

南方标普 500 交易型开放式指数证券 投资基金（QDII）2025 年中期报告

2025 年 06 月 30 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：2025 年 8 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的法律责任。本中期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 2025 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
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.....	10
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	12
§5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	37
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	37
7.4 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.....	37
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	79
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	81
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	82

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	82
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	82
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	82
7.11 投资组合报告附注.....	82
§8 基金份额持有人信息.....	83
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	83
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	83
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	84
8.4 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.....	84
§9 开放式基金份额变动.....	84
§10 重大事件揭示.....	84
10.1 基金份额持有人大会决议.....	84
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	84
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	85
10.4 基金投资策略的改变.....	85
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	85
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	85
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	85
10.8 其他重大事件.....	86
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	89
11.1 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	90
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	90
§12 备查文件目录.....	90
12.1 备查文件目录.....	90
12.2 存放地点.....	90
12.3 查阅方式.....	90

§ 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 南方
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	2,179,734,000.00 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	鲍文革	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		境外投资顾问	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		-	50/F Champion Tower, Three Garden Road Central, HK
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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

		金额单位：人民币元
3.1.1 期间数据和指标		报告期(2025 年 1 月 1 日 - 2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益		-19,053,051.72
本期利润		133,784,321.94
加权平均基金份额本期利润		0.0542
本期加权平均净值利润率		3.61%
本期基金份额净值增长率		5.00%
3.1.2 期末数据和指标		报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润		389,042,798.39
期末可供分配基金份额利润		0.1784
期末基金资产净值		3,483,599,729.46
期末基金份额净值		1.5982
3.1.3 累计期末指标		报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率		59.82%

注：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；

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；

对期末可供分配利润，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。

3.2 基金净值表现

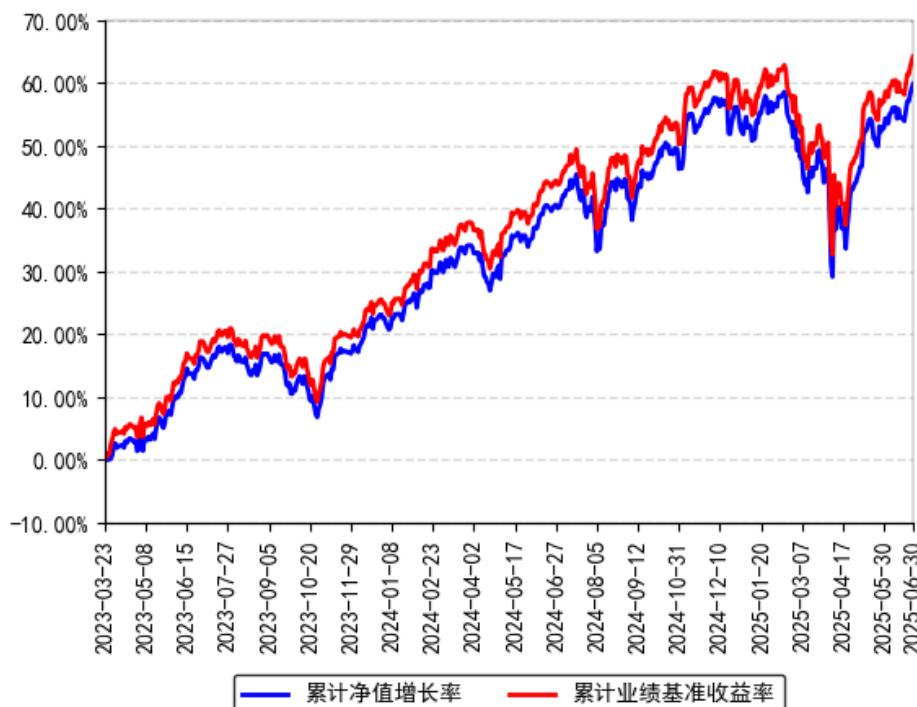
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个 月	4.61%	0.65%	4.58%	0.65%	0.03%	0.00%
过去三个 月	10.21%	1.94%	10.27%	1.94%	-0.06%	0.00%
过去六个 月	5.00%	1.56%	5.06%	1.56%	-0.06%	0.00%
过去一年	14.07%	1.27%	14.14%	1.27%	-0.07%	0.00%
自基金合	59.82%	1.00%	64.19%	1.00%	-4.37%	0.00%

同生效起至今						
--------	--	--	--	--	--	--

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



§ 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		
张其思	本基金基金经理	2025 年 3 月 7 日	-	11 年	波士顿大学数理金融硕士，特许金融分析师 (CFA)、金融风险管理师 (FRM)，具有基金从业资格。曾就职于美国 Charles River Development 、 Citizens Financial Group, 历任固定收益部分析员、资本管理部量化分析师。2017 年 4 月加入南方基金，历任数量化投资部研究员、指数投资部研究员、国际业务部研究员。2020 年 6 月 2 日至 2021 年 3 月 26 日，任南方原油基金经理助理；2021 年 3 月 26 日至今，任南方道琼斯美国精选 REIT 指数 (QDII-LOF) 、南方原油 (QDII-FOF-LOF) 基金经理；2022 年 11 月 29 日至今，任南方纳斯达克 100 指数发起 (QDII) 基金经理；2024 年 5 月 21 日至今，任南方恒生科技指数发起 (QDII) 基金经理；2025 年 3 月 7 日至今，任南方标普 500ETF (QDII) 基金经理；2025 年 4 月 11 日至今，任南方顶峰 TOPIX ETF (QDII) 、南方基金南方东英沙特阿拉伯 ETF (QDII) 、南方中证香港科技 ETF (QDII) 基金经理；2025 年 4 月 18 日至今，任南方基金南方东英富时亚太低碳精选 ETF (QDII) 、南方富时亚太低碳精选 ETF 发起联接 (QDII) 基金经理；2025 年 6 月 6 日至今，任南方港股数字经济混合发起 (QDII) 基金经理。
王鑫	本基金基金经理	2025 年 4 月 11 日	-	7 年	北京大学理学与经济学学士，美国约翰霍普金斯大学金融学硕士，特许金融分析师 (CFA)，具有基金从业资格。2018 年 5 月加入南方基金，先后任职于战略与产品开发部、产品开发部；2022 年 6 月加入国际业务部，任研究员；2024 年 5 月 31 日至 2025 年 4 月 11 日，任南方亚洲美元收益债券 (QDII) 基金经理助理；2025 年 4 月 11 日至今，任南方标普 500ETF (QDII) 、南方顶峰 TOPIX ETF (QDII) 、南方中证香港科技 ETF (QDII) 基金经理；2025 年 4 月 18 日至今，任南方基金南方东英富时亚太低碳精选 ETF (QDII) 、南方富时亚太低碳精选 ETF

					发起联接（QDII）基金经理。
杜冠豪	本基金 基金经理助理	2023 年 10 月 23 日	-	5 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，任南方恒生指数 ETF、南方标普 500ETF、南方中证创新药产业 ETF 基金经理助理。
李佳亮	本基金 基金经理（已 离任）	2023 年 3 月 23 日	2025 年 6 月 6 日	12 年	美国南加州大学金融工程硕士，具有基金从业资格。2012 年 8 月加入南方基金，任数量化投资部研究员；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 2024 年 5 月 31 日，任南方绝对收益基金经理；2023 年 3 月 23 日至 2025 年 6 月 6 日，任南方标普 500ETF（QDII）基金经理；2022 年 12 月 16 日至 2025 年 6 月 6 日，任南方基金南方东英富时亚太低碳精选 ETF（QDII）基金经理；2024 年 5 月 21 日至 2025 年 6 月 6 日，任南方富时亚太低碳精选 ETF 发起联接（QDII）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 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 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;2024 年 2 月 28 日至今,任南方中证国新央企科技引领 ETF 联接基金经理;2024 年 3 月 19 日至今,任南方中证光伏产业指数发起基金经理;2024 年 3 月 29 日至今,任南方中证半导体产业指数发起基金经理;2024 年 4 月 15 日至今,任南方上证科创板芯片 ETF 基金经理;2024 年 5 月 14 日至今,任南方中证通信服务 ETF 发起联接基金经理;2024 年 7 月 8 日至今,任南方上证科创板芯片 ETF 发起联接基金经理。
--	--	--	--	---

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》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

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遵规守信情况的说明

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执行交易公平执行，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，并且交易占优比也没有明显异常，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 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 96 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

本基金的投资目标是通过指数化投资策略，力争获得与业绩比较基准相似的回报。在基金的管理中我们采用了全复制法跟踪标的指数，基金投资组合中的证券以贴近指数成分股的配比进行配置。

2025 年上半年，本基金净值良好保持了对业绩基准的跟踪。未来，本基金投资团队将密切关注市场变化趋势，谨慎勤勉、恪尽职守，力争实现对标的指数的继续有效跟踪。

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 1.5982 元，报告期内，份额净值增长率为 5.00%，同期业绩基准增长率为 5.06%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年上半年，美股的交易主线是一季度的衰退交易和二季度对一季度的纠偏。一季度，美国市场出现了典型的衰退交易：美债利率、美股同时下行，利率曲线走平、短端倒挂加深，年内降息次数预期提升至 3 次以上。导致这种衰退交易的原因是市场对于特朗普上任后的一系列政策产生了新的叙事，从利好美国经济转为增加衰退风险。衰退交易的触发点是亚特兰大联储非官方的 GDP 预测模型在 3 月初 ISM 制造业 PMI 公布后大幅下调了美国一季度的实际 GDP 预期。结合时政新闻，市场普遍解读为亚特兰大联储模型计价了特朗普向全球增加关税对美国经济的负面影响提升了美国陷入衰退的风险。二季度，美股的交易主线是衰退交易的纠偏，市场认识到较为严肃的经济调查并未出现过于悲观的情绪，如美国咨商会消费者信心指数或密西根大学消费者信心指数均处于不弱的水平；制造业和服务业 PMI 水平也强于过往两年中枢水平。从美联储重点关注的就业方面看，当前失业率并未大幅上升，新增就业数据非常稳健，失业金申请人数也保持低位，反映出美国经济活力没有出现恶化迹象。市场情绪从一季度的悲观情绪中走出，重新定价美国经济的软着陆。

短期来看，市场依然有很多不确定性需要回答，短期波动性或将进一步加大。当前美国核心经济硬指标依然稳健，依然没有开始体现关税影响。近期 CPI 通胀数据超预期回落，尤其是核心服务 CPI 中枢的显著下行提高了关税冲击是暂时而非永久的可能性。非农就业数据再次好于市场预期，但周度的领取失业金人数数据中枢从 4 月底已经开始在波折中上升，劳

动力市场接下来或逐渐走弱。工业生产和零售销售数据均走弱且不及预期，或与此前受关税担忧而前置经济活动回落有关，而并不是由于关税的负面影响。在关税影响开始显现之后，实体经济数据可能进一步走弱，但美联储充裕的货币政策空间可以充分保障美国经济的平稳运行，并不至于导致经济衰退。

展望未来，我们仍处于美国较长降息周期的早期，美国经济整体依然稳健，美股处于一个具有良好支撑的宏观环境中。历史上，美股的熊市基本都伴随着美联储快速加息或者全球性经济危机，目前这两种情形发生的概率都很低，因此方向上我们预计美股会在放大的波动中继续上行。

4.7 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，组成人员包括财务负责人、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、国际业务部总经理、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。

4.8 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。

4.9 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。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.3.1	44,614,413.57	206,095,477.98
结算备付金		35,286,396.94	171,327,035.45
存出保证金		7,629,526.21	28,445,821.47
交易性金融资产	6.4.3.2	3,402,031,917.76	3,507,448,592.76
其中：股票投资		3,402,031,917.76	3,507,448,592.76
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	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	60,844.15
应收股利		1,514,155.83	1,754,233.12
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.5	-	-
资产总计		3,491,076,410.31	3,915,132,004.93
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3,054,999.94	15,200,716.23
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,672,096.14	1,794,013.04
应付托管费		418,024.03	448,503.27
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	397,952.65
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.6	2,331,560.74	13,192,140.52
负债合计		7,476,680.85	31,033,325.71
净资产：			
实收基金	6.4.3.7	2,179,734,000.00	2,551,734,000.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.8	1,303,865,729.46	1,332,364,679.22
净资产合计		3,483,599,729.46	3,884,098,679.22
负债和净资产总计		3,491,076,410.31	3,915,132,004.93

