	FTV UN	纽约证券交易所	美国	288	150,191.77	0.06
286	Delta Air Lines Inc	达美航空有限公司	DAL UN	纽约证券交易所	美国	527	150,161.81	0.06
287	American Water Works Co Inc	美国自来水股份有限公司	AWK UN	纽约证券交易所	美国	159	148,640.45	0.06
288	Take-Two Interactive	Take-Two 互动软件股	TTWO UW	纳斯达克证券交易所	美国	130	148,194.87	0.06

	ve Softwar e Inc	份有限 公司						
289	Aptiv PLC	Aptiv 公 共有限 公司	APT V UN	纽约证 券交易 所	美国	232	147,426 .68	0.06
290	Zimmer Biomet Holdin g s Inc	捷迈邦 美控股 股份有 限公司	ZBH UN	纽约证 券交易 所	美国	171	147,395 .94	0.06
291	Weyerh aeuser Co	惠好	WY UN	纽约证 券交易 所	美国	598	147,266 .76	0.06
292	Warner Bros Discove ry Inc	华纳兄 弟探索 股份有 限公司	WBD UN	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,818	146,532 .85	0.06
293	ResMed Inc	瑞思迈 股份有 限公司	RMD UN	纽约证 券交易 所	美国	120	146,203 .93	0.06
294	Willis Towers Watson PLC	韦莱韬 睿惠悦 公共有 限公司	WTW UN	纳斯达 克证券 交易所	美国	85	145,209 .52	0.06
295	Cardinal Health Inc	嘉德诺 健康集 团	CAH UN	纽约证 券交易 所	美国	203	144,929 .04	0.06
296	Lyondel Basell Industri es NV	利安德 巴塞尔 工业公 司	LYB UN	纽约证 券交易 所	美国	210	141,418 .85	0.06
297	Hartford Financia l Services Group Inc/The	哈特福 德金融 服务	HIG UN	纽约证 券交易 所	美国	246	140,049 .63	0.06
298	State Street Corp	道富集 团	STT UN	纽约证 券交易 所	美国	255	139,899 .62	0.05
299	Broadri dge Financia l	布罗德 里奇金 融解决 方案股	BR UN	纽约证 券交易 所	美国	96	139,897 .49	0.05



	Solution s Inc	份有限 公司						
300	T Rowe Price Group Inc	普徠仕	TROW UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	183	139,580 .68	0.05
301	Ulta Beauty Inc	Ulta 美 容产品 公司	ULTA UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	40	138,818 .09	0.05
302	Fifth Third Bancorp	五三银 行	FITB UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	558	136,309 .54	0.05
303	Corning Inc	康宁公 司	GLW UN	纽约证 券交易 所	美国	629	135,655 .31	0.05
304	Tractor Supply Co	拖拉机 供应公 司	TSCO UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	89	135,546 .38	0.05
305	Church & Dwight Co Inc	切迟杜 威股份 有限公司	CHD UN	纽约证 券交易 所	美国	202	135,287 .50	0.05
306	Westing house Air Brake Technol ogies Corp	西屋制 动公司	WAB UN	纽约证 券交易 所	美国	147	132,122 .81	0.05
307	M&T Bank Corp	M&T 银行	MTB UN	纽约证 券交易 所	美国	136	132,041 .93	0.05
308	DTE Energy Co	DTE 能 源	DTE UN	纽约证 券交易 所	美国	169	131,978 .61	0.05
309	eBay Inc	eBay 公 司	EBAY UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	425	131,302 .63	0.05
310	PulteGr oup Inc	Pulte 集 团公司	PHM UN	纽约证 券交易 所	美国	177	129,400 .50	0.05
311	Illumina Inc	Illumina 公司	ILMN UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	130	128,205 .37	0.05

312	Hewlett Packard Enterprise Co	慧与	HPE UN	纽约证券交易所	美国	1,051	126,397.72	0.05
313	STERIS PLC	思泰瑞医疗公共有限公司	STE UN	纽约证券交易所	美国	81	126,127.66	0.05
314	Dover Corp	都福	DOV UN	纽约证券交易所	美国	115	125,279.86	0.05
315	Eversource Energy	Eversource 能源公司	ES UN	纽约证券交易所	美国	286	125,023.25	0.05
316	Entergy Corp	Entergy 公司	ETR UN	纽约证券交易所	美国	173	123,988.83	0.05
317	Equity Residential	公寓物业权益信托	EQR UN	纽约证券交易所	美国	286	123,888.89	0.05
318	Teledyne Technologies Inc	Teledyne 科技股份有限公司	TDY UN	纽约证券交易所	美国	39	123,276.59	0.05
319	Molina Healthcare Inc	Molina Healthcare 股份有限公司	MOH UN	纽约证券交易所	美国	48	122,834.42	0.05
320	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	320	122,661.03	0.05
321	Raymond James Financial Inc	Raymond James 金融股份有限公司	RJF UN	纽约证券交易所	美国	155	122,406.76	0.05
322	PTC Inc	PTC 公司	PTC UW	纳斯达克证券交易所	美国	97	120,201.35	0.05
323	Internati	国际香	IFF UN	纽约证	美国	209	119,858	0.05

