大成标普500等权重指数证券投资基金
2020年年度报告

2020年12月31日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2021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、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 03 月 29 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。

本报告财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2

1.1 重要提示 2
1.2 目录 3

§2 基金简介 5

2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人 6
2.5 信息披露方式 6
2.6 其他相关资料 6

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 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 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 11
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 12
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 14
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 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 15

§6 审计报告 15

§7 年度财务报表 17

7.1 资产负债表 17
7.2 利润表 18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 19
7.4 报表附注 21

§8 投资组合报告 43

8.1 期末基金资产组合情况 43
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 44
8.3 期末按行业分类的权益投资组合 44
8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 45
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动 160
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 162
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 162
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 162
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 162
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 162
8.11 投资组合报告附注 162

§9 基金份额持有人信息 163

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 163
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 163
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 164
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 164

§10 开放式基金份额变动 164

§11 重大事件揭示 164

11.1 基金份额持有人大会决议 164
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 164
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 165
11.4 基金投资策略的改变 165
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 165
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 165
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 165
11.8 其他重大事件 166

§12 影响投资者决策的其他重要信息 169

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 169
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 169

§13 备查文件目录 169

13.1 备查文件目录 169
13.2 存放地点 169
13.3 查阅方式 169

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成标普 500 等权重指数证券投资基金
基金简称	大成标普 500 等权重指数 QDII
基金主代码	096001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 3 月 23 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	112,448,859.42 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。
投资策略	本基金将按照标的指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合，并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（如股票停牌、流动性不足）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。本基金还可能将一定比例的基金资产投资于与标普 500 等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金，以优化投资组合的建立，达到节约交易成本和有效追踪标的指数表现的目的。
业绩比较基准	标普 500 等权重指数（全收益指数）
风险收益特征	本基金为美国股票指数型证券投资基金，风险与预期收益高于混合型基金、债券基金以及货币市场基金，属于预期风险较高的产品。

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		大成基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵冰	许俊
	联系电话	0755-83183388	010-66594319
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008885558	95566
传真		0755-83199588	010-66594942
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518040	100818
法定代表人		吴庆斌	刘连舸

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	英文	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	中国银行（香港）有限公司
注册地址		香港花园道 1 号中银大厦
办公地址		香港花园道 1 号中银大厦

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.dcfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

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）	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	大成基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年	2019 年	2018 年
本期已实现收益	5,584,537.97	5,615,278.53	20,209,770.76
本期利润	4,806,772.16	43,451,252.78	-12,098,628.90
加权平均基金份额本期利润	0.0374	0.4319	-0.0844
本期加权平均净值利润率	2.13%	23.62%	-4.84%
本期基金份额净值增长率	0.78%	26.98%	-4.02%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末

期末可供分配利润	62,650,677.05	70,433,834.44	62,968,131.01
期末可供分配基金份额利润	0.5571	0.5765	0.5766
期末基金资产净值	220,063,390.01	244,379,635.95	178,230,968.42
期末基金份额净值	1.957	2.000	1.632
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	131.82%	130.02%	81.15%

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

2、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（为期末余额，不是当期发生数）。

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

3.2 基金净值表现

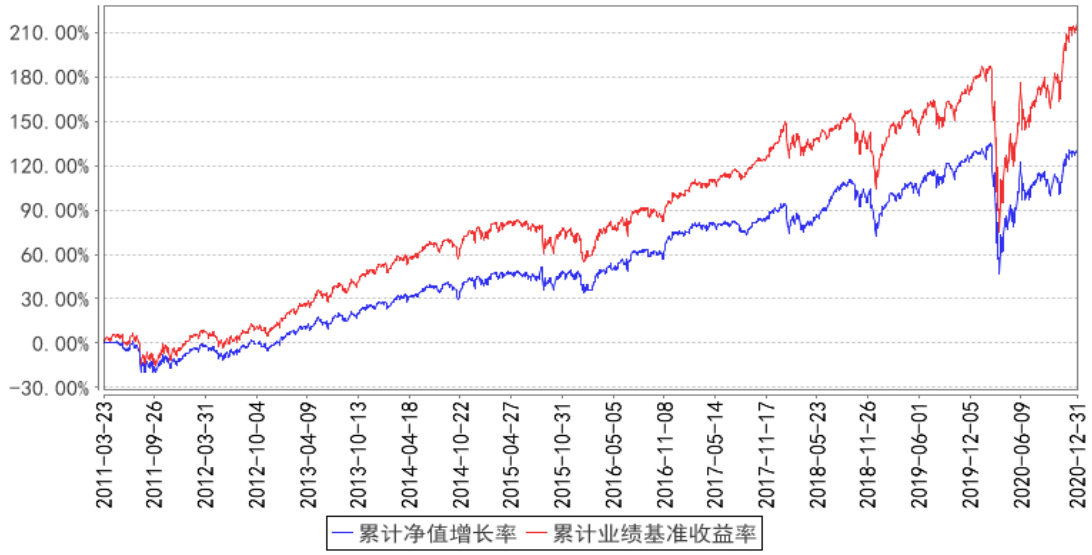
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	12.21%	1.24%	18.46%	1.36%	-6.25%	-0.12%
过去六个月	14.44%	1.15%	26.45%	1.22%	-12.01%	-0.07%
过去一年	0.78%	2.35%	12.83%	2.48%	-12.05%	-0.13%
过去三年	22.83%	1.54%	34.69%	1.61%	-11.86%	-0.07%

过去五年	58.23%	1.27%	83.85%	1.33%	-25.62%	-0.06%
自基金合同生效起至今	131.82%	1.16%	216.09%	1.22%	-84.27%	-0.06%

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

大成标普500等权重指数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

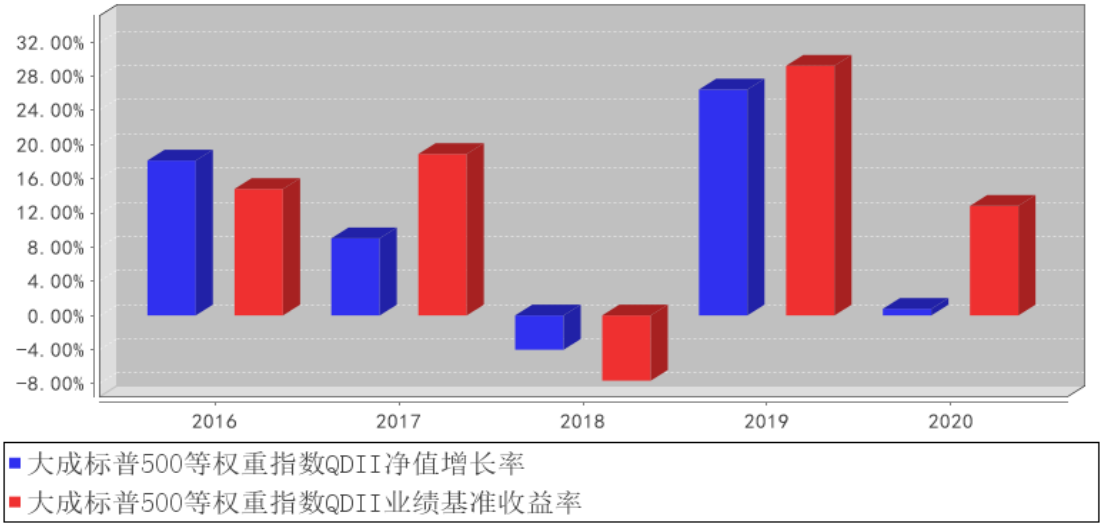


注：1、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

2、同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

3.2.3 过去五年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

大成标普500等权重指数QDII基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：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