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.5982 元，基金份额总额 2,179,734,000.00 份。

6.2 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		147,710,211.79	90,263,815.96
1.利息收入		448,661.48	52,965.11
其中：存款利息收入	6.4.3.9	448,661.48	52,965.11
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		-1,993,706.35	30,875,963.44
其中：股票投资收益	6.4.3.10	1,537,563.01	18,751,855.58
基金投资收益	6.4.3.11	-	-
债券投资收益	6.4.3.12	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.3.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	-24,024,021.27	7,788,845.21
股利收益	6.4.3.15	20,492,751.91	4,335,262.65
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.3.16	152,837,373.66	61,431,926.93
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-2,183,224.77	-10,029,672.48
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.3.17	-1,398,892.23	7,932,632.96
减：二、营业总支出		13,925,889.85	2,888,624.91
1.管理人报酬	6.4.6.2.1	11,039,933.72	2,213,338.92
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.6.2.2	2,759,983.41	553,334.76
3.销售服务费	6.4.6.2.3	-	-
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.税金及附加		-	28,060.72
8.其他费用	6.4.3.18	125,972.72	93,890.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		133,784,321.94	87,375,191.05
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		133,784,321.94	87,375,191.05
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		133,784,321.94	87,375,191.05

6.3 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,551,734,000.00	-	1,332,364,679.22	3,884,098,679.22
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,551,734,000.00	-	1,332,364,679.22	3,884,098,679.22
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-372,000,000.00	-	-28,498,949.76	-400,498,949.76
(一)、综合收益总额	-	-	133,784,321.94	133,784,321.94
(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）	-372,000,000.00	-	-162,283,271.70	-534,283,271.70
其中：1.基金申购款	108,000,000.00	-	56,131,327.04	164,131,327.04

2.基金赎回款	-480,000,000.00	-	-218,414,598.74	-698,414,598.74
(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	2,179,734,000.00	-	1,303,865,729.46	3,483,599,729.46
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	207,734,000.00	-	46,725,925.02	254,459,925.02
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	207,734,000.00	-	46,725,925.02	254,459,925.02
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	597,000,000.00	-	276,068,846.99	873,068,846.99
(一)、综合收益总额	-	-	87,375,191.05	87,375,191.05
(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)	597,000,000.00	-	188,693,655.94	785,693,655.94
其中：1.基金申购款	870,000,000.00	-	273,467,759.18	1,143,467,759.18
2.基金赎回款	-273,000,000.00	-	-84,774,103.24	-357,774,103.24
(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	804,734,000.00	-	322,794,772.01	1,127,528,772.01

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

____杨小松____ 蔡忠评 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

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

6.4.2.3 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。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	44,614,413.57
等于： 本金	44,613,529.41
加： 应计利息	884.16
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	44,614,413.57

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	3,057,609,302.70	-	3,402,031,917.76	344,422,615.06
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	3,057,609,302.70	-	3,402,031,917.76	344,422,615.06

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

6.4.3.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	77,936,345.91	-	-	-
-股指期货	77,936,345.91	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	77,936,345.91	-	-	-

6.4.3.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
ES2509	ES2509	36.00	80,802,953.59	2,866,607.68
合计				2,866,607.68
减： 可抵销期货暂收款				2,866,607.68
净额				0.00

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利率/货币/权益/其他衍生工具为国债/外汇/股指/商品期货投资，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国债/外汇/股指/商品期货投资合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的国债/外汇/股指/商品期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.3.5 其他资产

无。

6.4.3.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 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	2,232,381.79
预提费用	99,178.95
应付指数使用费	-
可退替代款	-
合计	2,331,560.74

6.4.3.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	2,551,734,000.00	2,551,734,000.00
本期申购	108,000,000.00	108,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-480,000,000.00	-480,000,000.00
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	2,179,734,000.00	2,179,734,000.00

注：本基金申购含红利再投份额（如有）、转换入份额（如有）；赎回含转出份额（如有）。

6.4.3.8 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
上年度末	470,219,981.03	862,144,698.19	1,332,364,679.22
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	470,219,981.03	862,144,698.19	1,332,364,679.22
本期利润	-19,053,051.72	152,837,373.66	133,784,321.94
本期基金份额交易产生的变动数	-62,124,130.92	-100,159,140.78	-162,283,271.70
其中：基金申购款	19,345,639.76	36,785,687.28	56,131,327.04
基金赎回款	-81,469,770.68	-136,944,828.06	-218,414,598.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	389,042,798.39	914,822,931.07	1,303,865,729.46

6.4.3.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	334,656.22
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	114,005.26
其他	-
合计	448,661.48

6.4.3.10 股票投资收益

6.4.3.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,537,563.01
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	1,537,563.01

6.4.3.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	440,601,893.11
减：卖出股票成本总额	438,991,841.53
减：交易费用	72,488.57
买卖股票差价收入	1,537,563.01

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

6.4.3.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	698,414,598.74
减：现金支付赎回款总额	698,414,598.74
减：赎回股票成本总额	-
减：交易费用	-
赎回差价收入	-

6.4.3.11 基金投资收益

无。

6.4.3.12 债券投资收益

6.4.3.12.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.3.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.3.13 资产支持证券投资收益

6.4.3.13.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.3.14 衍生工具收益

6.4.3.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.3.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股指期货-投资收益	-24,024,021.27

6.4.3.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	20,492,751.91
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	20,492,751.91

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	138,963,582.39
——股票投资	138,963,582.39
——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	13,873,791.27
——权证投资	-
——期货投资	13,873,791.27
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	152,837,373.66

6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	-1,398,892.23
合计	-1,398,892.23

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。

6.4.3.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	6,927.79

付现费用		19,865.98
合计		125,972.72

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

财政部、税务总局于 2025 年 7 月 31 日发布《财政部 税务总局关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》（财政部 税务总局公告 2025 年第 4 号），规定自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

6.4.5 关联方关系

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

无。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
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
兴业证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构

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。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

无。

6.4.6.1.2 债券交易

无。

6.4.6.1.3 债券回购交易

无。

6.4.6.1.4 基金交易

无。

6.4.6.1.5 权证交易

无。

6.4.6.1.6 应支付关联方的佣金

无。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	11,039,933.72	2,213,338.92
其中：应支付销售机构的客户维护费	800,267.13	103,069.54
应支付基金管理人的净管理费	10,239,666.59	2,110,269.38

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。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,759,983.41	553,334.76

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 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。

6.4.6.2.3 销售服务费

无。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期内申购/买入总份额	-	7,608,200.00
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	7,608,200.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.95%

注：基金管理人南方基金投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.6.5.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
兴业证券股份有限公司	12,100.00	0.00%	1,848,000.00	0.07%

注：本基金其他关联方投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.6.6 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	12,967,246.64	333,972.52	56,641,470.45	47,657.81
美国花旗银行	31,647,166.93	683.70	86,235,734.59	5,307.30

注：本基金的银行存款由基金托管人和境外资产托管人保管，按银行约定利率计息。

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

6.4.7.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

无。

6.4.8 期末（2025 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式指数基金，紧密跟踪标普 500 指数。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内。

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 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。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

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，降低股票仓位频繁调整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，本基金的卖出回购金融资产款(若有)计息且利息金额不重大；除此之外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，该部分账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.4 市场风险

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

6.4.9.4.1 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。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	44,614,413.5 7	-	-	-	44,614,413.5 7
结算备付金	35,286,396.9 4	-	-	-	35,286,396.9 4
存出保证金	-	-	-	7,629,526.21	7,629,526.21
交易性金融 资产	-	-	-	3,402,031,91 7.76	3,402,031,91 7.76
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	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	1,514,155.83	1,514,155.83
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税 资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	79,900,810.5 1	-	-	3,411,175.59 9.80	3,491,076,41 0.31
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	-	-	-	3,054,999.94	3,054,999.94
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,672,096.14	1,672,096.14
应付托管费	-	-	-	418,024.03	418,024.03
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	-	-	-	2,331,560.74	2,331,560.74
负债总计	-	-	-	7,476,680.85	7,476,680.85
利率敏感度缺口	79,900,810.5 1	-	-	3,403,698,91 8.95	3,483,599,72 9.46
上年度末 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	206,095,477. 98	-	-	-	206,095,477. 98
结算备付金	171,327,035. 45	-	-	-	171,327,035. 45
存出保证金	-	-	-	28,445,821.4 7	28,445,821.4 7
交易性金融资产	-	-	-	3,507,448,59 2.76	3,507,448,59 2.76
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	-	-	-	60,844.15	60,844.15

应收股利	-	-	-	1,754,233.12	1,754,233.12
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	377,422,513. 43	-	-	3,537,709,49 1.50	3,915,132,00 4.93
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	-	-	-	15,200,716.2 3	15,200,716.2 3
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,794,013.04	1,794,013.04
应付托管费	-	-	-	448,503.27	448,503.27
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	397,952.65	397,952.65
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	13,192,140.5 2	13,192,140.5 2
负债总计	-	-	-	31,033,325.7 1	31,033,325.7 1
利率敏感度缺口	377,422,513. 43	-	-	3,506,676,16 5.79	3,884,098,67 9.22

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

6.4.9.4.1.2 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（2025年6月）	上年度末（2024年12月）

		30 日)	月 31 日)
1. 市场利率平行上升 25 个基点		0.00	0.00
2. 市场利率平行下降 25 个基点		0.00	0.00

6.4.9.4.2 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。

6.4.9.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日					
	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	合计
以外币计 价的资产						
货币资金	31,647,225.17	-	-	-	-	31,647,225.17
结算备付 金	35,136,963.13	-	-	-	-	35,136,963.13
存出保证 金	7,629,526.21	-	-	-	-	7,629,526.21
交易性金 融资产	3,402,031,917. 76	-	-	-	-	3,402,031,917. 76
应收股利	1,514,155.83	-	-	-	-	1,514,155.83
资产合计	3,477,959,788. 10	-	-	-	-	3,477,959,788. 10
以外币计 价的负债						
应付清算 款	3,050,446.62	-	-	-	-	3,050,446.62
负债合计	3,050,446.62	-	-	-	-	3,050,446.62
资产负债 表外汇风 险敞口净 额	3,474,909,341. 48	-	-	-	-	3,474,909,341. 48

项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日					
	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	合计
以外币计 价的资产						
货币资金	23,214,474.79	-	-	-	-	23,214,474.79
结算备付	21,081,697.43	-	-	-	-	21,081,697.43

金						
存出保证金	28,445,821.47	-	-	-	-	28,445,821.47
交易性金融资产	3,507,448,592. 76	-	-	-	-	3,507,448,592. 76
应收股利	1,754,233.12	-	-	-	-	1,754,233.12
资产合计	3,581,944,819. 57	-	-	-	-	3,581,944,819. 57
以外币计价的负债						
应付清算款	15,200,716.23	-	-	-	-	15,200,716.23
负债合计	15,200,716.23	-	-	-	-	15,200,716.23
资产负债表外汇风险敞口净额	3,566,744,103. 34	-	-	-	-	3,566,744,103. 34

6.4.9.4.2.2 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(2025 年 6 月 30 日)	上年度末(2024 年 12 月 31 日)
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	173,745,467.07	178,337,205.17
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-173,745,467.07	-178,337,205.17

6.4.9.4.3 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，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。

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。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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	3,402,031,917.76	97.66	3,507,448,592.76	90.30
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	3,402,031,917.76	97.66	3,507,448,592.76	90.30

6.4.9.4.3.2 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（2025年6月30日）	上年度末（2024年12月31日）
	1.组合自身基准上升 5%	166,149,501.47	185,613,055.18
	2.组合自身基准下降 5%	-166,149,501.47	-185,613,055.18

6.4.10 公允价值

6.4.10.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.10.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.10.2.1 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 2025 年 6 月 30 日
第一层次	3,402,031,917.76
第二层次	-
第三层次	-
合计	3,402,031,917.76

6.4.10.2.2 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。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 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。