	onal Flavors & Fragran ces Inc	料		券交易 所			.62	
324	Builders FirstSou rce Inc	Builders FirstSou rce 股份 有限公 司	BLDR UN	纽约证 券交易 所	美国	101	119,420 .98	0.05
325	Iron Mountai n Inc	美国铁 山公司	IRM UN	纽约证 券交易 所	美国	239	118,459 .72	0.05
326	FleetCo r Technol ogies Inc	FleetCo r 技术股 份有限 公司	FLT UN	纽约证 券交易 所	美国	59	118,096 .87	0.05
327	Ventas Inc	Ventas 公司	VTR UN	纽约证 券交易 所	美国	333	117,549 .59	0.05
328	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	109	117,184 .05	0.05
329	PPL Corp	PPL 公 司	PPL UN	纽约证 券交易 所	美国	604	115,932 .47	0.05
330	Darden Restaur ants Inc	达登餐 饮公司	DRI UN	纽约证 券交易 所	美国	99	115,205 .07	0.05
331	Alexand ria Real Estate Equities Inc	亚历山 大房地 产股份 有限公 司	ARE UN	纽约证 券交易 所	美国	128	114,927 .86	0.05
332	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	279	114,888 .90	0.05
333	Baxter Internati onal Inc	百特	BAX UN	纽约证 券交易 所	美国	416	113,907 .95	0.04
334	Garmin	佳明有	GRMN	纽约证	美国	125	113,801	0.04

	Ltd	限公司	UN	券交易所			.28	
335	Invitation Homes Inc	邀请家园公司	INVH UN	纽约证券交易所	美国	471	113,789.31	0.04
336	Genuine Parts Co	原配部件	GPC UN	纽约证券交易所	美国	115	112,809.70	0.04
337	Laboratory Corp of America Holdings	美国实验控股	LH UN	纽约证券交易所	美国	70	112,687.88	0.04
338	Targa Resources Corp	Targa 资源公司	TRGP UN	纽约证券交易所	美国	183	112,595.17	0.04
339	Align Technology Inc	Align 科技股份有限公司	ALGN UW	纳斯达克证券交易所	美国	58	112,558.27	0.04
340	Waters Corp	沃特世公司	WAT UN	纽约证券交易所	美国	48	111,928.19	0.04
341	Coterra Energy Inc	Coterra 能源股份有限公司	CTRA UN	纽约证券交易所	美国	616	111,342.31	0.04
342	Ameren Corp	Ameren 公司	AEE UN	纽约证券交易所	美国	215	110,157.94	0.04
343	Cooper Cos Inc/The	库柏股份有限公司	COO UW	纳斯达克证券交易所	美国	41	109,895.46	0.04
344	FirstEnergy Corp	第一能源	FE UN	纽约证券交易所	美国	423	109,832.70	0.04
345	Cboe Global Markets Inc	Cboe 环球市场公司	CBOE UF	Cboe BZX 交易所	美国	86	108,763.07	0.04
346	Walgreens Boots	沃博联股份有	WBA UW	纳斯达克证券	美国	587	108,553.50	0.04

	Alliance Inc	限公司		交易所				
347	Carnival Corp	嘉年华公司	CCL UN	纽约证券交易所	美国	825	108,333.44	0.04
348	First Solar Inc	福思第一太阳能公司	FSLR UW	纳斯达克证券交易所	美国	88	107,378.26	0.04
349	Expeditors International of Washington Inc	华盛顿康捷国际物流公司	EXPD UN	纽约证券交易所	美国	119	107,209.41	0.04
350	Huntington Bancshares Inc/OH	俄亥俄州亨廷顿银行控股公司	HBAN UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,186	106,849.05	0.04
351	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	171	106,774.25	0.04
352	VeriSign Inc	威瑞信股份有限公司	VRSN UW	纳斯达克证券交易所	美国	73	106,488.96	0.04
353	Axon Enterprise Inc	Axon Enterprise 股份有限公司	AXON UW	纳斯达克证券交易所	美国	58	106,121.09	0.04
354	Las Vegas Sands Corp	拉斯维加斯金沙集团	LVS UN	纽约证券交易所	美国	302	105,258.98	0.04
355	Ball Corp	波尔	BALL UN	纽约证券交易所	美国	258	105,108.40	0.04
356	Veralto Corp	Veralto Corp	VLTO UN	纽约证券交易所	美国	180	104,872.12	0.04
357	Enphase Energy Inc	Enphase 能源股份有限公司	ENPH UQ	纳斯达克证券交易所	美国	112	104,821.69	0.04