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2020 年	0.580	2,487,553.99	4,779,031.88	7,266,585.87	-
2019 年	0.577	2,826,145.96	3,203,063.51	6,029,209.47	-
2018 年	0.474	2,852,333.67	4,488,739.35	7,341,073.02	-
合计	1.631	8,166,033.62	12,470,834.74	20,636,868.36	-

§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

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10 号文批准，于 1999 年 4 月 12 日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本为 2 亿元人民币，注册地为深圳。目前公司由三家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。公司业务资质齐全，是全国同时具有境内、境外社保基金管理人资格和基本养老保险基金管理人资格的四家基金公司之一，全面涵盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理、私募股权投资等业务，旗下大成国际资产管理公司具备 QFII、RQFII 以及 QFLP 等资格。

历经 21 年的发展，大成基金形成了以长期投资能力为核心竞争优势，打造了一支具有良好职

业素养和丰富经验的资产管理队伍。目前已形成权益、固定收益、量化投资、商品期货、境外投资、大类资产配置等六大投资团队，全面覆盖各类投资领域。截至 2020 年 12 月 31 日，公司管理公募基金产品数量共 115 只。

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		
冉 凌浩	本基金基金经理	2011 年 8 月 26 日	-	17 年	金融学硕士。2003 年 4 月至 2004 年 6 月就职于国信证券研究部，任研究员。2004 年 6 月至 2005 年 9 月就职于华西证券研究部，任高级研究员。2005 年 9 月加入大成基金管理有限公司，曾担任金融工程师、境外市场研究员及基金经理助理。2011 年 8 月 26 日起任大成标普 500 等权重指数型证券投资基金基金经理。2014 年 11 月 13 日起任大成纳斯达克 100 指数证券投资基金基金经理。2016 年 12 月 2 日起任大成恒生综合中小型股指数基金(QDII-LOF)基金经理。2016 年 12 月 29 日至 2020 年 7 月 7 日任大成海外中国机会混合型证券投资基金（LOF）基金经理。2017 年 8 月 10 日起任大成恒生指数证券投资基金（LOF）基金经理。2019 年 3 月 20 日起任大成中华沪深港 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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

无

4.1.4 基金经理薪酬机制

无

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

无。

4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，

本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

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

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持，投资部门负责投资决策，交易管理部负责实施交易并实时监控，监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核，风险管理部负责对交易情况进行合理性分析，通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

4.4.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合间连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；部分股票同向交易溢价率较大主要来源于市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大，但结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

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

无。

4.4.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在 7 笔同日反向交易，原因为流动性需要或合规比例调整。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，但不存在参与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股当日成交量 5%的情形；主动投资组合间债券交易存在 5 笔同日反向交易，原因为流动性需要或合规比例调整。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

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

2020 年，全球宏观经济遭受了巨大冲击，其主要原因是全球主要国家都经历了一次黑天鹅事

件，即新型冠状病毒肺炎在全球蔓延。为了减缓疫情的扩散，各国政府采取了较为严格的管控手段，这些管控手段阻止了疫情的快速传播，但同时也极大减少了社会经济活动，对宏观经济造成了巨大影响。

疫情在美国的蔓延使得美国在上半年进入实质性的经济衰退，在其 1 季度 GDP 负增长的基础上，其 2 季度的 GDP 环比折年率为负 32.9%，GDP 同比则是下降 9.5%，其他宏观经济数据也出现了大幅恶化的迹象。

在 2020 年下半年以来，虽然新型冠状病毒肺炎仍然在全球蔓延，但在各国政府的努力控制下，其蔓延趋势得到了一定程度上的缓解。同期，在疫情得到一定控制的前提下，多国政府也逐步解封经济活动，美国也不例外，社会经济活动也逐步得以恢复。自经济逐步解封以来，美国的就业、零售、制造业 PMI 等数据均显著反弹，且反弹力度和速度均是远超市场预期，显示美国经济修复较快。从数据上来看，美国 3 季度的 GDP 环比折年率由负转正，增长率高达 32.9%，其 4 季度的 GDP 环比折年率也是为 4.0%，这证明美国已经走出了经济衰退。

宏观经济的变化导致上市公司盈利的变化，而上市公司盈利增长是美股上涨的最根本动力。在今年 1-2 季度，由于宏观经济的衰退，美国上市公司盈利出现了快速下降，从而导致了美股的下跌。随着其后宏观经济的逐步复苏，在 3 季度上市公司盈利已经停止了下滑，而且市场也普遍预计 4 季度会恢复至正增长的势态。

在新型冠状病毒肺炎在美国流行之初，金融市场也出现过剧烈动荡，美联储则迅速颁布了多项货币金融政策，将联邦基金目标利率区间降为 0-0.25%，并持续施行量化宽松政策。美联储的金融政策平息了金融市场的混乱，并将美国长期国债与短期国债收益率利差恢复到正常的状态中。

从股票市场来看，上半年美股出现了较大的下跌，但随着宏观经济的逐步复苏，下半年美股又出现了可观的上涨，在 4 季度，标普 500 指数还创出了历史新高。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.957 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.78%，业绩比较基准收益率为 12.83%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在 2020 年末，多家欧美公司宣布成功的研制出了新冠疫苗，且新冠疫苗的总产能也较大。因此展望 2021 年，欧美国家随着新冠疫苗的不断普及，其疫情会逐步消除，未来疫情将不再是经济增长的显著拖累。

在这种情况下，美国的宏观经济有望保持强劲复苏的状态，顺利进入新一轮经济增长周期。同时预计美联储会在较长的时间内保持宽松的货币政策不变。强劲的经济增长及较为宽松的货币

政策有利于美股的长期表现。

本基金为被动型指数基金，其投资目标就是要复制指数的收益率。本基金将坚持被动型的指数化投资理念，持续实施高效的组合管理策略、交易策略及风险控制方法，以期更好地跟踪指数，力争将跟踪误差控制在较低的水平。

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，依据相关的法律法规、基金合同以及内部监察稽核制度，本基金管理人对本基金运作、内部管理、制度执行及遵规守法情况进行了监察稽核。内部监察稽核的重点是：国家法律法规及行业监管规则的执行情况；基金合同的遵守情况；内部规章制度的执行情况；资讯管制和保密工作落实情况；员工职业操守规范情况，目的是规范基金财产的运作，防范和控制投资风险，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，维护本基金份额持有人的合法权益。

（一）根据最新的法律法规、规章、规范性文件，本基金管理人及时制定了相应的公司制度，并对现有制度进行不断修订和完善，确保本基金管理人内控制度的适时性、全面性和合法合规性。同时，为保障制度的适时性，避免部分内控制度、业务规则与业务发展不相适应，报告期内本基金管理人组织各部门对内部管理制度作了进一步梳理和完善。