6.4.11 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。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,402,031,917.76	97.45
	其中：普通股	3,337,293,362.00	95.59
	存托凭证	-	-
	房地产信托凭证	64,738,555.76	1.85
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	79,900,810.51	2.29
8	其他各项资产	9,143,682.04	0.26
9	合计	3,491,076,410.31	100.00

7.2 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	3,402,031,917.76	97.66
合计	3,402,031,917.76	97.66

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
能源	102,672,415.34	2.95
材料	63,932,917.77	1.84
工业	279,868,077.05	8.03
非必需消费品	335,012,622.36	9.62
必需消费品	187,259,750.28	5.38
医疗保健	316,936,338.81	9.10
金融	487,075,053.17	13.98
科技	1,108,912,370.03	31.83
通讯	369,350,701.25	10.60
公用事业	81,409,519.00	2.34
房地产	69,602,152.70	2.00
政府	-	-
合计	3,402,031,917.76	97.66

本基金对以上行业分类采用彭博行业分类标准。

7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

无。

7.4 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

7.4.1 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

7.4.1.1 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	NVIDI A Corp	英伟达	NVDA UW	纳斯达克证券交易所	美国	220,726	249,638 ,283.80	7.17
2	Microso ft Corp	微软	MSFT UW	纳斯达克证券交易所	美国	67,270	239,532 ,273.13	6.88
3	Apple Inc	苹果公司	AAPL UW	纳斯达克证券交易所	美国	135,181	198,544 ,384.99	5.70
4	Amazon .com Inc	亚马逊公司	AMZN UW	纳斯达克证券交易所	美国	85,517	134,306 ,608.15	3.86
5	Alphabe t Inc	Alphabe t 公司	GOOG UW	纳斯达克证券交易所	美国	42,491	53,957, 793.52	1.55
			GOOG L UW	纳斯达克证券交易所	美国	52,675	66,452, 677.11	1.91
6	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	19,651	103,829 ,813.30	2.98
7	Broadco m Inc	博通股份有限公司	AVGO UW	纳斯达克证券交易所	美国	42,556	83,974, 396.84	2.41
8	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	16,597	57,714, 957.53	1.66
9	Tesla Inc	特斯拉公司	TSLA UW	纳斯达克证券交易所	美国	25,362	57,673, 210.22	1.66
10	JPMorg an Chase & Co	摩根大通	JPM UN	纽约证券交易所	美国	25,153	52,201, 271.66	1.50
11	Eli Lilly & Co	礼来	LLY UN	纽约证券交易所	美国	7,120	39,732, 045.42	1.14
12	Visa Inc	维萨公司	V UN	纽约证券交易所	美国	15,486	39,360, 161.16	1.13
13	Netflix	奈飞公	NFLX	纳斯达	美国	3,852	36,926,	1.06

	Inc	司	UW	克证券 交易所			412.26	
14	Exxon Mobil Corp	埃克森 美孚石 油公司	XOM UN	纽约证 券交易 所	美国	39,009	30,103, 131.39	0.86
15	Masterc ard Inc	万事达 股份有 限公司	MA UN	纽约证 券交易 所	美国	7,341	29,530, 667.74	0.85
16	Costco Wholes ale Corp	开市客	COST UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,016	28,459, 723.29	0.82
17	Walmar t Inc	沃尔玛 股份有 限公司	WMT UN	纽约证 券交易 所	美国	39,104	27,371, 545.07	0.79
18	Procter & Gamble Co/The	宝洁	PG UN	纽约证 券交易 所	美国	21,220	24,201, 582.99	0.69
19	Johnson & Johnson	强生	JNJ UN	纽约证 券交易 所	美国	21,777	23,812, 630.12	0.68
20	Home Depot Inc/The	家得宝	HD UN	纽约证 券交易 所	美国	8,996	23,611, 163.42	0.68
21	Oracle Corp	甲骨文	ORCL UN	纽约证 券交易 所	美国	14,721	23,039, 612.13	0.66
22	AbbVie Inc	艾伯维 股份有 限公司	ABBV UN	纽约证 券交易 所	美国	15,987	21,243, 195.18	0.61
23	Bank of America Corp	美国银 行公司	BAC UN	纽约证 券交易 所	美国	59,307	20,089, 946.87	0.58
24	Palantir Technolo gies Inc	Palantir 科技股份 有限公司	PLTR UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	19,252	18,787, 263.50	0.54
25	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	14,088	18,367, 875.48	0.53
26	UnitedH ealth Group	联合健 康集团	UNH UN	纽约证 券交易 所	美国	8,210	18,335, 133.91	0.53

	Inc							
27	Cisco Systems Inc	思科	CSCO UW	纳斯达克证券交易所	美国	36,007	17,883,368.69	0.51
28	General Electric Co	通用电气航空航天	GE UN	纽约证券交易所	美国	9,652	17,784,312.43	0.51
29	Coca-Cola Co/The	可口可乐	KO UN	纽约证券交易所	美国	35,059	17,756,365.04	0.51
30	International Business Machines Corp	国际商业机器公司	IBM UN	纽约证券交易所	美国	8,412	17,751,104.25	0.51
31	Salesforce 股份有限公司	Salesforce Inc	CRM UN	纽约证券交易所	美国	8,684	16,951,850.86	0.49
32	Wells Fargo & Co	富国银行	WFC UN	纽约证券交易所	美国	29,453	16,892,680.73	0.48
33	Abbott Laboratories	雅培制药	ABT UN	纽约证券交易所	美国	15,747	15,331,927.76	0.44
34	Chevron Corp	雪佛龙	CVX UN	纽约证券交易所	美国	14,700	15,068,087.03	0.43
35	Advanced Micro Devices Inc	AMD 公司	AMD UW	纳斯达克证券交易所	美国	14,675	14,906,943.36	0.43
36	Walt Disney Co/The	华特迪士尼公司	DIS UN	纽约证券交易所	美国	16,271	14,444,384.77	0.41
37	Linde PLC	Linde PLC	LIN UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,260	14,307,942.50	0.41
38	Intuit Inc	Intuit 股份有限公司	INTU UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,530	14,264,970.14	0.41
39	Goldma	高盛	GS UN	纽约证	美国	2,777	14,069,	0.40

	n Sachs Group Inc/The			券交易 所			668.14	
40	Service Now Inc	Service Now 公司	NOW UN	纽约证 券交易 所	美国	1,874	13,791, 915.68	0.40
41	McDonald's Corp	麦当劳	MCD UN	纽约证 券交易 所	美国	6,472	13,536, 370.26	0.39
42	AT&T Inc	美国电 话电报 公司	T UN	纽约证 券交易 所	美国	65,126	13,492, 145.87	0.39
43	Merck & Co Inc	默克	MRK UN	纽约证 券交易 所	美国	22,727	12,878, 817.63	0.37
44	Uber Technologies Inc	优步技 术股份 有限公 司	UBER UN	纽约证 券交易 所	美国	18,927	12,641, 293.71	0.36
45	RTX Corp	RTX 公 司	RTX UN	纽约证 券交易 所	美国	12,091	12,638, 707.45	0.36
46	Intuitive Surgical Inc	直觉外 科手术 公司	ISRG UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,244	12,619, 337.86	0.36
47	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	295	12,225, 641.77	0.35
48	Texas Instruments Inc	德州仪 器	TXN UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	8,222	12,220, 099.87	0.35
49	Accenture PLC	埃森哲 公司	ACN UN	纽约证 券交易 所	美国	5,666	12,123, 165.98	0.35
50	Caterpillar Inc	卡特彼 勒	CAT UN	纽约证 券交易 所	美国	4,257	11,830, 373.73	0.34
51	Verizon Communications Inc	Verizon 通信股 份有限 公司	VZ UN	纽约证 券交易 所	美国	38,158	11,819, 540.55	0.34
52	PepsiCo Inc	百事可 乐	PEP UW	纳斯达 克证券	美国	12,409	11,729, 254.14	0.34

				交易所				
53	American Express Co	美国运通	AXP UN	纽约证券交易所	美国	5,009	11,437,802.19	0.33
54	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM UW	纳斯达克证券交易所	美国	9,930	11,320,980.86	0.32
55	Morgan Stanley	摩根士丹利	MS UN	纽约证券交易所	美国	11,181	11,274,477.59	0.32
56	S&P Global Inc	标普全球	SPGI UN	纽约证券交易所	美国	2,841	10,723,803.93	0.31
57	Adobe Inc	奥多比	ADBE UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,857	10,682,035.43	0.31
58	Citigroup Inc	花旗集团	C UN	纽约证券交易所	美国	16,904	10,300,283.90	0.30
59	Boston Scientific Corp	波士顿科学	BSX UN	纽约证券交易所	美国	13,390	10,295,640.98	0.30
60	Boeing Co/The	波音	BA UN	纽约证券交易所	美国	6,824	10,235,600.51	0.29
61	Progressive Corp/The	前进保险公司	PGR UN	纽约证券交易所	美国	5,306	10,136,285.24	0.29
62	Charles Schwab Corp/The	嘉信理财	SCHW UN	纽约证券交易所	美国	15,458	10,096,402.96	0.29
63	Thermo Fisher Scientific Inc	Thermo Fisher Scientific 公司	TMO UN	纽约证券交易所	美国	3,417	9,917,931.19	0.28
64	Blackrock Inc	贝莱德股份有限公司	BLK UN	纽约证券交易所	美国	1,318	9,899,710.26	0.28
65	Amgen Inc	安进公司	AMGN UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,867	9,727,929.42	0.28

66	Honeywell International Inc	霍尼韦尔	HON UW	纳斯达克证券交易所	美国	5,817	9,697,490.27	0.28
67	Applied Materials Inc	应用材料	AMAT UW	纳斯达克证券交易所	美国	7,353	9,636,289.60	0.28
68	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	2,470	9,356,293.78	0.27
69	NextEra Energy Inc	新纪元能源公司	NEE UN	纽约证券交易所	美国	18,632	9,259,172.62	0.27
70	Eaton Corp PLC	伊顿公共有限公司	ETN UN	纽约证券交易所	美国	3,542	9,051,753.19	0.26
71	Gilead Sciences Inc	吉利德科学	GILD UW	纳斯达克证券交易所	美国	11,258	8,935,181.69	0.26
72	TJX Cos Inc/The	TJX 公司	TJX UN	纽约证券交易所	美国	10,105	8,932,976.77	0.26
73	Pfizer Inc	辉瑞制药	PFE UN	纽约证券交易所	美国	51,457	8,929,048.34	0.26
74	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	10,115	8,924,438.71	0.26
75	Union Pacific Corp	联合太平洋	UNP UN	纽约证券交易所	美国	5,408	8,907,250.12	0.26
76	Stryker Corp	史赛克	SYK UN	纽约证券交易所	美国	3,120	8,836,329.58	0.25
77	Capital One Financial Corp	第一资本金融	COF UN	纽约证券交易所	美国	5,789	8,817,015.97	0.25
78	Palo Alto Network	Palo Alto Network	PANW UW	纳斯达克证券交易所	美国	5,993	8,779,360.87	0.25

	ks Inc	ks 股份有限公司						
79	Comcast Corp	康卡斯特公司	CMCS A UW	纳斯达克证券交易所	美国	33,707	8,611,8 16.06	0.25
80	Deere & Co	迪尔	DE UN	纽约证券交易所	美国	2,292	8,343,0 55.37	0.24
81	Crowdstrike Holdings Inc	Crowdstrike 控股股份有限公司	CRWD UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,254	8,217,9 63.56	0.24
82	Danaher Corp	丹纳赫	DHR UN	纽约证券交易所	美国	5,765	8,152,3 43.25	0.23
83	Automatic Data Processing Inc	Automatic Data Processing 股份有限公司	ADP UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,674	8,111,1 34.77	0.23
84	Lam Research Corp	泛林集团	LRCX UW	纳斯达克证券交易所	美国	11,577	8,067,0 63.42	0.23
85	Lowe's Cos Inc	劳氏	LOW UN	纽约证券交易所	美国	5,066	8,046,2 19.30	0.23
86	Amphenol Corp	安费诺公司	APH UN	纽约证券交易所	美国	10,948	7,739,2 69.84	0.22
87	KLA Corp	KLA 公司	KLAC UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,197	7,675,4 56.50	0.22
88	Analog Devices Inc	亚德诺半导体	ADI UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,489	7,648,7 62.08	0.22
89	Vertex Pharmaceuticals Inc	福泰制药	VRTX UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,324	7,406,6 08.27	0.21
90	T-Mobile US	T-Mobile US 股	TMUS UW	纳斯达克证券	美国	4,316	7,361,4 04.28	0.21