		公司						
358	FactSet Research Systems Inc	FactSet 研究系统股份有限公司	FDS UN	纽约证券交易所	美国	31	104,742.86	0.04
359	CenterPoint Energy Inc	中点能源	CNP UN	纽约证券交易所	美国	517	104,616.37	0.04
360	Regions Financial Corp	地区金融公司	RF UN	纽约证券交易所	美国	762	104,594.20	0.04
361	Steel Dynamics Inc	Steel Dynamics 股份有限公司	STLD UW	纳斯达克证券交易所	美国	125	104,558.36	0.04
362	Skyworks Solutions Inc	思佳讯解决方案公司	SWKS UW	纳斯达克证券交易所	美国	131	104,307.06	0.04
363	Akamai Technologies Inc	阿卡迈技术公司	AKAM UW	纳斯达克证券交易所	美国	124	103,941.46	0.04
364	Clorox Co/The	高乐氏公司	CLX UN	纽约证券交易所	美国	102	103,012.06	0.04
365	Hubbell Inc	哈贝尔公司	HUBB UN	纽约证券交易所	美国	44	102,507.35	0.04
366	Hologic Inc	豪洛捷公司	HOLX UW	纳斯达克证券交易所	美国	201	101,717.84	0.04
367	Northern Trust Corp	北美信托	NTRS UW	纳斯达克证券交易所	美国	170	101,598.50	0.04
368	Tyler Technologies Inc	Tyler 科技公司	TYL UN	纽约证券交易所	美国	34	100,688.23	0.04
369	Principal	信安金融	PFG UW	纳斯达克证券	美国	180	100,295.28	0.04

	Financia l Group Inc			交易所				
370	Atmos Energy Corp	Atmos 能源公 司	ATO UN	纽约证 券交易 所	美国	122	100,147 .96	0.04
371	McCor mick & Co Inc/MD	味好美 股份有 限公司/ 马里兰 州	MKC UN	纽约证 券交易 所	美国	206	99,827. 26	0.04
372	Southw est Airlines Co	西南航 空	LUV UN	纽约证 券交易 所	美国	488	99,819. 61	0.04
373	Omnico m Group Inc	Omnico m 集团	OMC UN	纽约证 券交易 所	美国	162	99,261. 35	0.04
374	EPAM Systems Inc	EPAM 系统公 司	EPAM UN	纽约证 券交易 所	美国	47	98,980. 59	0.04
375	Western Digital Corp	西部数 据公司	WDC UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	266	98,664. 99	0.04
376	CMS Energy Corp	CMS 能源	CMS UN	纽约证 券交易 所	美国	239	98,298. 88	0.04
377	Albema rle Corp	雅保公 司	ALB UN	纽约证 券交易 所	美国	96	98,237. 62	0.04
378	Brown & Brown Inc	Brown & Brown 股份有 限公司	BRO UN	纽约证 券交易 所	美国	193	97,204. 60	0.04
379	Seagate Technol ogy Holdin g s PLC	Seagate Technol ogy 控 股公共 有限公司	STX UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	159	96,139. 37	0.04
380	Teradyn e Inc	泰瑞达	TER UW	纳斯达 克证券	美国	125	96,076. 83	0.04

				交易所				
381	IDEX Corp	艺达思集团	IEX UN	纽约证券交易所	美国	62	95,338.95	0.04
382	JB Hunt Transport Services Inc	JB Hunt 运输服务股份有限公司	JBHT UW	纳斯达克证券交易所	美国	67	94,784.80	0.04
383	Jabil Inc	捷普集团	JBL UN	纽约证券交易所	美国	105	94,745.28	0.04
384	Jacobs Solutions Inc	Jacobs Solutions Inc	J UN	纽约证券交易所	美国	103	94,691.45	0.04
385	Cincinnati Financial Corp	辛辛那提金融	CINF UW	纳斯达克证券交易所	美国	129	94,528.12	0.04
386	Avery Dennison Corp	艾利丹尼森	AVY UN	纽约证券交易所	美国	66	94,501.35	0.04
387	Essex Property Trust Inc	埃塞克斯房地产信托公司	ESS UN	纽约证券交易所	美国	53	93,072.49	0.04
388	EQT Corp	EQT 公司	EQT UN	纽约证券交易所	美国	337	92,276.39	0.04
389	Textron Inc	德事隆	TXT UN	纽约证券交易所	美国	161	91,704.11	0.04
390	Synchrony Financial	同步金融公司	SYF UN	纽约证券交易所	美国	339	91,695.54	0.04
391	Mid-America Apartment Communities Inc	Mid-America Apartment Communities 股份有限公司	MAA UN	纽约证券交易所	美国	96	91,424.62	0.04