（二）全面加强风险监控，不断提高基金业务风险管理水平。为督促各部门完善并落实各项内控措施，公司严格执行风险控制管理员制度，健全内控工作协调机制及监督机制，并进一步加强投资风险数量化评价能力及事前风险防范能力，有效防范相关业务风险。同时，公司严格执行投资报备制度，建立了基金从业人员证券投资管理监控信息系统，将投资报备工作纳入常态。

（三）日常监察和专项监察相结合，确保监察稽核的有效性和深入性。本年度，公司继续对本基金销售、宣传等方面的材料、协议及其他法律资料等进行了严格审查，对本基金各项投资比例、投资权限、基金交易、股票投资限制、股票库维护等方面进行实时监察，同时，还专门针对基金投资交易（包括公平交易、转债投资、投资权限、投资比例、流动性风险、基金重仓股等）、基金运营（基金头寸、基金结算、登记清算等）、网上交易、基金销售等进行专项监察。通过日常监察，保证了公司监察的全面性、实时性，通过专项监察，及时发现并纠正了业务中的潜在风险，加强了业务部门和人员的风险意识，从而较好地预防了风险的发生。

（四）加强了对投资管理人员通讯工具在交易时间的集中管理，定期或不定期的对投资管理人员的网络即时通讯记录、电话录音等进行抽查，有效的防范了各种形式的利益输送行为。

（五）以多种方式加强合规教育与培训，提高全公司的合规守法意识。及时向全公司传达与基金相关的法律法规，并要求公司各部门贯彻到日常工作中。公司监察稽核部通过解答各业务部门提出的法律问题，提供法律依据，对于较为重大疑难法律事项及时咨询公司外部律师或监管部

门，避免了业务发展中的盲目性，及时防范风险，维护了基金份额持有人的利益。

4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、研究部、固定收益总部、数量与指数投资部、大类资产配置部、交易管理部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括五名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、数量与指数投资部、大类资产配置部、风险管理部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；交易管理部负责关注相关投资品种的流动性状况，协助反馈其市场交易信息；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管行沟通估值调整事项；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算人员执行，并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制，投资组合经理作为估值小组成员，对持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内大成标普 500 等权重指数证券投资基金已分配利润 7,266,585.87 元（每十份基金份额分红 0.580 元），符合基金合同规定的分红比例。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在大成标普 500 等权重指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“ 关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	大成标普 500 等权重指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	(一)我们审计的内容 我们审计了大成标普 500 等权重指数证券投资基金(以下简称“大成标普 500 等权重指数 QDII 基金”)的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。 (二)我们的意见 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，公允反映了大成标普 500 等权重指数 QDII 基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。

形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。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。 按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于大成标普 500 等权重指数 QDII 基金，并履行了职业道德方面的其他责任。
管理层和治理层对财务报表的责任	大成标普 500 等权重指数 QDII 基金的基金管理人大成基金管理有限公司(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。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估大成标普 500 等权重指数 QDII 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大成标普 500 等权重指数 QDII 基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督大成标普 500 等权重指数 QDII 基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (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。 (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。 (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。 (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，就可能导致对大成标普 500 等权重指数 QDII 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大成标普 500 等权重指数 QDII 基金不能持续经营。 (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	陈薇瑶
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座 11 楼	
审计报告日期	2021 年 3 月 29 日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	14,491,186.45	27,739,881.45
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	208,686,583.77	229,997,351.38
其中：股票投资		208,686,583.77	229,997,351.38
基金投资		-	-
债券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	423.34	1,894.25
应收股利		253,532.40	331,834.25
应收申购款		856,800.52	3,139,760.29
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	196,351.92	-
资产总计		224,484,878.40	261,210,721.62
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末**	**上年度末**

		2020年12月31日	2019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		-	-
应付证券清算款		-	13,980,593.54
应付赎回款		3,992,648.84	2,096,012.89
应付管理人报酬		187,436.06	191,042.99
应付托管费		46,858.97	47,760.75
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	194,544.52	515,675.50
负债合计		4,421,488.39	16,831,085.67
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	112,448,859.42	122,182,590.21
未分配利润	7.4.7.10	107,614,530.59	122,197,045.74
所有者权益合计		220,063,390.01	244,379,635.95
负债和所有者权益总计		224,484,878.40	261,210,721.62

注： 报告截止日2020年12月31日，基金份额净值1.957元，基金份额总额112,448,859.42份。

7.2 利润表

会计主体：大成标普500等权重指数证券投资基金

本报告期：2020年1月1日至2020年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
一、收入		8,129,633.68	46,543,271.69
1.利息收入		46,096.21	46,967.27
其中：存款利息收入	7.4.7.11	46,096.21	46,967.27
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-

其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		9,302,664.30	8,714,663.37
其中：股票投资收益	7.4.7.12	4,748,763.64	5,386,266.99
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	4,553,900.66	3,328,396.38
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-777,765.81	37,835,974.25
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-883,299.28	-206,576.15
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	441,938.26	152,242.95
减：二、费用		3,322,861.52	3,092,018.91
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	2,265,819.16	1,840,433.06
2．托管费	7.4.10.2.2	566,454.83	460,108.32
3．销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4．交易费用	7.4.7.20	84,403.98	45,088.15
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．税金及附加		-	-
7．其他费用	7.4.7.21	406,183.55	746,389.38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,806,772.16	43,451,252.78
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,806,772.16	43,451,252.78

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成标普500等权重指数证券投资基金

本报告期：2020年1月1日至2020年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	122,182,590.21	122,197,045.74	244,379,635.95

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	4,806,772.16	4,806,772.16
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-9,733,730.79	-12,122,701.44	-21,856,432.23
其中：1.基金申购款	201,071,418.43	137,521,082.67	338,592,501.10
2.基金赎回款	-210,805,149.22	-149,643,784.11	-360,448,933.33
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-7,266,585.87	-7,266,585.87
五、期末所有者权益(基金净值)	112,448,859.42	107,614,530.59	220,063,390.01
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	109,198,256.09	69,032,712.33	178,230,968.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	43,451,252.78	43,451,252.78
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	12,984,334.12	15,742,290.10	28,726,624.22
其中：1.基金申购款	97,686,707.95	83,574,599.32	181,261,307.27
2.基金赎回款	-84,702,373.83	-67,832,309.22	-152,534,683.05
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值	-	-6,029,209.47	-6,029,209.47

减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	122,182,590.21	122,197,045.74	244,379,635.95

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：

谭晓冈	周立新	刘亚林
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

大成标普 500 等权重指数证券投资基金(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[2010]第 1876 号《关于核准大成标普 500 等权重指数证券投资基金募集的批复》核准，由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，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 822,469,878.87 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 091 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同》于 2011 年 3 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 822,754,222.26 份基金份额，其中认购资金利息折合 284,343.39 份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司，境外资产托管人为中国银行(香港)有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为标普 500 等权重指数成份股、备选成份股，与标普 500 等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金、结构性产品等，固定收益类证券、银行存款、现金等货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他产品或金融工具。本基金投资于标普 500 等权重指数成份股、备选成份股以及与标普 500 等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例为基金资产净值的 80%-95%，其中投资于与标普 500 等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例不超过 10%；投资于现金、银行存款、固定收益类证券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具的比例为基金资产净值的 5%-20%，其中投资于现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：标普 500 等权重指数(全收益指数)。