	Inc	份有限公司		交易所				
91	Conoco Phillips	康菲石油	COP UN	纽约证券交易所	美国	11,426	7,340,208.24	0.21
92	Medtronic PLC	美敦力	MDT UN	纽约证券交易所	美国	11,608	7,243,568.00	0.21
93	Blackstone Inc	黑石集团股份有限公司	BX UN	纽约证券交易所	美国	6,604	7,071,453.49	0.20
94	Chubb Ltd	邱博保险集团	CB UN	纽约证券交易所	美国	3,373	6,995,566.89	0.20
95	Marsh & McLennan Cos Inc	Marsh & McLennan 股份有限公司	MMC UN	纽约证券交易所	美国	4,460	6,980,597.12	0.20
96	Arista Networks Inc	Arista 网络股份有限公司	ANET UN	纽约证券交易所	美国	9,321	6,826,666.53	0.20
97	Intercontinental Exchange Inc	洲际交易所 (ICE)	ICE UN	纽约证券交易所	美国	5,192	6,819,112.27	0.20
98	Starbucks Corp	星巴克	SBUX UW	纳斯达克证券交易所	美国	10,285	6,746,368.80	0.19
99	American Tower Corp	美国发射塔公司	AMT UN	纽约证券交易所	美国	4,237	6,703,755.01	0.19
100	Constellation Energy Corp	美国联合能源公司	CEG UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,837	6,554,916.12	0.19
101	Southern Co/The	南方公司	SO UN	纽约证券交易所	美国	9,947	6,538,901.55	0.19
102	CME Group	芝加哥商业交	CME UW	纳斯达克证券	美国	3,261	6,434,126.92	0.18

	Inc	易所		交易所				
103	Altria Group Inc	高特利	MO UN	纽约证券交易所	美国	15,246	6,398,879.11	0.18
104	Intel Corp	英特尔	INTC UW	纳斯达克证券交易所	美国	39,479	6,330,561.87	0.18
105	Prologis Inc	安博	PLD UN	纽约证券交易所	美国	8,398	6,319,596.04	0.18
106	Trane Technologies PLC	特灵科技公共有限公司	TT UN	纽约证券交易所	美国	2,018	6,318,848.83	0.18
107	Lockheed Martin Corp	洛克希德马丁	LMT UN	纽约证券交易所	美国	1,887	6,256,223.97	0.18
108	Fiserv Inc	Fiserv 股份有限公司	FI UN	纽约证券交易所	美国	5,018	6,193,286.99	0.18
109	Welltower Inc	Welltower 股份有限公司	WELL UN	纽约证券交易所	美国	5,623	6,188,064.14	0.18
110	Bristol-Myers Squibb Co	百时美施贵宝公司	BMY UN	纽约证券交易所	美国	18,419	6,103,533.39	0.18
111	Duke Energy Corp	杜克能源	DUK UN	纽约证券交易所	美国	7,035	5,942,568.62	0.17
112	McKesson Corp	McKesson 公司	MCK UN	纽约证券交易所	美国	1,132	5,938,108.52	0.17
113	KKR & Co Inc	KKR & Co 股份有限公司	KKR UN	纽约证券交易所	美国	6,126	5,833,842.23	0.17
114	Parker-Hannifin Corp	派克汉尼汾公司	PH UN	纽约证券交易所	美国	1,156	5,780,077.85	0.17
115	Cigna Group/The	信诺集团	CI UN	纽约证券交易所	美国	2,418	5,722,172.79	0.16

116	Mondel ez International Inc	亿滋国际	MDLZ UW	纳斯达克证券交易所	美国	11,801	5,697,2 39.39	0.16
117	Elevance Health Inc	Elevance 健康股份有限公司	ELV UN	纽约证券交易所	美国	2,045	5,694,1 16.52	0.16
118	CVS Health Corp	CVS 健康公司	CVS UN	纽约证券交易所	美国	11,449	5,653,5 18.81	0.16
119	TransDigim Group Inc	TransDigim 集团公司	TDG UN	纽约证券交易所	美国	508	5,529,9 11.98	0.16
120	DoorDash Inc	DoorDash 股份有限公司	DASH UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,103	5,475,7 60.11	0.16
121	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	2,471	5,450,8 34.72	0.16
122	Waste Management Inc	废品管理	WM UN	纽约证券交易所	美国	3,314	5,428,4 34.24	0.16
123	NIKE Inc	耐克公司	NKE UN	纽约证券交易所	美国	10,663	5,422,6 36.06	0.16
124	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	2,318	5,311,9 54.37	0.15
125	3M Co	3M 公司	MMM UN	纽约证券交易所	美国	4,871	5,308,5 38.86	0.15
126	Synopsys Inc	新思科技公司	SNPS UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,399	5,134,4 29.40	0.15
127	Sherwin-Williams	宣伟公司	SHW UN	纽约证券交易所	美国	2,087	5,129,7 97.78	0.15

	Co/The							
128	Royal Caribbe an 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	2,261	5,068,3 57.09	0.15
129	Equinix Inc	Equinix 有限公司	EQIX UW	纳斯达克证券交易所	美国	885	5,039,5 89.61	0.14
130	Moody's Corp	穆迪	MCO UN	纽约证券交易所	美国	1,400	5,026,9 55.04	0.14
131	O'Reilly Automo tive Inc	O'Reilly 汽车股 份有限公司	ORLY UW	纳斯达克证券交易所	美国	7,737	4,991,9 48.13	0.14
132	Aon PLC	怡安公 共有限公司	AON UN	纽约证 券交易 所	美国	1,954	4,990,3 24.77	0.14
133	William s Cos Inc/The	威廉姆 斯公司	WMB UN	纽约证 券交易 所	美国	11,051	4,968,8 79.54	0.14
134	Cintas Corp	Cintas 公司	CTAS UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,106	4,955,4 27.89	0.14
135	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	12,195	4,901,8 45.98	0.14
136	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	3,654	4,868,7 00.02	0.14
137	Emerso n Electric Co	艾默生 电气	EMR UN	纽约证 券交易 所	美国	5,091	4,859,1 36.20	0.14
138	Coinbas e Global Inc	Coinbas e 全球 股份有 限公司	COIN UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,913	4,799,7 50.89	0.14
139	United	联合包	UPS	纽约证	美国	6,641	4,798,7	0.14

	Parcel Service Inc	裹服务股份有限公司	UN	券交易所			14.11	
140	PNC Financia 1 Services Group Inc/The	PNC 财务服务	PNC UN	纽约证劵交易所	美国	3,580	4,777,5 32.24	0.14
141	Colgate-Palmoli ve Co	高露洁棕榄	CL UN	纽约证劵交易所	美国	7,335	4,773,0 07.29	0.14
142	General Dynamics Corp	通用动力	GD UN	纽约证劵交易所	美国	2,280	4,760,3 60.19	0.14
143	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	8,802	4,682,9 02.99	0.13
144	US Bancorp	美国合众银行	USB UN	纽约证劵交易所	美国	14,257	4,618,2 22.25	0.13
145	Motorola Solutions Inc	摩托罗拉解决方案股份有限公司	MSI UN	纽约证劵交易所	美国	1,511	4,547,9 66.39	0.13
146	Johnson Controls International plc	江森自控国际有限公司	JCI UN	纽约证劵交易所	美国	5,956	4,503,2 79.97	0.13
147	Zoetis Inc	硕腾股份有限公司	ZTS UN	纽约证劵交易所	美国	4,029	4,497,9 09.81	0.13
148	Ecolab Inc	艺康集团	ECL UN	纽约证劵交易所	美国	2,284	4,405,4 09.31	0.13
149	Northrop Grumman Corp	诺斯洛普格鲁门公司	NOC UN	纽约证劵交易所	美国	1,224	4,380,8 87.96	0.13
150	Fortinet Inc	Fortinet 股份有限公司	FTNT UW	纳斯达克证券交易所	美国	5,750	4,351,6 41.35	0.12

151	HCA HealthCare Inc	HCA 医疗保健有限公司	HCA UN	纽约证券交易所	美国	1,568	4,300,176.75	0.12
152	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	2,428	4,297,472.23	0.12
153	Autodesk Inc	欧特克	ADSK UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,936	4,290,345.98	0.12
154	Vistra Corp	Vistra 公司	VST UN	纽约证券交易所	美国	3,071	4,260,730.78	0.12
155	EOG Resources Inc	EOG 资源	EOG UN	纽约证券交易所	美国	4,940	4,229,826.32	0.12
156	Bank of New York Mellon Corp/The	纽约梅隆银行	BK UN	纽约证券交易所	美国	6,475	4,223,124.80	0.12
157	Newmont Corp	纽蒙黄金公司	NEM UN	纽约证券交易所	美国	10,073	4,201,045.74	0.12
158	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	4,086	4,149,703.12	0.12
159	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	2,151	4,101,142.90	0.12
160	Air Products and Chemicals Inc	空气产品公司	APD UN	纽约证券交易所	美国	2,014	4,066,577.60	0.12
161	Freeport-McMoRan Inc	自由港迈克墨伦股份	FCX UN	纽约证券交易所	美国	12,999	4,033,918.70	0.12

		有限公司						
162	Marriott International Inc/MD	万豪国际	MAR UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,058	4,025,0 38.68	0.12
163	AutoZone Inc	AutoZone 股份有限公司	AZO UN	纽约证券交易所	美国	151	4,012,7 29.82	0.12
164	CSX Corp	CSX 公司	CSX UW	纳斯达克证券交易所	美国	17,002	3,971,4 14.18	0.11
165	Axon Enterprise Inc	Axon Enterprise 股份有限公司	AXON UW	纳斯达克证券交易所	美国	669	3,965,0 90.27	0.11
166	Roper Technologies Inc	儒博技术公司	ROP UW	纳斯达克证券交易所	美国	973	3,948,2 20.74	0.11
167	Travelers Cos Inc/The	旅行家集团	TRV UN	纽约证券交易所	美国	2,051	3,928,0 99.49	0.11
168	Carrier Global Corp	开利全球公司	CARR UN	纽约证券交易所	美国	7,216	3,780,7 36.13	0.11
169	Norfolk Southern Corp	诺福克南方	NSC UN	纽约证券交易所	美国	2,040	3,738,0 69.16	0.11
170	Airbnb Inc	爱彼迎股份有限公司	ABNB UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,906	3,700,4 23.80	0.11
171	Kinder Morgan Inc	特拉华州金德摩根公司	KMI UN	纽约证券交易所	美国	17,497	3,682,4 68.31	0.11
172	Truist Financial Corp	Truist 金融公司	TFC UN	纽约证券交易所	美国	11,852	3,647,4 31.83	0.10
173	Quanta Services Inc	Quanta 服务股份有限	PWR UN	纽约证券交易所	美国	1,341	3,629,4 48.00	0.10

		公司						
174	American Electric Power Co Inc	美国电力	AEP UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,835	3,591,323.58	0.10
175	NXP Semiconductors NV	恩智浦半导体公司	NXPI UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,286	3,575,492.63	0.10
176	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	2,865	3,575,401.78	0.10
177	Regeneration Pharmaceutical 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	940	3,532,769.10	0.10
178	Allstate Corp/The	好事达保险公司	ALL UN	纽约证券交易所	美国	2,397	3,454,311.35	0.10
179	Realty Income Corp	Realty Income 公司	O UN	纽约证券交易所	美国	8,174	3,371,014.38	0.10
180	Workday Inc	Workday 股份有限公司	WDAY UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,961	3,369,123.50	0.10
181	Cencora Inc	Cencora 股份有限公司	COR UN	纽约证券交易所	美国	1,561	3,350,696.19	0.10
182	Aflac Inc	家庭人寿保险	AFL UN	纽约证券交易所	美国	4,404	3,324,781.99	0.10
183	Marathon Petroleum Corp	马拉松石油公司	MPC UN	纽约证券交易所	美国	2,781	3,306,928.94	0.09
184	ONEOK Inc	Oneok 股份有限公司	OKE UN	纽约证券交易所	美国	5,653	3,303,367.40	0.09
185	Corteva Inc	科迪华公司	CTVA UN	纽约证券交易	美国	6,174	3,294,017.05	0.09