392	Lamb Weston Holdings Inc	蓝威斯顿控股股份有限公司	LW UN	纽约证券交易所	美国	119	91,102.72	0.04
393	Pool Corp	Pool 公司	POOL UW	纳斯达克证券交易所	美国	32	90,366.19	0.04
394	Celanesco Corp	塞拉尼斯公司	CE UN	纽约证券交易所	美国	82	90,236.01	0.04
395	Everest Group Ltd	Everest 集团有限公司	EG UN	纽约证券交易所	美国	36	90,154.84	0.04
396	Quest Diagnostics Inc	Quest Diagnostics 股份有限公司	DGX UN	纽约证券交易所	美国	92	89,843.77	0.04
397	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	382	89,663.30	0.04
398	Tyson Foods Inc	泰森食品公司	TSN UN	纽约证券交易所	美国	234	89,082.66	0.04
399	Best Buy Co Inc	百思买	BBY UN	纽约证券交易所	美国	159	88,154.97	0.03
400	Snap-on Inc	实耐宝	SNA UN	纽约证券交易所	美国	43	87,967.98	0.03
401	CF Industries Holdings Inc	CF 工业控股股份有限公司	CF UN	纽约证券交易所	美国	156	87,839.65	0.03
402	Insulet Corp	Insulet 股份有限公司	PODD UW	纳斯达克证券交易所	美国	57	87,597.84	0.03
403	Stanley Black & Decker Inc	史丹利百得公司	SWK UN	纽约证券交易所	美国	126	87,546.42	0.03
404	Masco	马斯可	MAS	纽约证	美国	184	87,289.	0.03

	Corp		UN	券交易所			46	
405	Leidos Holdings Inc	Leidos 控股公司	LDOS UN	纽约证券交易所	美国	113	86,629.35	0.03
406	Kellanova	Kellanova	K UN	纽约证券交易所	美国	216	85,534.65	0.03
407	Bunge Global SA	Bunge Global SA	BG US	美国证券交易所	美国	119	85,084.83	0.03
408	Domino's Pizza Inc	达美乐披萨公司	DPZ UN	纽约证券交易所	美国	29	84,671.34	0.03
409	Packaging Corp of America	美国包装公司	PKG UN	纽约证券交易所	美国	73	84,230.51	0.03
410	WR Berkley Corp	WR Berkley 公司	WRB UN	纽约证券交易所	美国	167	83,648.39	0.03
411	Nordson Corp	诺信公司	NDSN UW	纳斯达克证券交易所	美国	44	82,322.51	0.03
412	Marathon Oil Corp	Marathon 石油公司	MRO UN	纽约证券交易所	美国	479	81,965.54	0.03
413	Zebra Technologies Corp	斑马技术公司	ZBRA UW	纳斯达克证券交易所	美国	42	81,308.40	0.03
414	Arcor PLC	安姆科公司	AMCR UN	纽约证券交易所	美国	1,184	80,840.24	0.03
415	Host Hotels & Resorts Inc	Host 酒店及度假股份有限公司	HST UW	纳斯达克证券交易所	美国	578	79,706.30	0.03
416	Conagra Brands Inc	康尼格拉品牌股份有限公司	CAG UN	纽约证券交易所	美国	391	79,369.16	0.03
417	United	美国联	UAL	纳斯达克	美国	269	78,610.	0.03

	Airlines Holding s Inc	合航空 控股股 份有限 公司	UW	克证券 交易所			46	
418	KeyCorp	KeyCorp 公司	KEY UN	纽约证 券交易 所	美国	767	78,227.00	0.03
419	Revvity Inc	Revvity 股份有 限公司	RVTY UN	纽约证 券交易 所	美国	101	78,195.20	0.03
420	JM Smucker Co/The	JM 斯 马克公 司	SJM UN	纽约证 券交易 所	美国	87	77,874.71	0.03
421	Live Nation Entertainment Inc	Live Nation 娱乐公 司	LYV UN	纽约证 券交易 所	美国	116	76,901.12	0.03
422	Trimble Inc	天宝股 份有限 公司	TRMB UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	204	76,867.13	0.03
423	Kimco Realty Corp	Kimco Realty Corp	KIM UN	纽约证 券交易 所	美国	508	76,673.63	0.03
424	Alliant Energy Corp	Alliant 能源公 司	LNT UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	209	75,938.58	0.03
425	Viatrix Inc	晖致	VTRS UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	983	75,401.65	0.03
426	AES Corp/Th e	爱伊斯 公司	AES UN	纽约证 券交易 所	美国	548	74,715.40	0.03
427	Gen Digital Inc	Gen Digital 股份有 限公司	GEN UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	462	74,671.77	0.03
428	LKQ Corp	LKQ 公司	LKQ UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	219	74,127.61	0.03
429	Loews Corp	罗斯公 司	L UN	纽约证 券交易 所	美国	150	73,932.76	0.03