本财务报表由本基金的基金管理人大成基金管理有限公司于 2021 年 3 月 29 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》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同》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 2020 年度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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值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。

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

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，以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。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金

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。本基金持有的其他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。

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于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益。应收款项和其他金融负债的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。

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

本基金持有的股票投资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。

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基金净值比例计算的金额。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基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，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股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。

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。

其他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，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的

未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

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[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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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 2018 年 1 月 1 日起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。

(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。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	14,491,186.45	27,739,881.45
定期存款	-	-
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	-	-
合计	14,491,186.45	27,739,881.45

注：于本期末，活期存款中包括的外币余额为美元活期存款 1,039,070.10 元，折合人民币 6,779,828.50 元(上年度末：活期存款中包括的外币余额为美元活期存款 3,069,225.58 元，折合人民币 21,411,531.49 元)。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		176,469,535.15	208,686,583.77	32,217,048.62
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		176,469,535.15	208,686,583.77	32,217,048.62
项目		上年度末 2019 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		197,002,536.95	229,997,351.38	32,994,814.43
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		197,002,536.95	229,997,351.38	32,994,814.43

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	423.34	1,894.25
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	-	-
合计	423.34	1,894.25

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
其他应收款	-	-
待摊费用	196,351.92	-
合计	196,351.92	-

7.4.7.7 应付交易费用

无。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	12,366.83	6,337.01

应付证券出借违约金	-	-
预提费用	180,000.00	508,997.91
其他	2,177.69	340.58
合计	194,544.52	515,675.50

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	122,182,590.21	122,182,590.21
本期申购	201,071,418.43	201,071,418.43
本期赎回（以“-”号填列）	-210,805,149.22	-210,805,149.22
- 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	112,448,859.42	112,448,859.42

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

7.4.7.10 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	70,433,834.44	51,763,211.30	122,197,045.74
本期利润	5,584,537.97	-777,765.81	4,806,772.16
本期基金份额交易产生的变动数	-6,101,109.49	-6,021,591.95	-12,122,701.44
其中：基金申购款	101,992,374.61	35,528,708.06	137,521,082.67
基金赎回款	-108,093,484.10	-41,550,300.01	-149,643,784.11
本期已分配利润	-7,266,585.87	-	-7,266,585.87
本期末	62,650,677.05	44,963,853.54	107,614,530.59

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	46,012.57	46,967.27
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	83.64	-
合计	46,096.21	46,967.27

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出股票成交总额	147,869,045.25	67,586,375.54
减:卖出股票成本总额	143,120,281.61	62,200,108.55
买卖股票差价收入	4,748,763.64	5,386,266.99

7.4.7.13 基金投资收益

无。

7.4.7.14 债券投资收益

无。

7.4.7.15 贵金属投资收益

无。

7.4.7.16 衍生工具收益

无。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	4,553,900.66	3,328,396.38
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	4,553,900.66	3,328,396.38

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
1.交易性金融资产	-777,765.81	37,835,974.25

股票投资	-777,765.81	37,835,974.25
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	-	-
权证投资	-	-
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	-777,765.81	37,835,974.25

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	441,938.26	152,242.95
合计	441,938.26	152,242.95

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25%归入基金资产。

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	84,403.98	45,088.15
银行间市场交易费用	-	-
合计	84,403.98	45,088.15

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	12,425.31	9,361.20
指数使用费	211,630.16	564,968.71
其他	2,128.08	2,059.47
合计	406,183.55	746,389.38

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数数据使用费及标的指数许可使用费，其中标的指数数据使用费按每年 8,000 美元收取，按年支付；标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的 0.03%的年费率计提，逐日累计，按年支付，标的指数许可使用费的收取下限为每年 25,000.00 美元。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2021 年 1 月 14 日宣告 2020 年度第 1 次分红，向截至 2021 年 1 月 18 日止在本基金注册登记人大成基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.5580 元。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
大成创新资本管理有限公司（“大成创新资本”）	基金管理人的合营企业
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
中国银行（香港）有限公司（“中国香港”）	境外资产托管人
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
大成国际资产管理有限公司（“大成国际”）	基金管理人的子公司

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

无。

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 基金交易

无。

7.4.10.1.5 权证交易

无。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,265,819.16	1,840,433.06
其中：支付销售机构的客户维护费	917,176.36	744,466.13

注：支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

当期发生的基金应支付的托管费	566,454.83	460,108.32

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%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　×　0.25%　/ 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	7,711,770.39	46,012.57	6,328,723.88	46,967.27
中银香港	6,779,416.06	-	21,411,157.57	

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，存放于基金托管人的银行存款按银行同业利率计息，存放于境外资产托管人的银行存款不计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2020 年 01 月 17 日	-	2020 年 1 月 16 日	0.580	2,487,553.99	4,779,031.88	7,266,585.87	-
合计	-	-	-	0.580	2,487,553.99	4,779,031.88	7,266,585.87	-

7.4.12 期末(2020 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

无

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，跟踪标的指数市场表现，目标为获取市场平均收益，属于中高风险品

种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控(合规与风险管理委员会、公司投资风险控制委员会)、专业监控(监察稽核部、风险管理部)、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。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，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行；在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会；在业务操作层面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。

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

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，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中国银行及境外次托管人中银香港，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在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，违约风险可能性很小；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，且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(上年度末：同)。

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。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。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未超过 15%。

本基金主要投资于交易所及银行间市场内交易的证券，除在附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(如有)，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

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。

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,711,770.39	-	-	6,779,416.06	14,491,186.45
交易性金融资产	-	-	-	208,686,583.77	208,686,583.77
应收利息	-	-	-	423.34	423.34
应收股利	-	-	-	253,532.40	253,532.40
应收申购款	-	-	-	856,800.52	856,800.52
其他资产	-	-	-	196,351.92	196,351.92
资产总计	7,711,770.39	-	-	216,773,108.01	224,484,878.40
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,992,648.84	3,992,648.84
应付管理人报酬	-	-	-	187,436.06	187,436.06
应付托管费	-	-	-	46,858.97	46,858.97
其他负债	-	-	-	194,544.52	194,544.52
负债总计	-	-	-	4,421,488.39	4,421,488.39
利率敏感度缺口	7,711,770.39		-	212,351,619.62	220,063,390.01
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	6,328,723.88	-	-	21,411,157.57	27,739,881.45
交易性金融资产	-	-	-	229,997,351.38	229,997,351.38
应收利息	-	-	-	1,894.25	1,894.25
应收股利	-	-	-	331,834.25	331,834.25
应收申购款	-	-	-	3,139,760.29	3,139,760.29
资产总计	6,328,723.88	-	-	254,881,997.74	261,210,721.62
负债					

应付赎回款	-	-	-	2,096,012.89	2,096,012.89
应付管理人报酬	-	-	-	191,042.99	191,042.99
应付托管费	-	-	-	47,760.75	47,760.75
应付证券清算款	-	-	-	13,980,593.54	13,980,593.54
其他负债	-	-	-	515,675.50	515,675.50
负债总计	-	-	-	16,831,085.67	16,831,085.67
利率敏感度缺口	6,328,723.88	-	-	238,050,912.07	244,379,635.95