				所				
186	Ameriprise Financial Inc	阿默普莱斯金融公司	AMP UN	纽约证券交易所	美国	862	3,293,494.76	0.09
187	FedEx Corp	联邦快递	FDX UN	纽约证券交易所	美国	1,995	3,246,306.63	0.09
188	Repubлик Services Inc	公共服务公司	RSG UN	纽约证券交易所	美国	1,838	3,244,772.75	0.09
189	TE Connectivity PLC	TE Connectivity 公共有限公司	TEL UN	纽约证券交易所	美国	2,684	3,240,771.81	0.09
190	PACCAR Inc	帕卡	PCAR UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,751	3,233,038.95	0.09
191	Sempra	Sempra	SRE UN	纽约证券交易所	美国	5,903	3,201,829.24	0.09
192	Becton Dickinson & Co	碧迪	BDX UN	纽约证券交易所	美国	2,594	3,198,580.60	0.09
193	American International Group Inc	美国国际集团	AIG UN	纽约证券交易所	美国	5,216	3,195,867.06	0.09
194	Simon Property Group Inc	西蒙房地产集团公司	SPG UN	纽约证券交易所	美国	2,777	3,195,817.52	0.09
195	United Rentals Inc	联合租赁公司	URI UN	纽约证券交易所	美国	588	3,171,254.07	0.09
196	Phillips 66	菲利浦 66	PSX UN	纽约证券交易所	美国	3,688	3,149,629.37	0.09
197	Domination	Domination 能源	D UN	纽约证券交易	美国	7,718	3,122,734.23	0.09

	Energy Inc	股份有限公司		所				
198	Fastenal Co	法思诺公司	FAST UW	纳斯达克证券交易所	美国	10,383	3,121,7 65.24	0.09
199	General Motors Co	通用汽车公司	GM UN	纽约证券交易所	美国	8,702	3,065,4 94.49	0.09
200	L3Harris Technologies Inc	L3Harris Technologies 股份有限公司	LHX UN	纽约证券交易所	美国	1,692	3,038,2 62.18	0.09
201	Paychex Inc	Paychex 公司	PAYX UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,901	3,020,7 82.16	0.09
202	Public Storage	公共存储	PSA UN	纽约证券交易所	美国	1,429	3,001,5 80.79	0.09
203	Schlumberger NV	斯伦贝谢公众有限公司	SLB UN	纽约证券交易所	美国	12,310	2,978,5 35.97	0.09
204	Edwards Lifesciences Corp	爱德华生命科学公司	EW UN	纽约证券交易所	美国	5,309	2,972,3 71.63	0.09
205	WW Grainger Inc	固安捷股份有限公司	GWW UN	纽约证券交易所	美国	396	2,948,8 78.18	0.08
206	MetLife Inc	大都会集团	MET UN	纽约证券交易所	美国	5,104	2,938,3 45.30	0.08
207	Cummins Inc	康明斯	CMI UN	纽约证券交易所	美国	1,247	2,923,5 18.55	0.08
208	Keurig Dr Pepper Inc	Keurig Dr Pepper 有限公司	KDP UW	纳斯达克证券交易所	美国	12,293	2,909,3 02.14	0.08
209	Target	塔吉特	TGT	纽约证	美国	4,112	2,903,8	0.08

	Corp	公司	UN	券交易 所			77.50	
210	Crown Castle Inc	冠城股 份有限 公司	CCI UN	纽约证 券交易 所	美国	3,941	2,898,2 23.14	0.08
211	MSCI Inc	MSCI 明晟	MSCI UN	纽约证 券交易 所	美国	700	2,890,0 55.67	0.08
212	Fair Isaac Corp	费埃哲 公司	FICO UN	纽约证 券交易 所	美国	220	2,878,8 39.58	0.08
213	Monster Beverage Corp	怪兽饮 料公司	MNST UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	6,355	2,849,6 75.44	0.08
214	Kroger Co/The	克罗格 公司	KR UN	纽约证 券交易 所	美国	5,544	2,846,7 68.48	0.08
215	Exelon Corp	Exelon 公司	EXC UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	9,137	2,840,0 20.93	0.08
216	Verisk Analytics Inc	Verisk 分析公 司	VRSK UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,266	2,823,0 58.34	0.08
217	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	728	2,795,1 14.89	0.08
218	Copart Inc	Copart 股份有 限公司	CPRT UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	7,957	2,795,0 75.30	0.08
219	Kimberly-Clark Corp	金佰利	KMB UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,003	2,771,4 28.80	0.08
220	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	4,755	2,771,1 26.63	0.08
221	Ford Motor Co	福特汽 车	F UN	纽约证 券交易 所	美国	35,350	2,745,6 63.13	0.08
222	Valero Energy Corp	Valero 能源	VLO UN	纽约证 券交易 所	美国	2,835	2,728,0 04.30	0.08

223	Public Service Enterprise Group Inc	公共服务企业集团	PEG UN	纽约证券交易所	美国	4,516	2,721,391.04	0.08
224	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	2,976	2,717,963.50	0.08
225	AMETEK Inc	阿美特克股份有限公司	AME UN	纽约证券交易所	美国	2,090	2,707,428.34	0.08
226	Yum! Brands Inc	百胜餐饮集团	YUM UN	纽约证券交易所	美国	2,516	2,668,875.55	0.08
227	CBRE Group Inc	世邦魏理仕	CBRE UN	纽约证券交易所	美国	2,658	2,666,141.54	0.08
228	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	1,533	2,665,068.39	0.08
229	Corning Inc	康宁公司	GLW UN	纽约证券交易所	美国	6,977	2,626,636.59	0.08
230	Kenvue Inc	Kenvue Inc	KVUE UN	纽约证券交易所	美国	17,377	2,603,587.19	0.07
231	Cardinal Health Inc	嘉德诺健康集团	CAH UN	纽约证券交易所	美国	2,160	2,597,712.77	0.07
232	Xcel Energy Inc	Xcel 能源	XEL UW	纳斯达克证券交易所	美国	5,220	2,544,753.45	0.07
233	Otis Worldwide Corp	奥的斯电梯公司	OTIS UN	纽约证券交易所	美国	3,572	2,531,992.81	0.07
234	Charter Communication	Charter 通信公司	CHTR UW	纳斯达克证券交易所	美国	864	2,528,502.28	0.07

	s Inc							
235	Cognizant Technology Solutions Corp	高知特科技解决方案公司	CTSH UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,461	2,491,850.17	0.07
236	Hess Corp	赫斯公司	HES UN	纽约证券交易所	美国	2,509	2,488,306.88	0.07
237	Prudential Financial Inc	保德信金融集团	PRU UN	纽约证券交易所	美国	3,204	2,464,260.43	0.07
238	Baker Hughes Co	贝克休斯公司	BKR UW	纳斯达克证券交易所	美国	8,967	2,461,089.31	0.07
239	Microchip Technology Inc	微芯科技股份有限公司	MCHP UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,868	2,452,258.32	0.07
240	ResMed Inc	瑞思迈股份有限公司	RMD UN	纽约证券交易所	美国	1,327	2,450,861.25	0.07
241	Targa Resources Corp	Targa 资源公司	TRGP UN	纽约证券交易所	美国	1,963	2,446,229.92	0.07
242	Rockwell Automation Inc	罗克韦尔自动化	ROK UN	纽约证券交易所	美国	1,020	2,425,429.61	0.07
243	Entergy Corp	Entergy 公司	ETR UN	纽约证券交易所	美国	4,040	2,403,892.24	0.07
244	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	3,741	2,394,696.45	0.07
245	Dell Technologies Inc	戴尔科技公司	DELL UN	纽约证券交易所	美国	2,711	2,379,293.86	0.07
246	Sysco Corp	Sysco 公司	SYY UN	纽约证券交易	美国	4,387	2,378,597.90	0.07

				所				
247	Electron ic Arts Inc	电子艺 界	EA UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,065	2,360,7 66.69	0.07
248	Consoli dated Edison Inc	联合爱 迪生	ED UN	纽约证 券交易 所	美国	3,261	2,342,5 89.93	0.07
249	Hartford Insuranc e Group Inc/The	哈特福 德保险 集团股份 有限公司	HIG UN	纽约证 券交易 所	美国	2,571	2,335,0 11.98	0.07
250	Westing house Air Brake Technol ogies Corp	西屋制 动公司	WAB UN	纽约证 券交易 所	美国	1,549	2,321,4 13.36	0.07
251	DR Horton Inc	霍顿房 屋公司	DHI UN	纽约证 券交易 所	美国	2,502	2,309,0 62.55	0.07
252	Monolit hic Power Systems Inc	芯源系 统有限 公司	MPWR UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	434	2,272,2 75.08	0.07
253	EQT Corp	EQT 公 司	EQT UN	纽约证 券交易 所	美国	5,418	2,261,9 58.39	0.06
254	Vulcan Material s Co	Vulcan 材料	VMC UN	纽约证 券交易 所	美国	1,196	2,233,0 58.84	0.06
255	VICI Properti es Inc	VICI Properties 股份 有限公司	VICI UN	纽约证 券交易 所	美国	9,564	2,231,9 54.12	0.06
256	eBay Inc	eBay 股 份有限 公司	EBAY UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,172	2,223,7 98.47	0.06
257	Dexcom Inc	Dexcom 股份有	DXCM UW	纳斯达 克证券	美国	3,549	2,217,6 78.51	0.06

		限公司		交易所				
258	Arch Capital Group Ltd	阿契资本集团	ACGL UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,378	2,201,7 48.41	0.06
259	CoStar Group Inc	CoStar 集团股份有限公司	CSGP UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,818	2,197,4 55.40	0.06
260	GE HealthCare Technologies Inc	GE HealthCare Technologies Inc	GEHC UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,144	2,197,3 04.21	0.06
261	Agilent Technologies Inc	安捷伦	A UN	纽约证券交易所	美国	2,580	2,179,5 48.88	0.06
262	Ingersoll Rand Inc	英格索兰股份有限公司	IR UN	纽约证券交易所	美国	3,652	2,174,5 91.97	0.06
263	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	2,888	2,154,2 34.63	0.06
264	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	546	2,145,6 62.64	0.06
265	Equifax Inc	Equifax 股份有限公司	EFX UN	纽约证券交易所	美国	1,124	2,086,9 60.12	0.06
266	Garmin Ltd	佳明有限公司	GRMN UN	纽约证券交易所	美国	1,394	2,082,8 35.33	0.06
267	Delta Air Lines Inc	达美航空有限公司	DAL UN	纽约证券交易所	美国	5,910	2,080,6 74.29	0.06
268	Xylem Inc/NY	赛莱默公司	XYL UN	纽约证券交易	美国	2,203	2,040,0 58.40	0.06

				所				
269	NRG Energy Inc	NRG 能源股份有限公司	NRG UN	纽约证券交易所	美国	1,770	2,034,664.54	0.06
270	Extra Space Storage Inc	Extra Space Storage 有限公司	EXR UN	纽约证券交易所	美国	1,921	2,027,546.31	0.06
271	M&T Bank Corp	M&T 银行	MTB UN	纽约证券交易所	美国	1,453	2,017,776.47	0.06
272	Gartner Inc	Gartner 公司	IT UN	纽约证券交易所	美国	697	2,016,873.56	0.06
273	Brown & Brown Inc	Brown & Brown 股份有限公司	BRO UN	纽约证券交易所	美国	2,537	2,013,550.89	0.06
274	ANSYS Inc	ANSYS 股份有限公司	ANSS UW	纳斯达克证券交易所	美国	796	2,001,337.82	0.06
275	PG&E Corp	太平洋煤气电力	PCG UN	纽约证券交易所	美国	19,919	1,987,734.62	0.06
276	Seagate Technology Holdings PLC	Seagate Technology 控股公共有限公司	STX UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,921	1,984,778.62	0.06
277	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	900	1,974,699.81	0.06
278	State Street Corp	道富集团	STT UN	纽约证券交易所	美国	2,581	1,964,774.70	0.06
279	Iron Mountain Inc	美国铁山公司	IRM UN	纽约证券交易所	美国	2,670	1,960,467.80	0.06
280	Old	Old	ODFL	纳斯达	美国	1,683	1,955,3	0.06