430	Interpublic Group of Cos Inc/The	Interpublic 集团	IPG UN	纽约证券交易所	美国	314	72,590.31	0.03
431	International Paper Co	国际纸业	IP UN	纽约证券交易所	美国	283	72,459.21	0.03
432	News Corp	新闻集团	NWSA UW	纳斯达克证券交易所	美国	312	54,250.65	0.02
433	News Corp	新闻集团	NWS UW	纳斯达克证券交易所	美国	94	17,123.70	0.01
434	Rollins Inc	Rollins 公司	ROL UN	纽约证券交易所	美国	230	71,139.35	0.03
435	Bio-Techne Corp	Bio-techn 公司	TECH UW	纳斯达克证券交易所	美国	130	71,045.15	0.03
436	MGM Resorts International	美高梅国际酒店集团	MGM UN	纽约证券交易所	美国	224	70,885.93	0.03
437	CarMax Inc	CarMax 股份有限公司	KMX UN	纽约证券交易所	美国	130	70,658.43	0.03
438	Charles River Laboratories International Inc	查里斯河实验室国际有限公司	CRL UN	纽约证券交易所	美国	42	70,322.71	0.03
439	Pentair PLC	Pentair 公共有限公司	PNR UN	纽约证券交易所	美国	135	69,522.72	0.03
440	Evergy Inc	Evergy 股份有限公司	EVRG UW	纳斯达克证券交易所	美国	188	69,506.78	0.03
441	Jack Henry & Associat	Jack Henry & Associat	JKHY UW	纳斯达克证券交易所	美国	60	69,443.04	0.03

	es Inc	es 公司						
442	Mosaic Co/The	Mosaic 公司	MOS UN	纽约证券交易所	美国	268	67,821.39	0.03
443	NRG Energy Inc	NRG 能源股份有限公司	NRG UN	纽约证券交易所	美国	185	67,742.48	0.03
444	Incyte Corp	因赛特公司	INCY UW	纳斯达克证券交易所	美国	152	67,597.86	0.03
445	UDR Inc	UDR 公司	UDR UN	纽约证券交易所	美国	248	67,256.75	0.03
446	Teleflex Inc	泰利福公司	TFX UN	纽约证券交易所	美国	38	67,108.02	0.03
447	Molson Coors Beverage Co	莫尔森库尔斯饮料公司	TAP UN	纽约证券交易所	美国	152	65,896.87	0.03
448	Allegion plc	安朗杰公共有限公司	ALLE UN	纽约证券交易所	美国	72	64,606.12	0.03
449	Market Axess Holdings Inc	Market Axess 控股公司	MKTX UW	纳斯达克证券交易所	美国	31	64,299.23	0.03
450	Regency Centers Corp	Regency Centers 公司	REG UW	纳斯达克证券交易所	美国	135	64,063.02	0.03
451	Qorvo Inc	Qorvo 股份有限公司	QRVO UW	纳斯达克证券交易所	美国	80	63,806.63	0.03
452	APA Corp	APA	APA UW	纳斯达克证券交易所	美国	251	63,785.95	0.03
453	Fox Corp	福克斯公司	FOXA UW	纳斯达克证券交易所	美国	202	42,449.03	0.02
454	Fox Corp	福克斯公司	FOX UW	纳斯达克证券交易所	美国	108	21,150.36	0.01