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

于本期末，本基金未持有交易性债券投资(上年度末：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年度末：同)。

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和负债，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 2020 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	6,779,828.50	-	-	6,779,828.50
交易性金融资产	208,686,583.77	-	-	208,686,583.77
应收股利	253,532.40	-	-	253,532.40
应收利息	1.83	-	-	1.83
资产合计	215,719,9	-	-	215,719,946.50

	46.50			
以外币计价的负债				
其他负债	2,177.69	-	-	2,177.69
负债合计	2,177.69	-	-	2,177.69
资产负债表外汇风险敞口净额	215,717,768.81	-	-	215,717,768.81
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	21,411,531.49	-	-	21,411,531.49
交易性金融资产	229,997,351.38	-	-	229,997,351.38
应收股利	331,834.25	-	-	331,834.25
资产合计	251,740,717.12	-	-	251,740,717.12
以外币计价的负债				
应付证券清算款	13,980,593.54	-	-	13,980,593.54
其他负债	340.58	-	-	340.58
负债合计	13,980,934.12	-	-	13,980,934.12
资产负债表外汇风险敞口净额	237,759,783.00	-	-	237,759,783.00

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

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

	动	影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020 年 12 月 31 日）	上年度末 （2019 年 12 月 31 日 ）
分析	美元相对人民币升值 5%	10,785,888.44	11,887,989.15
	美元相对人民币贬值 5%	-10,785,888.44	-11,887,989.15

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或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于标普 500 等权重指数成份股、备选成份股以及与标普 500 等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例为基金资产净值的 80%-95%，其中投资于与标普 500 等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例不超过 10%；投资于现金、银行存款、固定收益类证券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具的比例为基金资产净值的 5%-20%，其中投资于现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。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，包括 VaR(Value at Risk)指标等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

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019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	208,686,583.77	94.83	229,997,351.38	94.11
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	208,686,583.77	94.83	229,997,351.38	94.11

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		
	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（2020年12月31日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	10,417,531.48	11,545,951.86
	业绩比较基准下降5%	-10,417,531.48	-11,545,951.86

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本期末，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中属于第一层次

的余额为 208,686,583.77 元，无属于第二或第三层次的余额(上年度末：第一层次 229,997,351.38 元，无第二或第三层次)。

(ii) 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，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，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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(上年度末：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	208,686,583.77	92.96
	其中：普通股	208,686,583.77	92.96
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
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	14,491,186.45	6.46
8	其他各项资产	1,307,108.18	0.58
9	合计	224,484,878.40	100.00

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
美国	208,686,583.77	94.83
合计	208,686,583.77	94.83

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

8.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
金融	28,056,056.28	12.75
通信服务	9,196,859.29	4.18
房地产	12,250,296.23	5.57
能源	9,672,150.61	4.40
公用事业	11,303,648.79	5.14
非日常生活消费品	25,752,589.90	11.70
工业	30,022,934.43	13.64
日常消费品	12,974,588.23	5.90
信息技术	31,053,125.28	14.11
医疗保健	26,578,056.50	12.08
原材料	11,771,431.49	5.35
合计	208,631,737.03	94.81

8.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
金融	-	-
通信服务	-	-
房地产	54,846.74	0.02
能源	-	-
公用事业	-	-
非日常生活消费品	-	-
工业	-	-
日常消费品	-	-
信息技术	-	-

医疗保健	-	-
原材料	-	-
合计	54,846.74	0.02

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

8.4.1 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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	亚力兄制药公司	ALXN UQ	纳斯达克证券交易所	美国	524	534,192.00	0.24
2	ABIOMED INC	Abiomed股份有限公司	ABMD UQ	纳斯达克证券交易所	美国	243	514,035.54	0.23
3	AON PLC-CLASS A	Aon PLC	AON UN	美国纽约证券	美国	371	511,429.30	0.23

				交易所				
4	FIRST REPUBLIC BANK/CA	第一共和银行/加州旧金山	FRC UN	美国纽约证券交易所	美国	523	501,401.96	0.23
5	QORVO INC	Qorvo股份有限公司	QRVO UQ	纳斯达克证券交易所	美国	449	487,117.91	0.22
6	SYNCHRONY FINANCIAL	同步金融公司	SYF UN	美国纽约证券交易所	美国	2,143	485,345.09	0.22
7	AUTODESK INC	欧特克	ADSK UQ	纳斯达克证券交易所	美国	243	484,132.05	0.22

8	ROSS STORES INC	Ross 商店有限公司	ROST UQ	纳斯达克证券交易所	美国	603	483,197.75	0.22
9	MORGAN STANLEY	摩根士丹利	MS UN	美国纽约证券交易所	美国	1,075	480,687.75	0.22
10	DAVITA INC	DaVita股份有限公司	DVA UN	美国纽约证券交易所	美国	627	480,296.58	0.22
11	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE INC	Take-Two互动软件股份有限公司	TTWO UQ	纳斯达克证券交易所	美国	352	477,244.76	0.22
12	AES CORP	爱伊斯	AES UN	美国纽约	美国	3,105	476,105.64	0.22

				证券交易所				
13	DXC TECHNOLOGY CO	DXC技术公司	DXC UN	美国纽约证券交易所	美国	2,827	474,981.73	0.22
14	CADENCE DESIGN SYS INC	Cadence 设计系统股份有限公司	CDNS UQ	纳斯达克证券交易所	美国	533	474,472.39	0.22
15	TESLA INC	特斯拉公司	TSLA UQ	纳斯达克证券交易所	美国	103	474,255.90	0.22
16	GOLDMAN SACHS GROUP INC	高盛	GS UN	美国纽约证券交易	美国	275	473,187.38	0.22

				所				
17	MSCI INC	MSCI 明晟	MSCI UN	美国纽约证券交易所	美国	162	471,997.30	0.21
18	FORTINET INC	飞塔股份有限公司	FTNT UQ	纳斯达克证券交易所	美国	480	465,188.83	0.21
19	ALASKA AIR GROUP INC	阿拉斯加航空集团公司	ALK UN	美国纽约证券交易所	美国	1,370	464,833.88	0.21
20	FLIR SYSTEMS INC	FLIR系统公司	FLIR UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,615	461,867.98	0.21
21	ANTHEM INC	Anthem股份有限公司	ANTM	美国	美国	220	460,917.63	0.21

			UN	纽约证券交易所				
22	INTERNATIONAL PAPER CO	国际纸业	IP UN	美国纽约证券交易所	美国	1,420	460,673.60	0.21
23	LOEWS CORP	罗斯	L UN	美国纽约证券交易所	美国	1,567	460,307.81	0.21
24	HP INC	惠普	HPQ UN	美国纽约证券交易所	美国	2,866	459,841.94	0.21
25	GLOBAL PAYMENTS INC	环汇有限公司	GPN UN	美国纽约证券	美国	327	459,629.22	0.21