	Domini on Freight Line Inc	Domini on Freight Line 股份有限公司	UW	克证券交易所			78.03	
281	Nucor Corp	纽柯公司	NUE UN	纽约证券交易所	美国	2,097	1,944,600.62	0.06
282	Occiden tal Petroleum Corp	西方石 油	OXY UN	纽约证 券交易 所	美国	6,413	1,928,599.36	0.06
283	Carnival Corp	嘉年华 公司	CCL UN	纽约证 券交易 所	美国	9,503	1,912,952.30	0.05
284	Humana Inc	Humana 股份有 限公司	HUM UN	纽约证 券交易 所	美国	1,092	1,911,146.90	0.05
285	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	1,298	1,890,894.08	0.05
286	Ventas Inc	Ventas 公司	VTR UN	纽约证 券交易 所	美国	4,116	1,860,701.97	0.05
287	DuPont de Nemours Inc	杜邦公 司	DD UN	纽约证 券交易 所	美国	3,788	1,859,939.72	0.05
288	Broadridge Financial Solution s 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	1,063	1,849,359.10	0.05
289	General Mills Inc	通用磨 坊	GIS UN	纽约证 券交易 所	美国	4,956	1,838,116.30	0.05
290	Keysight Technologies	是德科 技公司	KEYS UN	纽约证 券交易 所	美国	1,564	1,834,584.82	0.05

	Inc							
291	Tractor Supply Co	拖拉机供应公司	TSCO UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,799	1,812,866.99	0.05
292	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	1,643	1,803,873.49	0.05
293	Fifth Third Bancorp	五三银行	FITB UW	纳斯达克证券交易所	美国	6,096	1,794,864.90	0.05
294	DTE Energy Co	DTE 能源	DTE UN	纽约证券交易所	美国	1,878	1,780,772.48	0.05
295	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	1,765	1,757,644.97	0.05
296	Centene Corp	Centene 公司	CNC UN	纽约证券交易所	美国	4,504	1,750,113.91	0.05
297	Hewlett Packard Enterprise Co	慧与公司	HPE UN	纽约证券交易所	美国	11,889	1,740,470.78	0.05
298	Lululemon Athletica Inc	Lululemon Athletica 股份有限公司	LULU UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,000	1,700,740.19	0.05
299	United Airlines Holdings Inc	美国联合航空控股股份有限公司	UAL UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,956	1,685,036.22	0.05
300	Ameren Corp	Ameren 公司	AEE UN	纽约证券交易所	美国	2,446	1,681,654.22	0.05
301	IQVIA Holdings Inc	艾昆纬	IQV UN	纽约证券交易所	美国	1,487	1,677,520.05	0.05
302	PPG	PPG 工	PPG	纽约证	美国	2,055	1,673,3	0.05

	Industries Inc	业	UN	券交易所			67.49	
303	Warner Bros Discovery Inc	华纳兄弟探索股份有限公司	WBD UW	纳斯达克证券交易所	美国	20,377	1,671,679.28	0.05
304	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	1,692	1,664,237.05	0.05
305	Lennar Corp	Lennar 公司	LEN UN	纽约证券交易所	美国	2,101	1,663,598.58	0.05
306	GoDaddy Inc	GoDaddy 股份有限公司	GDDY UN	纽约证券交易所	美国	1,290	1,662,781.00	0.05
307	Tyler Technologies Inc	Tyler 科技公司	TYL UN	纽约证券交易所	美国	390	1,655,122.73	0.05
308	Darden Restaurants Inc	达登餐饮公司	DRI UN	纽约证券交易所	美国	1,059	1,652,421.28	0.05
309	Synchrony Financial	同步金融公司	SYF UN	纽约证券交易所	美国	3,445	1,645,900.30	0.05
310	Archer-Daniels-Midland Co	Archer-Daniels-Midland 公司	ADM UN	纽约证券交易所	美国	4,348	1,642,808.79	0.05
311	Expand Energy Corp	Expand 能源公司	EXE UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,960	1,640,768.30	0.05
312	SBA Communications Corp	SBA 通信公司	SBAC UW	纳斯达克证券交易所	美国	973	1,635,735.23	0.05
313	Dollar General Corp	达乐公司	DG UN	纽约证券交易所	美国	1,991	1,630,232.13	0.05
314	Super	Super	SMCI	纳斯达	美国	4,645	1,629,6	0.05

	Micro Computer Inc	Micro Computer 股份有限公司	UW	克证券交易所			65.67	
315	Dover Corp	都福	DOV UN	纽约证券交易所	美国	1,241	1,627,7 82.81	0.05
316	PPL Corp	PPL 公司	PPL UN	纽约证券交易所	美国	6,691	1,623,2 69.75	0.05
317	Veralto Corp	Veralto 公司	VLTO UN	纽约证券交易所	美国	2,246	1,623,0 95.86	0.05
318	Constellation Brands Inc	星座品牌股份有限公司	STZ UN	纽约证券交易所	美国	1,385	1,612,9 17.05	0.05
319	International Paper Co	国际纸业	IP UN	纽约证券交易所	美国	4,778	1,601,7 63.52	0.05
320	Northern Trust Corp	北美信托	NTRS UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,761	1,598,3 52.09	0.05
321	Hershey Co/The	好时公司	HSY UN	纽约证券交易所	美国	1,339	1,590,6 91.39	0.05
322	Atmos Energy Corp	Atmos 能源公司	ATO UN	纽约证券交易所	美国	1,438	1,586,4 18.63	0.05
323	NVR Inc	NVR 股份有限公司	NVR UN	纽约证券交易所	美国	30	1,586,1 29.57	0.05
324	Cboe Global Markets Inc	Cboe 环球市场公司	CBOE UF	Cboe BZX 交易所	美国	948	1,582,6 45.34	0.05
325	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	13,185	1,581,9 11.72	0.05
326	Mettler-	梅特勒-	MTD	纽约证	美国	188	1,580,9	0.05

	Toledo International Inc	托利多国际股份有限公司	UN	券交易所			57.91	
327	Teledyne Technologies Inc	Teledyne 科技股份有限公司	TDY UN	纽约证券交易所	美国	424	1,554,987.08	0.04
328	CenterPoint Energy Inc	中点能源	CNP UN	纽约证券交易所	美国	5,908	1,553,845.14	0.04
329	Live Nation Entertainment Inc	Live Nation 娱乐公司	LYV UN	纽约证券交易所	美国	1,426	1,544,290.99	0.04
330	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	2,229	1,533,581.08	0.04
331	STERIS PLC	思泰瑞医疗公共有限公司	STE UN	纽约证券交易所	美国	889	1,528,758.97	0.04
332	CDW Corp/D E	特拉华 CDW 公司	CDW UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,192	1,523,917.61	0.04
333	Jabil Inc	捷普集团	JBL UN	纽约证券交易所	美国	972	1,517,574.52	0.04
334	Corpay Inc	Corpay 股份有限公司	CPAY UN	纽约证券交易所	美国	638	1,515,483.92	0.04
335	Eversource Energy	Eversource 能源公司	ES UN	纽约证券交易所	美国	3,325	1,514,305.19	0.04
336	VeriSign Inc	威瑞信股份有限公司	VRSN UW	纳斯达克证券交易所	美国	731	1,511,272.09	0.04
337	Cincinnati Financial	辛辛那提金融	CINF UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,415	1,508,473.08	0.04

	1 Corp							
338	Equity Residential	公寓物业权益信托	EQR UN	纽约证券交易所	美国	3,095	1,495,299.46	0.04
339	HP Inc	惠普	HPQ UN	纽约证券交易所	美国	8,532	1,493,947.71	0.04
340	Western Digital Corp	西部数据公司	WDC UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,158	1,446,612.89	0.04
341	Kraft Heinz Co/The	卡夫亨氏公司	KHC UW	纳斯达克证券交易所	美国	7,820	1,445,410.11	0.04
342	Insulet Corp	Insulet 股份有限公司	PODD UW	纳斯达克证券交易所	美国	637	1,432,669.66	0.04
343	W R Berkley Corp	WR Berkley 公司	WRB UN	纽约证券交易所	美国	2,712	1,426,355.63	0.04
344	Labcorp Holdings Inc	Labcorp 控股股份有限公司	LH US	美国证券交易所	美国	758	1,424,436.70	0.04
345	ON Semiconductor Corp	安森美半导体公司	ON UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,782	1,418,939.18	0.04
346	Hubbell Inc	哈贝尔公司	HUBB UN	纽约证券交易所	美国	483	1,412,119.97	0.04
347	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	1,841	1,404,220.60	0.04
348	Smurfit WestRock PLC	Smurfit WestRock 公共有限公司	SW UN	纽约证券交易所	美国	4,488	1,386,314.43	0.04
349	Kellano va	Kellano va	K UN	纽约证券交易所	美国	2,433	1,385,163.97	0.04
350	T Rowe Price	普徕仕	TROW UW	纳斯达克证券	美国	1,994	1,377,464.97	0.04

	Group Inc			交易所				
351	Regions Financia l Corp	Regions 金融公 司	RF UN	纽约证 券交易 所	美国	8,136	1,369,8 60.53	0.04
352	Ulta Beauty Inc	Ulta 美 容产品 公司	ULTA UW	纳斯达 克证券 交易 所	美国	409	1,369,7 14.93	0.04
353	PulteGr oup Inc	Pulte 集 团公司	PHM UN	纽约证 券交易 所	美国	1,814	1,369,4 71.96	0.04
354	Amcor PLC	安姆科 公共有 限公司	AMCR UN	纽约证 券交易 所	美国	20,739	1,364,3 67.67	0.04
355	Waters Corp	沃特世 公司	WAT UN	纽约证 券交易 所	美国	539	1,346,7 65.74	0.04
356	CMS Energy Corp	CMS 能源	CMS UN	纽约证 券交易 所	美国	2,707	1,342,5 30.72	0.04
357	FirstEne rgy Corp	第一能 源	FE UN	纽约证 券交易 所	美国	4,649	1,339,8 66.14	0.04
358	PTC Inc	PTC 公 司	PTC UW	纳斯达 克证券 交易 所	美国	1,086	1,339,8 12.45	0.04
359	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	1,101	1,329,4 71.43	0.04
360	Devon Energy Corp	戴文能 源	DVN UN	纽约证 券交易 所	美国	5,811	1,323,2 52.25	0.04
361	Leidos Holdings Inc	Leidos 控股公 司	LDOU UN	纽约证 券交易 所	美国	1,165	1,315,6 81.96	0.04
362	Willia ms-Sono ma Inc	Willia ms-Sono ma 股份 有限公司	WSM UN	纽约证 券交易 所	美国	1,113	1,301,6 54.04	0.04
363	Quest Diagnos tics Inc	Quest Diagnos tics 股	DGX UN	纽约证 券交易 所	美国	1,010	1,298,7 58.31	0.04

		份有限公司						
364	Texas Pacific Land Corp	德克萨斯州太平洋土地公司	TPL UN	纽约证券交易所	美国	171	1,293,148.76	0.04
365	Edison International	爱迪生国际	EIX UN	纽约证券交易所	美国	3,482	1,286,194.25	0.04
366	Dollar Tree Inc	美元树公司	DLTR UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,788	1,267,670.09	0.04
367	Global Payments Inc	环汇有限公司	GPN UN	纽约证券交易所	美国	2,207	1,264,554.38	0.04
368	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	3,925	1,257,363.35	0.04
369	Coterra Energy Inc	Coterra 能源股份有限公司	CTRA UN	纽约证券交易所	美国	6,908	1,255,081.83	0.04
370	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	2,287	1,241,303.67	0.04
371	NiSource Inc	NiSource 公司	NI UN	纽约证券交易所	美国	4,260	1,230,193.96	0.04
372	Estee Lauder Cos Inc/The	雅诗兰黛	EL UN	纽约证券交易所	美国	2,120	1,226,239.55	0.04
373	International Flavors & Fragrances Inc	国际香料	IFF UN	纽约证券交易所	美国	2,315	1,218,882.29	0.03
374	Fox Corp	福克斯公司	FOX UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,194	441,300.63	0.01