455	NiSource Inc	NiSource 公司	NI UN	纽约证券交易所	美国	338	63,559.44	0.02
456	Healthpeak Properties Inc	Healthpeak Properties Inc	PEAK UN	纽约证券交易所	美国	448	62,826.38	0.02
457	F5 Inc	F5 股份有限公司	FFIV UW	纳斯达克证券交易所	美国	49	62,115.42	0.02
458	Westrock Co	WestRock 公司	WRK UN	纽约证券交易所	美国	210	61,755.48	0.02
459	Eastman Chemical Co	伊士曼化工	EMN UN	纽约证券交易所	美国	97	61,708.31	0.02
460	Camden Property Trust	Camden 房地产信托公司	CPT UN	纽约证券交易所	美国	87	61,181.99	0.02
461	Ceridian HCM Holding Inc	Ceridian 人力资本管理控股股份有限公司	CDAY UN	纽约证券交易所	美国	128	60,850.03	0.02
462	Huntington Ingalls Industries Inc	Huntington Ingalls 工业公司	HII UN	纽约证券交易所	美国	33	60,685.42	0.02
463	Brown-Forman Corp	百富门公司	BF/B UN	纽约证券交易所	美国	150	60,663.33	0.02
464	Globe Life Inc	Globe Life 股份有限公司	GL UN	纽约证券交易所	美国	70	60,347.44	0.02
465	A O Smith Corp	AO 史密斯公司	AOS UN	纽约证券交易所	美国	101	58,973.68	0.02
466	Caesars Entertainment	凯撒娱乐集团	CZR UW	纳斯达克证券交易所	美国	177	58,770.54	0.02

	Inc							
467	CH Robinso n Worldw ide Inc	罗宾逊 全球物 流有限 公司	CHRW UN	纳斯达 克证券 交易所	美国	96	58,739. 95	0.02
468	Boston Properti es Inc	波士顿 地产公 司	BXP UN	纽约证 券交易 所	美国	118	58,645. 18	0.02
469	Paycom Softwar e Inc	Paycom 软件股 份有限 公司	PAYC UN	纽约证 券交易 所	美国	40	58,565. 43	0.02
470	Match Group Inc	Match 集团股 份有限 公司	MTCH UN	纳斯达 克证券 交易所	美国	223	57,649. 64	0.02
471	Henry Schein Inc	亨利香 恩公司	HSIC UN	纳斯达 克证券 交易所	美国	107	57,376. 74	0.02
472	Bath & Body Works Inc	Bath & Body Works 股份有 限公司	BBWI UN	纽约证 券交易 所	美国	186	56,858. 22	0.02
473	Etsy Inc	Etsy 股 份有限 公司	ETSY UN	纳斯达 克证券 交易所	美国	98	56,257. 18	0.02
474	Juniper Networ ks Inc	瞻博网 络股份 有限公 司	JNPR UN	纽约证 券交易 所	美国	261	54,496. 28	0.02
475	Robert Half Inc	罗致恒 富	RHI UN	纽约证 券交易 所	美国	87	54,175. 86	0.02
476	Univers al Health Services Inc	Univers al 保健 服务股 份有限 公司	UHS UN	纽约证 券交易 所	美国	50	53,984. 34	0.02
477	Hormel Foods Corp	荷美尔 食品有 限公司	HRL UN	纽约证 券交易 所	美国	237	53,899. 84	0.02
478	America	美国航	AAL	纳斯达	美国	535	52,064.	0.02

	n Airlines Group Inc	空集团公司	UW	克证券交易所			22	
479	Assurant Inc	安信龙集团	AIZ UN	纽约证券交易所	美国	43	51,314.66	0.02
480	Wynn Resorts Ltd	永利渡假村有限公司	WYNN UN	纳斯达克证券交易所	美国	79	50,979.08	0.02
481	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	348	49,394.18	0.02
482	Campbell Soup Co	金宝汤	CPB UN	纽约证券交易所	美国	161	49,295.80	0.02
483	Tapestry Inc	TPR-D RS-RS	TPR UN	纽约证券交易所	美国	188	49,014.27	0.02
484	BorgWarner Inc	博格华纳股份有限公司	BWA UN	纽约证券交易所	美国	193	49,005.56	0.02
485	Franklin Resources Inc	富兰克林资源	BEN UN	纽约证券交易所	美国	231	48,739.53	0.02
486	Pinnacle West Capital Corp	Pinnacle 西部资本	PNW UN	纽约证券交易所	美国	93	47,320.37	0.02
487	Catalent Inc	康泰伦特股份有限公司	CTLT UN	纽约证券交易所	美国	148	47,097.41	0.02
488	Invesco Ltd	景顺有限公司	IVZ UN	纽约证券交易所	美国	368	46,498.78	0.02
489	Generac Holdings Inc	Generac 控股公司	GNRC UN	纽约证券交易所	美国	50	45,768.41	0.02
490	FMC	FMC 公	FMC	纽约证	美国	102	45,549.	0.02