				交易所				
26	ULTA BEAUTY INC	Ulta美容产品公司	ULTA UQ	纳斯达克证券交易所	美国	245	459,054.12	0.21
27	VIACOMCBS INC - CLASS B	维亚康姆哥伦比亚广播公司	VIAC UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,888	459,006.36	0.21
28	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	Raymond James 金融股份有限公	RJF UN	美国纽约证券交易所	美国	735	458,814.33	0.21
29	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	希尔顿全球控股股份有限公司	HLT UN	美国纽约证券交易所	美国	632	458,806.96	0.21

30	PAYPAL HOLDINGS INC	Paypal控股股份有限公司	PYPL UQ	纳斯达克证券交易所	美国	300	458,439.47	0.21
31	AVERY DENNISON CORP	艾利丹尼森	AVY UN	美国纽约证券交易所	美国	452	457,458.91	0.21
32	SYNOPSYS INC	新思科技公司	SNPS UQ	纳斯达克证券交易所	美国	270	456,709.07	0.21
33	INGERSOLL-RAND INC	英格索兰股份有限公司	IR UN	美国纽约证券交易所	美国	1,536	456,613.55	0.21
34	GARTNER INC	高德纳咨询股份有限公司	IT UN	美国纽约	美国	436	455,717.55	0.21

				证券交易所				
35	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	Live Nation 娱乐公司	LYV UN	美国纽约证券交易所	美国	948	454,518.27	0.21
36	MARKETAXESS HOLDINGS INC	MarketAxess 控股公司	MKTX UQ	纳斯达克证券交易所	美国	122	454,187.33	0.21
37	CATALENT INC	康泰伦特股份有限公司	CTLT UN	美国纽约证券交易所	美国	668	453,602.96	0.21
38	JPMORGAN CHASE & CO	摩根大通	JPM UN	美国纽约证券交易	美国	547	453,528.12	0.21

				所				
39	MOSAIC CO/THE	Mosaic 公司	MOS UN	美国纽约证券交易所	美国	3,019	453,266.47	0.21
40	SVB FINANCIAL GROUP	硅谷银行金融集团	SIVB UQ	纳斯达克证券交易所	美国	179	452,968.80	0.21
41	Pool Corp	Pool 公司	POOL UQ	纳斯达克证券交易所	美国	186	452,077.70	0.21
42	AMERIPRISE FINANCIAL INC	阿默普莱斯金融公司	AMP UN	美国纽约证券交易所	美国	356	451,402.24	0.21
43	M & T BANK CORP	M&T 银行	MTB UN	美国	美国	543	451,026.54	0.20

				纽约证券交易所				
44	US BANCORP	美国合众银行	USB UN	美国纽约证券交易所	美国	1,483	450,824.72	0.20
45	TRAVELERS COS INC/THE	St Paul Travelers	TRV UN	美国纽约证券交易所	美国	492	450,622.90	0.20
46	TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	Teledyne科技股份有限公司	TDY UN	美国纽约证券交易所	美国	176	450,142.93	0.20
47	Viatris Inc	Viatris公司	VTRS UQ	纳斯达克证券	美国	3,681	450,100.26	0.20

				交易所				
48	DEERE & CO	迪尔	DE UN	美国纽约证券交易所	美国	256	449,414.23	0.20
49	COPART INC	Copart 股份有限公司	CPRT UQ	纳斯达克证券交易所	美国	541	449,188.80	0.20
50	NIELSEN HOLDINGS PLC	尼尔森控股公开有限公司	NLSN UN	美国纽约证券交易所	美国	3,293	448,423.17	0.20
51	WELLS FARGO & CO	富国银行	WFC UN	美国纽约证券交易所	美国	2,277	448,390.21	0.20

52	EDISON INTERNATIONAL	爱迪生国际	EIX UN	美国纽约证券交易所	美国	1,091	447,194.59	0.20
53	MASTERCARD INC - A	万事达股份有限公司	MA UN	美国纽约证券交易所	美国	192	447,167.58	0.20
54	TRANE TECHNOLOGIES PLC	特灵科技公共有限公司	TT UN	美国纽约证券交易所	美国	472	447,056.92	0.20
55	IDEXX LABORATORIES INC	爱德士股份有限公司	IDXX UQ	纳斯达克证券交易所	美国	137	446,839.44	0.20
56	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	雅诗兰黛	EL UN	美国纽约	美国	257	446,373.82	0.20

				证券交易所				
57	TE CONNECTIVITY LTD	泰科电子公司	TEL UN	美国纽约证券交易所	美国	565	446,332.85	0.20
58	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	捷迈邦美控股股份有限公司	ZBH UN	美国纽约证券交易所	美国	443	445,401.88	0.20
59	WESTERN DIGITAL CORP	西部数据公司	WDC UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,231	444,900.89	0.20
60	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	Discover金融服务公司	DFS UN	美国纽约证券交易	美国	753	444,796.50	0.20

				所				
61	HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	哈特福德金融服务	HIG UN	美国纽约证券交易所	美国	1,390	444,229.55	0.20
62	CBOE GLOBAL MARKETS INC	Cboe 环球市场公司	CBOE UF	巴兹全球市场	美国	731	444,154.64	0.20
63	CHUBB LTD	安达保险有限公司	CB UN	美国纽约证券交易所	美国	442	443,906.17	0.20
64	STARBUCKS CORP	星巴克	SBUX UQ	纳斯达克证券交易所	美国	635	443,251.46	0.20
65	HOWMET AEROSPACE INC	Howmet 航空航天股份有限公司	HWM UN	美国纽约证	美国	2,379	443,018.92	0.20

				券交易所				
66	AMPHENOL CORP-CL A	安费诺公司	APH UN	美国纽约证券交易所	美国	519	442,842.55	0.20
67	CIGNA CORP	信诺集团	CI UN	美国纽约证券交易所	美国	326	442,823.30	0.20
68	HCA HEALTHCARE INC	HCA医疗保健有限公司	HCA UN	美国纽约证券交易所	美国	412	442,111.04	0.20
69	ILLUMINA INC	Illumina公司	ILMN UQ	纳斯达克证券交易所	美国	183	441,800.98	0.20

70	SERVICENOW INC	ServiceNow公司	NOW UN	美国纽约证券交易所	美国	123	441,754.59	0.20
71	PHILLIPS 66	Phillips 66	PSX UN	美国纽约证券交易所	美国	968	441,748.26	0.20
72	CARNIVAL CORP	嘉年华公司	CCL UN	美国纽约证券交易所	美国	3,125	441,654.17	0.20
73	EXPEDIA GROUP INC	亿客行集团股份有限公司	EXPE UQ	纳斯达克证券交易所	美国	511	441,451.24	0.20
74	LEGGETT & PLATT INC	礼恩派	LEG UN	美国纽	美国	1,527	441,384.04	0.20

				约证券交易所				
75	LAMB WESTON HOLDINGS INC	蓝威斯顿控股股份有限公司	LW UN	美国纽约证券交易所	美国	859	441,328.97	0.20
76	FISERV INC	Fiserv公司	FISV UQ	纳斯达克证券交易所	美国	594	441,297.52	0.20
77	TEXTRON INC	德事隆	TXT UN	美国纽约证券交易所	美国	1,398	440,857.09	0.20
78	AFLAC INC	家庭人寿保险	AFL UN	美国纽约证券交	美国	1,519	440,756.54	0.20