			FOXA UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,937	777,062 .31	0.02
375	Dow Inc	陶氏公 司	DOW UN	纽约证 券交易 所	美国	6,398	1,212,8 03.14	0.03
376	Invitatio n Homes Inc	邀请家 园公司	INVH UN	纽约证 券交易 所	美国	5,159	1,211,3 43.93	0.03
377	Weyerh aeuser Co	惠好	WY UN	纽约证 券交易 所	美国	6,564	1,207,1 48.70	0.03
378	Southw est Airlines Co	西南航 空	LUV UN	纽约证 券交易 所	美国	5,158	1,197,8 16.47	0.03
379	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	588	1,192,9 03.38	0.03
380	Biogen Inc	渤健公 司	BIIB UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,326	1,192,1 38.41	0.03
381	Lennox Internati onal Inc	雷诺士 国际有 限公司	LII UN	纽约证 券交易 所	美国	290	1,190,0 42.80	0.03
382	Tapestr y Inc	TPR-D RS-RS	TPR UN	纽约证 券交易 所	美国	1,880	1,181,7 61.73	0.03
383	Trimble Inc	天宝股 份有限 公司	TRMB UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,159	1,174,3 02.61	0.03
384	Zimmer Biomet Holdings 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	1,791	1,169,4 08.21	0.03
385	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	971	1,150,6 68.64	0.03
386	Steel Dynami cs Inc	Steel Dynami cs 股份 有限公	STLD UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,254	1,149,1 30.97	0.03

		司						
387	Fortive Corp	福迪威公司	FTV UN	纽约证券交易所	美国	3,076	1,147,894.97	0.03
388	Halliburton Co	哈利伯顿	HAL UN	纽约证券交易所	美国	7,781	1,135,187.74	0.03
389	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	1,059	1,122,057.50	0.03
390	KeyCorp	KeyCorp 公司	KEY UN	纽约证券交易所	美国	8,927	1,113,222.00	0.03
391	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	343	1,098,251.22	0.03
392	F5 Inc	F5 股份有限公司	FFIV UW	纳斯达克证券交易所	美国	520	1,095,597.96	0.03
393	Pentair PLC	Pentair 公共有有限公司	PNR UN	纽约证券交易所	美国	1,489	1,094,268.89	0.03
394	Packaging Corp of America	美国包装公司	PKG UN	纽约证券交易所	美国	809	1,091,371.88	0.03
395	Genuine Parts Co	原配部件	GPC UN	纽约证券交易所	美国	1,256	1,090,722.67	0.03
396	Principia Financial Group Inc	信安金融	PFG UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,867	1,061,590.39	0.03
397	Snap-on Inc	实耐宝	SNA UN	纽约证券交易所	美国	473	1,053,661.02	0.03

398	Molina Healthcare Inc	Molina Healthcare 股份有限公司	MOH UN	纽约证券交易所	美国	491	1,047,080.55	0.03
399	Gen Digital Inc	Gen Digital 股份有限公司	GEN UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,940	1,039,686.43	0.03
400	Tyson Foods Inc	泰森食品公司	TSN UN	纽约证券交易所	美国	2,591	1,037,571.35	0.03
401	Loews Corp	罗斯公司	L UN	纽约证券交易所	美国	1,575	1,033,447.71	0.03
402	Rollins Inc	Rollins 公司	ROL UN	纽约证券交易所	美国	2,544	1,027,491.61	0.03
403	Evergy Inc	Evergy 股份有限公司	EVRG UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,082	1,027,346.86	0.03
404	Jacobs Solutions Inc	嘉科解决方案股份有限公司	J UN	纽约证券交易所	美国	1,088	1,023,805.79	0.03
405	West Pharmaceutical Services Inc	西氏医药服务公司	WST UN	纽约证券交易所	美国	650	1,018,096.09	0.03
406	Zebra Technologies Corp	斑马技术公司	ZBRA UW	纳斯达克证券交易所	美国	460	1,015,415.91	0.03
407	Deckers Outdoor Corp	德克斯户外用品公司	DECK UN	纽约证券交易所	美国	1,374	1,013,787.90	0.03
408	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	1,239	1,013,340.99	0.03
409	Ball	波尔	BALL	纽约证	美国	2,511	1,008,2	0.03

	Corp		UN	券交易 所			31.47	
410	Baxter Internati onal Inc	百特	BAX UN	纽约证 券交易 所	美国	4,645	1,006,8 61.39	0.03
411	Alliant Energy Corp	Alliant 能源公 司	LNT UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,325	1,006,4 47.26	0.03
412	Domino' s Pizza Inc	达美乐 披萨公 司	DPZ UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	310	999,956 .20	0.03
413	News Corp	新闻集 团	NWS UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,009	247,822 .07	0.01
			NWSA UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,414	726,340 .76	0.02
414	CF Industri es Holdings s Inc	CF 工业 控股股 份有限 公司	CF UN	纽约证 券交易 所	美国	1,466	965,494 .70	0.03
415	Lyondel lBasell Industri es NV	利安德 巴塞尔 工业公 司	LYB UN	纽约证 券交易 所	美国	2,327	963,835 .48	0.03
416	Aptiv PLC	安波福 公共有 限公司	APTV UN	纽约证 券交易 所	美国	1,971	962,556 .95	0.03
417	Clorox Co/The	高乐氏 公司	CLX UN	纽约证 券交易 所	美国	1,116	959,238 .94	0.03
418	Las Vegas Sands Corp	拉斯维 加斯金 沙公司	LVS UN	纽约证 券交易 所	美国	3,070	956,215 .01	0.03
419	Hologic Inc	豪洛捷 公司	HOLX UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,017	940,838 .48	0.03
420	Textron Inc	德事隆	TXT UN	纽约证 券交易 所	美国	1,634	939,164 .37	0.03
421	Everest Group	Everest 集团有	EG UN	纽约证 券交易	美国	385	936,647 .33	0.03

	Ltd	限公司		所				
422	Teradyne Inc	泰瑞达	TER UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,452	934,654 .31	0.03
423	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	1,810	922,024 .82	0.03
424	Kimco Realty Corp	Kimco Realty Corp	KIM UN	纽约证券交易所	美国	6,123	921,350 .91	0.03
425	Omnicom Group Inc	Omnicom 集团	OMC UN	纽约证券交易所	美国	1,766	909,471 .78	0.03
426	Avery Dennison Corp	艾利丹尼森	AVY UN	纽约证券交易所	美国	708	889,332 .64	0.03
427	Masco Corp	马斯可	MAS UN	纽约证券交易所	美国	1,909	879,528 .79	0.03
428	IDEX Corp	艺达思集团	IEX UN	纽约证券交易所	美国	684	859,675 .41	0.02
429	Juniper Networks Inc	瞻博网络股份有限公司	JNPR UN	纽约证券交易所	美国	2,997	856,671 .17	0.02
430	Jack Henry & Associates Inc	Jack Henry & Associates 公司	JKHY UW	纳斯达克证券交易所	美国	659	849,955 .11	0.02
431	Best Buy Co Inc	百思买	BBY UN	纽约证券交易所	美国	1,743	837,610 .53	0.02
432	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	617	836,243 .38	0.02
433	Builders FirstSource Inc	Builders FirstSource 股份有限公司	BLDR UN	纽约证券交易所	美国	1,000	835,337 .03	0.02

434	Allegion plc	安朗杰公共有限公司	ALLE UN	纽约证券交易所	美国	779	803,692 .30	0.02
435	UDR Inc	UDR 公司	UDR UN	纽约证券交易所	美国	2,729	797,647 .51	0.02
436	TKO Group Holdings Inc	TKO 集团控股股份有限公司	TKO UN	纽约证券交易所	美国	607	790,621 .91	0.02
437	Healthpeak Properties Inc	Healthpeak Properties Inc	DOC UN	纽约证券交易所	美国	6,288	788,182 .48	0.02
438	Camden Property Trust	Camden 房地产信托公司	CPT UN	纽约证券交易所	美国	976	787,341 .77	0.02
439	Akamai Technologies Inc	阿卡迈技术公司	AKAM UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,323	755,393 .23	0.02
440	Regency Centers Corp	Regency Centers 公司	REG UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,479	754,152 .57	0.02
441	Nordson Corp	诺信公司	NDSN UW	纳斯达克证券交易所	美国	489	750,414 .06	0.02
442	Mosaic Co/The	Mosaic 公司	MOS UN	纽约证券交易所	美国	2,871	749,749 .39	0.02
443	Revvity Inc	Revvity 股份有限公司	RVTY UN	纽约证券交易所	美国	1,067	738,769 .24	0.02
444	CH Robinson Worldwide 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	1,075	738,382 .75	0.02
445	Alexandria Real Estate Equities	亚历山大房地产股份有限公司	ARE UN	纽约证券交易所	美国	1,419	737,779 .42	0.02

	Inc	司						
446	Paycom Software Inc	Paycom 软件股份有限公司	PAYC UN	纽约证券交易所	美国	441	730,516 .52	0.02
447	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	709	728,834 .25	0.02
448	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	1,359	724,970 .61	0.02
449	Pool Corp	Pool 公司	POOL UW	纳斯达克证券交易所	美国	340	709,440 .17	0.02
450	Incyte Corp	因赛特公司	INCY UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,454	708,825 .96	0.02
451	Ralph Lauren Corp	拉夫劳伦	RL UN	纽约证券交易所	美国	361	708,809 .35	0.02
452	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	6,359	699,210 .81	0.02
453	Bunge Global SA	Bunge Global SA	BG US	美国证券交易所	美国	1,216	698,825 .97	0.02
454	Pinnacle West Capital Corp	Pinnacle 西部资本	PNW UN	纽约证券交易所	美国	1,081	692,358 .82	0.02
455	Solventum Corp	Solventum 公司	SOLV UN	纽约证券交易所	美国	1,253	680,264 .00	0.02
456	Viatris Inc	晖致	VTRS UW	纳斯达克证券交易所	美国	10,623	679,089 .06	0.02
457	Stanley Black & Decker	史丹利百得公司	SWK UN	纽约证券交易所	美国	1,400	678,993 .21	0.02

	Inc							
458	J M Smucker Co/The	JM 斯马克公司	SJM UN	纽约证券交易所	美国	963	676,964 .46	0.02
459	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	518	671,732 .24	0.02
460	Globe Life Inc	Globe Life 股份有限公司	GL UN	纽约证券交易所	美国	747	664,637 .57	0.02
461	CarMax Inc	CarMax 股份有限公司	KMX UN	纽约证券交易所	美国	1,379	663,477 .59	0.02
462	EPAM Systems Inc	EPAM 系统公司	EPAM UN	纽约证券交易所	美国	513	649,347 .01	0.02
463	Assurant Inc	安信龙集团	AIZ UN	纽约证券交易所	美国	459	648,912 .13	0.02
464	BXP Inc	波士顿地产公司	BXP UN	纽约证券交易所	美国	1,337	645,758 .62	0.02
465	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	4,320	633,037 .86	0.02
466	Hasbro Inc	孩之宝	HAS UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,192	629,909 .84	0.02
467	LKQ Corp	LKQ 公司	LKQ UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,336	618,899 .34	0.02
468	Huntington Ingalls Industries Inc	Huntington Ingalls 工业公司	HII UN	纽约证券交易所	美国	355	613,623 .02	0.02
469	Moderna Inc	莫德纳公司	MRNA UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,080	608,317 .78	0.02

470	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	4,044	587,093 .39	0.02
471	Interpublic Group of Cos Inc/The	Interpublic 集团	IPG UN	纽约证券交易所	美国	3,346	586,361 .50	0.02
472	Henry Schein Inc	亨利香恩公司	HSIC UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,102	576,275 .17	0.02
473	Dayforce Inc	Dayforce 股份有限公司	DAY UN	纽约证券交易所	美国	1,447	573,756 .99	0.02
474	Hormel Foods Corp	荷美尔食品有限公司	HRL UN	纽约证券交易所	美国	2,638	571,252 .70	0.02
475	Erie Indemnity Co	伊利赔偿公司	ERIE UW	纳斯达克证券交易所	美国	226	561,051 .98	0.02
476	Eastman Chemical Co	伊士曼化工	EMN UN	纽约证券交易所	美国	1,045	558,511 .82	0.02
477	Generac Holdings Inc	Generac 控股公司	GNRC UN	纽约证券交易所	美国	535	548,472 .96	0.02
478	Market Axess Holdings Inc	Market Axess 控股公司	MKTX UW	纳斯达克证券交易所	美国	339	541,993 .78	0.02
479	Wynn Resorts Ltd	永利渡假村有限公司	WYNN UW	纳斯达克证券交易所	美国	797	534,425 .21	0.02
480	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	1,551	533,942 .72	0.02
481	Walgreens Boots Alliance	沃博联股份有限公司	WBA UW	纳斯达克证券交易所	美国	6,496	533,846 .01	0.02