	Corp	司	UN	券交易所			55	
491	Federal Realty Investment Trust	联邦房地产投资信托公司	FRT US	美国证券交易所	美国	61	44,522.21	0.02
492	DENTSPLY SIRON A Inc	登士柏西诺德公司	XRAY UW	纳斯达克证券交易所	美国	174	43,860.75	0.02
493	Comerica Inc	Comerica 公司	CMA UN	纽约证券交易所	美国	108	42,690.83	0.02
494	Paramount Global	派拉蒙全球	PARA UW	纳斯达克证券交易所	美国	395	41,377.49	0.02
495	Bio-Rad Laboratories Inc	伯乐生命医学产品有限公司	BIO UN	纽约证券交易所	美国	17	38,877.86	0.02
496	Whirlpool Corp	惠而浦	WHR UN	纽约证券交易所	美国	45	38,810.72	0.02
497	Hasbro Inc	孩之宝	HAS UW	纳斯达克证券交易所	美国	107	38,695.76	0.02
498	Zions Bancorp NA	锡安银行	ZION UW	纳斯达克证券交易所	美国	121	37,596.88	0.01
499	VF Corp	VF 公司	VFC UN	纽约证券交易所	美国	271	36,084.94	0.01
500	Ralph Lauren Corp	拉夫劳伦	RL UN	纽约证券交易所	美国	33	33,703.74	0.01
501	DaVita Inc	DaVita 股份有限公司	DVA UN	纽约证券交易所	美国	44	32,647.28	0.01
502	Mohawk Industries Inc	Mohawk 工业股份有限公司	MHK UN	纽约证券交易所	美国	43	31,521.56	0.01

### 8.4.1.2 积极投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的权益投资。

## 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

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	Apple Inc	AAPL UW	49,223,753.63	19.34
2	Microsoft Corp	MSFT UW	43,713,070.42	17.18
3	Amazon.com Inc	AMZN UW	19,861,398.84	7.81
4	NVIDIA Corp	NVDA UW	16,104,269.23	6.33
5	Alphabet Inc	GOOGL UW	12,826,743.51	5.04
6	Tesla Inc	TSLA UW	11,541,136.14	4.54
7	Berkshire Hathaway Inc	BRK/B UN	11,396,738.62	4.48
8	Alphabet Inc	GOOG UW	11,151,449.00	4.38
9	Meta Platforms Inc	META UW	10,430,986.47	4.10
10	UnitedHealth Group Inc	UNH UN	8,682,783.80	3.41
11	Exxon Mobil Corp	XOM UN	8,590,752.26	3.38
12	Johnson & Johnson	JNJ UN	7,817,546.48	3.07
13	JPMorgan Chase & Co	JPM UN	7,813,590.69	3.07
14	Visa Inc	V UN	7,207,810.28	2.83
15	Procter & Gamble Co/The	PG UN	6,782,776.59	2.67
16	Broadcom Inc	AVGO UW	6,234,966.72	2.45
17	Eli Lilly & Co	LLY UN	6,232,302.88	2.45
18	Mastercard Inc	MA UN	6,135,946.61	2.41
19	Home Depot Inc/The	HD UN	5,851,004.66	2.30
20	Chevron Corp	CVX UN	5,652,020.39	2.22
21	AbbVie Inc	ABBV UN	5,252,289.53	2.06
22	Merck & Co Inc	MRK UN	5,232,568.11	2.06

注:1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2、买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票,买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

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

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	Apple Inc	AAPL UW	37,923,449.30	14.90
2	Microsoft Corp	MSFT UW	35,431,560.61	13.92
3	Amazon.com Inc	AMZN UW	16,417,838.46	6.45
4	NVIDIA Corp	NVDA UW	14,503,426.86	5.70
5	Alphabet Inc	GOOGL UW	10,523,808.94	4.14
6	Alphabet Inc	GOOG UW	9,289,916.57	3.65
7	Meta Platforms Inc	META UW	9,231,114.51	3.63
8	Tesla Inc	TSLA UW	8,907,283.29	3.50
9	Berkshire Hathaway Inc	BRK/B UN	8,697,113.48	3.42
10	UnitedHealth Group Inc	UNH UN	6,727,630.85	2.64
11	Exxon Mobil Corp	XOM UN	6,185,941.96	2.43
12	JPMorgan Chase & Co	JPM UN	6,084,828.47	2.39
13	Eli Lilly & Co	LLY UN	5,760,056.65	2.26
14	Johnson & Johnson	JNJ UN	5,730,614.01	2.25
15	Visa Inc	V UN	5,492,074.23	2.16
16	Broadcom Inc	AVGO UW	5,374,862.18	2.11
17	Procter & Gamble Co/The	PG UN	4,837,836.49	1.90
18	Mastercard Inc	MA UN	4,702,306.18	1.85
19	Home Depot Inc/The	HD UN	4,414,368.81	1.73
20	Chevron Corp	CVX UN	4,033,160.51	1.59

注:1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2、卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票,卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