				易所				
79	TELEFLEX INC	泰利福公司	TFX UN	美国纽约证券交易所	美国	164	440,414.31	0.20
80	SCHWAB (CHARLES) CORP	嘉信理财	SCHW UN	美国纽约证券交易所	美国	1,272	440,214.65	0.20
81	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	西氏医药服务公司	WST UN	美国纽约证券交易所	美国	238	439,959.52	0.20
82	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	第一资本金融	COF UN	美国纽约证券交易所	美国	682	439,880.70	0.20
8	NETAPP INC	网域存储技术	NTA	纳	美	1,0	439,55	0.2

3			PUQ	斯达克证券交易所	国	17	6.94	0
84	DENTSPLY SIRONA INC	登士柏西诺德公司	XRAYUQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,286	439,353.88	0.20
85	CELANESE CORP	塞拉尼斯公司	CEUN	美国纽约证券交易所	美国	518	439,183.97	0.20
86	PERKINELMER INC	珀金埃尔默	PKIUN	美国纽约证券交易所	美国	469	439,135.56	0.20
87	BOSTON SCIENTIFIC CORP	波士顿科学	BSXUN	美国纽约证	美国	1,871	438,880.76	0.20

				券交易所				
88	DIGITAL REALTY TRUST INC	数字房地产信托有限公司	DLR UN	美国纽约证券交易所	美国	482	438,759.20	0.20
89	INCYTE CORP	因赛特公司	INCY UQ	纳斯达克证券交易所	美国	773	438,705.17	0.20
90	COOPER COS INC/THE	库柏股份有限公司	COO UN	美国纽约证券交易所	美国	185	438,565.93	0.20
91	ARTHUR J GALLAGHER & CO	亚瑟加拉格尔有限公司	AJG UN	美国纽约证券交易所	美国	543	438,307.09	0.20

92	ALLSTATE CORP	全州保险	ALL UN	美国纽约证券交易所	美国	611	438,259.46	0.20
93	XEROX HOLDINGS CORP	Xerox Holdings Corp	XRX UN	美国纽约证券交易所	美国	2,896	438,200.80	0.20
94	FRANKLIN RESOURCES INC	富兰克林资源	BEN UN	美国纽约证券交易所	美国	2,687	438,134.83	0.20
95	IPG PHOTONICS CORP	IPG光子公司	IPGP UQ	纳斯达克证券交易所	美国	300	438,062.21	0.20
96	WATERS CORP	沃特世公司	WAT UN	美国纽	美国	271	437,499.90	0.20

				约证券交易所				
97	ROLLINS INC	Rollins公司	ROLUN	美国纽约证券交易所	美国	1,715	437,201.25	0.20
98	BROADCOM INC	博通股份有限公司	AVGOUQ	纳斯达克证券交易所	美国	153	437,109.90	0.20
99	MICRON TECHNOLOGY INC	美光科技股份有限公司	MUUQ	纳斯达克证券交易所	美国	891	437,072.91	0.20
100	APTIV PLC	Aptiv公共有限公司	APTVUN	美国纽约证券交	美国	514	436,966.42	0.20

				易所				
101	PAYCOM SOFTWARE INC	Paycom软件股份有限公司	PAYC UN	美国纽约证券交易所	美国	148	436,731.13	0.20
102	STRYKER CORP	史赛克	SYK UN	美国纽约证券交易所	美国	273	436,489.19	0.20
103	ALBEMARLE CORP	雅保公司	ALB UN	美国纽约证券交易所	美国	453	436,036.62	0.20
104	BOOKING HOLDINGS INC	Booking控股股份有限公司	BKNG UQ	纳斯达克证券交易所	美国	30	435,981.42	0.20
1	T-MOBILE US INC	T-Mobile US有限公	TMU	纳	美	495	435,54	0.2

05		司	SUQ	斯达克证券交易所	国		1.97	0
106	RESMED INC	瑞思迈股份有限公司	RMD UN	美国纽约证券交易所	美国	314	435,496.88	0.20
107	MARTIN MARIETTA MATERIALS	Martin Marietta 材料股份有限	MLM UN	美国纽约证券交易所	美国	235	435,425.83	0.20
108	LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV_CL A	利安德巴塞尔工业公司	LYB UN	美国纽约证券交易所	美国	728	435,396.66	0.20
109	NORTONLIFELOCK INC	诺顿LifeLock股份有限公司	NLOK UQ	纳斯达克证	美国	3,210	435,235.62	0.20

				券交易所				
110	LEIDOS HOLDINGS INC	Leidos控股公司	LDOS UN	美国纽约证券交易所	美国	634	434,859.01	0.20
111	COMERICA INC	Comerica 公司	CMA UN	美国纽约证券交易所	美国	1,193	434,825.73	0.20
112	TAPESTRY INC	TPR-DRS-RS	TPR UN	美国纽约证券交易所	美国	2,144	434,790.10	0.20
113	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	Chipotle Mexican Grill 股份	CMG UN	美国纽约证券交易所	美国	48	434,310.92	0.20

114	DEXCOM INC	DexCom股份有限公司	DXCM UQ	纳斯达克证券交易所	美国	180	434,229.49	0.20
115	BORGWARNER INC	博格华纳股份有限公司	BWA UN	美国纽约证券交易所	美国	1,722	434,154.32	0.20
116	FREEPORT-MCMORAN INC	自由港迈克墨伦股份有限公司	FCX UN	美国纽约证券交易所	美国	2,555	433,782.53	0.20
117	INTUIT INC	Intuit 公司	INTU UQ	纳斯达克证券交易所	美国	175	433,734.57	0.20
118	XYLEM INC	Xylem公司/纽约	XYL UN	美国纽	美国	653	433,702.73	0.20

				约证券交易所				
119	MOODY'S CORP	穆迪	MCO UN	美国纽约证券交易所	美国	229	433,677.22	0.20
120	ALLEGION PLC	安朗杰公共有限公司	ALLE UN	美国纽约证券交易所	美国	571	433,599.05	0.20
121	LINDE PLC	Linde PLC	LIN UN	美国纽约证券交易所	美国	252	433,282.85	0.20
122	ADVANCED MICRO DEVICES	AMD 公司	AMD UQ	纳斯达克证券交	美国	724	433,240.57	0.20

				易所				
123	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	高知特科技公司	CTSH UQ	纳斯达克证券交易所	美国	810	433,119.60	0.20
124	NASDAQ INC	纳斯达克股份有限公司	NDAQ UQ	纳斯达克证券交易所	美国	500	433,057.61	0.20
125	AGILENT TECHNOLOGIES INC	安捷伦	A UN	美国纽约证券交易所	美国	560	432,955.82	0.20
126	DARDEN RESTAURANTS INC	达登饭店	DRI UN	美国纽约证券交易所	美国	557	432,926.07	0.20
1	QUALCOMM INC	高通公司	QCO	纳	美	435	432,39	0.2