	Inc							
482	Bio-Techne Corp	Bio-techne 公司	TECH UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,419	522,631 .85	0.02
483	Paramount Global	派拉蒙全球	PARA UW	纳斯达克证券交易所	美国	5,447	503,008 .34	0.01
484	A O Smith Corp	AO 史密斯公司	AOS UN	纽约证券交易所	美国	1,052	493,797 .65	0.01
485	Match Group Inc	Match 集团股份有限公司	MTCH UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,219	490,685 .59	0.01
486	AES Corp/The	爱伊斯公司	AES UN	纽约证券交易所	美国	6,443	485,212 .49	0.01
487	Charles River Laboratories International Inc	查理斯河实验室国际有限公司	CRL UN	纽约证券交易所	美国	445	483,347 .60	0.01
488	Franklin Resources Inc	富兰克林资源	BEN UN	纽约证券交易所	美国	2,806	479,075 .70	0.01
489	Federal Realty Investment Trust	联邦房地产投资信托公司	FRT UN	纽约证券交易所	美国	703	478,036 .78	0.01
490	Albemarle Corp	雅保公司	ALB UN	纽约证券交易所	美国	1,065	477,790 .38	0.01
491	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	1,277	473,988 .44	0.01
492	MGM Resorts International	美高梅国际酒店集团	MGM UN	纽约证券交易所	美国	1,872	460,856 .92	0.01
493	Invesco Ltd	景顺有限公司	IVZ UN	纽约证券交易	美国	4,051	457,321 .94	0.01

				所				
494	APA Corp	APA	APA UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,266	427,619 .97	0.01
495	The Campbell's Company	金宝汤公司	CPB UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,781	390,771 .15	0.01
496	DaVita Inc	DaVita 股份有限公司	DVA UN	纽约证券交易所	美国	376	383,423 .21	0.01
497	Caesars Entertainment Inc	凯撒娱乐集团	CZR UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,882	382,483 .85	0.01
498	Ralliant Corp	Ralliant Corp	RAL UN	纽约证券交易所	美国	1,024	355,451 .41	0.01
499	Mohawk Industries Inc	Mohawk 工业股份有限公司	MHK UN	纽约证券交易所	美国	470	352,738 .58	0.01
500	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	1,188	337,200 .13	0.01
501	Brown-Forman Corp	百富门公司	BF/B UN	纽约证券交易所	美国	1,648	317,467 .30	0.01

注:本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

7.4.1.2 期末积极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

无。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	Microsoft Corp	MSFT UW	11,225,408.41	0.29

2	NVIDIA Corp	NVDA UW	10,149,531.59	0.26
3	Apple Inc	AAPL UW	10,088,354.85	0.26
4	Amazon.com Inc	AMZN UW	8,013,964.45	0.21
5	Alphabet Inc	GOOGL UW	3,294,133.56	0.08
		GOOG UW	2,484,368.86	0.06
6	DoorDash Inc	DASH UW	4,835,537.72	0.12
7	Meta Platforms Inc	META UW	4,657,891.78	0.12
8	Broadcom Inc	AVGO UW	4,059,307.70	0.10
9	Coinbase Global Inc	COIN UW	3,770,890.48	0.10
10	Tesla Inc	TSLA UW	3,262,120.31	0.08
11	Berkshire Hathaway Inc	BRK/B UN	3,064,526.56	0.08
12	JPMorgan Chase & Co	JPM UN	2,169,912.54	0.06
13	Eli Lilly & Co	LLY UN	2,158,219.91	0.06
14	Exxon Mobil Corp	XOM UN	1,900,800.63	0.05
15	Visa Inc	V UN	1,795,232.34	0.05
16	Charles Schwab Corp/The	SCHW UN	1,723,324.55	0.04
17	Expand Energy Corp	EXE UW	1,719,761.68	0.04
18	Johnson & Johnson	JNJ UN	1,622,796.12	0.04
19	Costco Wholesale Corp	COST UW	1,509,116.69	0.04
20	Williams-Sonoma Inc	WSM UN	1,488,295.59	0.04

注：1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。对基金持有的不同市场上市的同一公司合并计算净值占比，分开列示。

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（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	Microsoft Corp	MSFT UW	27,633,846.32	0.71
2	Apple Inc	AAPL UW	27,582,762.39	0.71
3	NVIDIA Corp	NVDA UW	25,121,348.48	0.65

4	Alphabet Inc	GOOGL UW	8,338,528.89	0.21
		GOOG UW	7,148,243.14	0.18
5	Amazon.com Inc	AMZN UW	15,433,111.24	0.40
6	Meta Platforms Inc	META UW	11,348,432.30	0.29
7	Broadcom Inc	AVGO UW	8,297,484.39	0.21
8	Berkshire Hathaway Inc	BRK/B UN	8,127,202.32	0.21
9	Tesla Inc	TSLA UW	6,681,578.54	0.17
10	JPMorgan Chase & Co	JPM UN	6,387,080.25	0.16
11	Eli Lilly & Co	LLY UN	5,538,379.56	0.14
12	Visa Inc	V UN	5,398,536.52	0.14
13	Exxon Mobil Corp	XOM UN	4,948,851.30	0.13
14	Mastercard Inc	MA UN	4,170,139.23	0.11
15	Netflix Inc	NFLX UW	4,166,116.86	0.11
16	Costco Wholesale Corp	COST UW	3,863,895.60	0.10
17	Walmart Inc	WMT UN	3,716,840.54	0.10
18	Johnson & Johnson	JNJ UN	3,664,871.87	0.09
19	Procter & Gamble Co/The	PG UN	3,604,231.51	0.09
20	UnitedHealth Group Inc	UNH UN	3,346,719.02	0.09

注:1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。对基金持有的不同市场上市的同一公司合并计算净值占比，分开列示。

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（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	194,611,584.14
卖出收入（成交）总额	440,601,893.11

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

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	ES2509	2,866,607.68	0.08

注：金融衍生品投资项下的期货投资，在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则金融衍生品投资项下的期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间相抵销后的净额为 0，因此此处的公允价值实为公允价值变动。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

无。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 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

本基金投资的前十名股票（如有）没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	7,629,526.21
2	应收清算款	-

3	应收股利	1,514,155.83
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	9,143,682.04

7.11.4 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处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.11.5.2 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

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
23,74 3	91,805.33	997,825,860.00	45.78 %	1,181,908,140.00	54.22 %

8.2 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	上海浦东发展银行股份有限公司一兴 证全球积极配置混合型基金中基金 (FOF-LOF)	77,569,800.00	3.56%
2	黄秋元	75,700,000.00	3.47%
3	BARCLAYS BANK PLC	68,744,879.00	3.15%
4	杨巧伟	67,762,241.00	3.11%
5	UBS AG	61,531,900.00	2.82%
6	广发证券股份有限公司	56,519,647.00	2.59%

7	香港上海汇丰银行有限公司	54,897,200.00	2.52%
8	招银理财有限责任公司—招银理财招睿安盈优选（稳健）14 个月持有增强型固收类理财产品	44,548,100.00	2.04%
9	上海东证期货—工商银行—东证期货工银慧享二号集合资产管理计划	34,864,600.00	1.60%
10	中国民生银行股份有限公司—兴证全球优选平衡三个月持有期混合型基金中基金（FOF）	30,456,800.00	1.40%

8.3 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。

8.4 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 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
本报告期期初基金份额总额	2,551,734,000.00
本报告期基金总申购份额	108,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	480,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	2,179,734,000.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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。

10.3 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的诉讼事项。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易 单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股 票成交总 额的比例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
CLSA Limited	-	635,213,481.26	100.00%	63,520.23	100.00%	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-

注：根据 2024 年 7 月 1 日起施行的《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（证监会公告〔2024〕3 号），基金管理人制定了证券公司交易单元的选择标准和程序：

1、选择标准

基金管理人建立了选择机制，选择财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易，并制定了定性与定量相结合的具体标准。

2、选择程序

(1) 基金管理人根据上述标准对证券公司进行评估，与符合标准的证券公司签订交易单元租用协议后将其入库，并对入库的证券公司开展动态管理，定期检视其是否持续符合选择标准；

(2) 基金管理人根据其建立的服务评价及交易量分配机制，定期对证券公司开展评价后，根据评价结果进行交易量的分配。

3、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：无；减少交易单元：无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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
CLSA Limited	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金关于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	2025-01-01
2	南方基金管理股份有限公司关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）午间收盘二级市场交易价格溢价风险提示公告	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	2025-01-02
3	南方基金管理股份有限公司关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	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	2025-01-03
4	南方基金管理股份有限公司关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）午间收盘二级市场交易价格溢价风险提示公告	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	2025-01-03
5	南方基金管理股份有限公司关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）午间收盘二级市场交易价格溢价风险提示公告	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	2025-01-06
6	南方基金管理股份有限公司关于旗下部分基金 2025 年 1 月 9 日暂停申购赎回等业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监	2025-01-07

		会基金电子披露网站	
7	南方基金管理股份有限公司关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	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	2025-01-07
8	南方基金管理股份有限公司关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）午间收盘二级市场交易价格溢价风险提示公告	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	2025-01-07
9	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加华金证券为一级交易商的公告	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	2025-01-08
10	南方基金管理股份有限公司关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）午间收盘二级市场交易价格溢价风险提示公告	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	2025-01-08
11	南方基金管理股份有限公司关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	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	2025-01-09
12	南方基金管理股份有限公司关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）午间收盘二级市场交易价格溢价风险提示公告	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	2025-01-09
13	南方基金管理股份有限公司关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	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	2025-01-10
14	南方基金管理股份有限公司关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）午间收盘二级市场交易价格溢价风险提示公告	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	2025-01-10
15	南方基金管理股份有限公司关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）午间收盘二级市场交易价格溢价风险提示公告	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	2025-01-13
16	南方基金管理股份有限公司关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）午间收盘二级市场交易价格溢价风险提示公告	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	2025-01-14
17	南方基金管理股份有限公司关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	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	2025-01-15
18	南方基金管理股份有限公司关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）午间收盘二级市场交易价格溢价风险提示公告	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	2025-01-15
19	南方基金管理股份有限公司关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	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	2025-01-16
20	南方基金管理股份有限公司关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）午间收盘二级市场交易价格溢价风险提示公告	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	2025-01-16
21	南方基金管理股份有限公司关于南方标普 500	中国证券报、基金管	2025-01-17

36	南方基金管理股份有限公司关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）午间收盘二级市场交易价格溢价风险提示公告	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	2025-02-07
37	南方基金管理股份有限公司关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）午间收盘二级市场交易价格溢价风险提示公告	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	2025-02-10
38	南方基金管理股份有限公司关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）午间收盘二级市场交易价格溢价风险提示公告	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	2025-02-11
39	南方基金管理股份有限公司关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）午间收盘二级市场交易价格溢价风险提示公告	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	2025-02-12
40	南方基金管理股份有限公司关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）午间收盘二级市场交易价格溢价风险提示公告	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	2025-02-13
41	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加瑞银证券为一级交易商的公告	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	2025-02-20
42	南方基金管理股份有限公司关于旗下部分上交所 ETF 变更扩位证券简称的公告	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	2025-02-28
43	关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）变更基金经理的公告	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	2025-03-08
44	南方基金管理股份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)	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	2025-03-31
45	南方基金管理股份有限公司关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）午间收盘二级市场交易价格溢价风险提示公告	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	2025-04-08
46	关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）变更基金经理的公告	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	2025-04-12
47	关于南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）变更基金经理的公告	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	2025-06-07

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 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）2025 年中期报告》原文。

12.2 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。

12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>