## 8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位:人民币元

买入成本(成交)总额	692,523,518.81
卖出收入(成交)总额	525,576,951.70

## 8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

### 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
1	期货	ES2403 FDER	572,361.84	0.22

### 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

本基金本报告期末未持有基金。

### 8.11 投资组合报告附注

#### 8.11.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。如是,还应对相关证券的投资决策程序做出说明

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

#### 8.11.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是,还应对相关股票的投资决策程序做出说明

根据基金合同规定,本基金的投资范围不包括股票。

#### 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 (元)
1	存出保证金	1,493,918.50
2	应收清算款	17,943,020.23
3	应收股利	241,512.11
4	应收利息	-
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,678,450.84

#### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

##### 8.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,439	144,359.97	133,969,400.00	64.49%	73,764,600.00	35.51%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	MORGAN STANLEY & CO. INTERNATIONAL PLC.	56,050,300.00	26.98%
2	国泰君安证券股份有限公司	29,911,000.00	14.40%
3	BARCLAYS BANK PLC	13,290,800.00	6.40%
4	上海迎水投资管理有限公司-迎水长丰 1 号私募证券投资基金	8,843,400.00	4.26%
5	深圳前海千惠资产管理有限公司-千惠广盈 5 号私募证券投资基金	8,667,000.00	4.17%
6	上海迎水投资管理有限公司-迎水长丰 10 号私募证券投资基金	7,884,100.00	3.80%
7	罗萍	6,242,400.00	3.00%

8	黄秋元	5,754,200.00	2.77%
9	汤伟	5,500,000.00	2.65%
10	黄志霖	4,731,600.00	2.28%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本公司的所有从业人员(包含高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理)均未持有本基金份额。

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。

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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2023年3月23日)基金份额总额	420,734,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	349,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	562,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	207,734,000.00

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

#### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

#### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金的审计事务所无变化，目前已为本基金提供审计服务 1 年，本报告期应支付给报酬为人民币 55,000.00 元。

#### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

##### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

##### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

#### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
CITI Group Global Markets Asia Limited	-	727,247,252.47	59.75%	107,502.91	48.08%	-
China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	-	423,699,940.50	34.81%	82,954.33	37.10%	-
GuangFa	-	66,282,539.13	5.45%	33,142.69	14.82%	-

Securities (Hong Kong)Busi ness Limited						
华泰证券	2	-	-	-	-	-

注：交易单元的选择标准和程序根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

C：报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

新增交易单元：

华泰证券

退租交易单元：

无

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
CITI Group Global	-	-	-	-	-	-



Markets Asia Limited							
China Internatio nal Capital Corporati on Hong Kong Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-
GuangFa Securities (Hong Kong)Bus iness Limited	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 基金合同及招募说明书提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-01-18
2	关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 调整募集期限的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-06
3	南方基金关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 增加部分券商为网下发售代理机构的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-11
4	南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 上网发售提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-16
5	南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 开放日常申购与赎回业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-30
6	关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 2023 年境外主要市场节假日申购赎回安排的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-30
7	南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 上市交易公告书提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会	2023-03-30

		会基金电子披露网站	
8	南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）上市交易公告书	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-30
9	南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）上市交易提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-04
10	南方基金关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）增加部分券商为申购赎回代理券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-18
11	南方基金关于旗下部分基金增加华福证券为申购赎回代理券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-30
12	南方基金关于旗下部分基金增加德邦证券为申购赎回代理券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-07-11
13	南方基金管理股份有限公司关于运用自有资金投资旗下基金的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-08-21
14	南方基金管理股份有限公司关于终止凤凰金信（海口）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-09-07
15	南方基金管理股份有限公司关于终止南京途牛基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-09-07
16	南方基金关于旗下部分基金增加平安证券为申购赎回代理券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-10-31
17	南方基金管理股份有限公司关于运用自有资金投资旗下权益类公募基金的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-11-03
18	南方基金关于旗下部分基金增加浙商证券为申购赎回代理券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-11-16
19	南方基金关于旗下部分基金增加西部证券为申购赎回代理券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-12-01
20	南方基金关于旗下部分基金增加中泰证券为申购赎回代理券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-12-04
21	南方基金关于电子直销平台相关业务费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-12-15
22	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加	中国证券报、基金管	2023-12-21

	信达证券为一级交易商的公告	理人网站、中国证监会基金电子披露网站	
23	关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2024 年境外主要市场节假日申购赎回安排的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-12-28

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20230323-20231213	-	200,000,000.00	200,000,000.00	-	-
机构	2	20230815-20230910; 20230404-20230409	-	743,489,300.00	730,198,500.00	13,290,800.00	6.40%
产品特有风险							
本基金存在持有基金份额超过 20%的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。							

注：申购份额包含红利再投资和份额折算。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的文件；
- 2、《南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》；
- 3、《南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；

6、《南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2023 年年度报告》原文。

### 13.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

### 13.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>