27			MUQ	斯达克证券交易所	国		1.42	0
128	ALIGN TECHNOLOGY INC	Align科技股份有限公司	ALGN UQ	纳斯达克证券交易所	美国	124	432,360.23	0.20
129	TRANSDIGM GROUP INC	TransDigm集团公司	TDG UN	美国纽约证券交易所	美国	107	432,058.98	0.20
130	NIKE INC -CL B	耐克公司	NKE UN	美国纽约证券交易所	美国	468	432,000.32	0.20
131	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	福泰制药	VRTX UQ	纳斯达克证	美国	280	431,786.56	0.20

				券交易所				
132	TWITTER INC	推特公司	TWTR UN	美国纽约证券交易所	美国	1,222	431,761.12	0.20
133	SOUTHWEST AIRLINES CO	西南航空	LUV UN	美国纽约证券交易所	美国	1,419	431,554.21	0.20
134	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	美信	MXIM UQ	纳斯达克证券交易所	美国	746	431,510.56	0.20
135	YUM! BRANDS INC	百胜全球餐饮	YUM UN	美国纽约证券交易所	美国	609	431,380.97	0.20

136	EXPEDITORS INTL WASH INC	华盛顿康捷国际物流公司	EXPD UQ	纳斯达克证券交易所	美国	695	431,305.35	0.20
137	GARMIN LTD	佳明有限公司	GRMN UQ	纳斯达克证券交易所	美国	552	430,984.78	0.20
138	TARGET CORP	塔吉特公司	TGT UN	美国纽约证券交易所	美国	374	430,788.38	0.20
139	VF CORP	VF公司	VFC UN	美国纽约证券交易所	美国	773	430,786.49	0.20
140	ADOBE INC	奥多比	ADBE UQ	纳斯达	美国	132	430,746.75	0.20

				克证券交易所				
141	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	信安金融	PFG UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,329	430,197.68	0.20
142	EXTRA SPACE STORAGE INC	额外空间仓储公司	EXR UN	美国纽约证券交易所	美国	569	430,149.73	0.20
143	NEWELL BRANDS INC	纽威尔品牌公司	NWL UQ	纳斯达克证券交易所	美国	3,104	429,977.34	0.20
144	LENNAR CORP-A	Lennar公司	LEN UN	美国纽约证券交	美国	864	429,747.66	0.20

				易所				
145	OMNICOM GROUP	奥姆尼康	OMC UN	美国纽约证券交易所	美国	1,056	429,747.66	0.20
146	PROGRESSIVE CORP	前进保险公司	PGR UN	美国纽约证券交易所	美国	666	429,691.29	0.20
147	CITIGROUP INC	花旗集团	C UN	美国纽约证券交易所	美国	1,068	429,683.46	0.20
148	ACTIVISION BLIZZARD INC	动视暴雪股份有限公司	ATVI UQ	纳斯达克证券交易所	美国	709	429,538.41	0.20
1	PUBLIC STORAGE	公共存储公司	PSA	美	美	285	429,43	0.2

49			UN	国纽约证券交易所	国		6.62	0
150	PENTAIR PLC	Pentair 公共有限公司	PNR UN	美国纽约证券交易所	美国	1,239	429,198.20	0.20
151	CVS HEALTH CORP	CVS 保健公司	CVS UN	美国纽约证券交易所	美国	963	429,161.60	0.20
152	ANALOG DEVICES INC	模拟器件	ADI UQ	纳斯达克证券交易所	美国	445	428,945.95	0.19
153	UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	Universal Health Services 公	UHS UN	美国纽约证	美国	478	428,849.05	0.19

				券交易所				
154	DUPONT DE NEMOURS INC	杜邦公司	DD UN	美国纽约证券交易所	美国	924	428,722.73	0.19
155	HANESBRANDS INC	汉佰有限公司	HBI UN	美国纽约证券交易所	美国	4,505	428,574.35	0.19
156	MOHAWK INDUSTRIES INC	Mohawk 工业股份有限公司	MHK UN	美国纽约证券交易所	美国	466	428,573.05	0.19
157	ARISTA NETWORKS INC	Arista 网络股份有限公司	ANET UN	美国纽约证券交易所	美国	226	428,482.48	0.19

158	MGM RESORTS INTERNATIONAL	美高梅国际酒店集团	MGM UN	美国纽约证券交易所	美国	2,084	428,469.56	0.19
159	HASBRO INC	孩之宝	HAS UQ	纳斯达克证券交易所	美国	702	428,458.08	0.19
160	ETSY INC	Etsy股份有限公司	ETSY UQ	纳斯达克证券交易所	美国	369	428,351.79	0.19
161	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	是德科技公司	KEYS UN	美国纽约证券交易所	美国	497	428,351.40	0.19
162	SOUTHERN CO/THE	南方公司	SO UN	美国纽	美国	1,068	428,080.68	0.19

				约证券交易所				
163	EQUIFAX INC	Equifax 公司	EFX UN	美国纽约证券交易所	美国	340	427,808.98	0.19
164	ZIONS BANCORP NA	ZB NA-用于基本面	ZION UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,509	427,713.46	0.19
165	AMETEK INC	阿美特克股份有限公司	AME UN	美国纽约证券交易所	美国	542	427,703.80	0.19
166	ELECTRONIC ARTS INC	电子艺界	EA UQ	纳斯达克证券交	美国	456	427,260.89	0.19

				易所				
167	APPLE INC	苹果公司	AAPL UQ	纳斯达克证券交易所	美国	493	426,833.97	0.19
168	BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	布朗福曼	BF/B UN	美国纽约证券交易所	美国	823	426,538.52	0.19
169	CATERPILLAR INC	卡特彼勒	CAT UN	美国纽约证券交易所	美国	359	426,370.76	0.19
170	EMERSON ELECTRIC CO	艾默生电气	EMR UN	美国纽约证券交易所	美国	813	426,342.25	0.19
1	TERADYNE INC	泰瑞达	TER	纳	美	545	426,33	0.1

71			UQ	斯达克证券交易所	国		7.29	9
172	REGENCY CENTERS CORP	Regency Centers 公司	REG UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,432	425,977.31	0.19
173	JACK HENRY & ASSOCIATES INC	Jack Henry & Associates 公司	JKHY UQ	纳斯达克证券交易所	美国	403	425,958.33	0.19
174	NRG ENERGY INC	NRG 能源股份有限公司	NRG UN	美国纽约证券交易所	美国	1,738	425,827.37	0.19
175	REGIONS FINANCIAL CORP	地区金融公司	RF UN	美国纽约证	美国	4,047	425,669.08	0.19

				券交易所				
176	ZOETIS INC	硕腾股份有限公司	ZTS UN	美国纽约证券交易所	美国	394	425,469.15	0.19
177	FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	FleetCor技术股份有限公司	FLT UN	美国纽约证券交易所	美国	239	425,465.04	0.19
178	WEYERHAEUSER CO	惠好	WY UN	美国纽约证券交易所	美国	1,944	425,308.12	0.19
179	TEXAS INSTRUMENTS INC	德州仪器	TXN UQ	纳斯达克证券交易所	美国	397	425,159.94	0.19

180	KEYCORP	KeyCorp 公司	KEY UN	美国纽约证券交易所	美国	3,970	425,082.23	0.19
181	EXELON CORP	Exelon 公司	EXC UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,543	425,067.61	0.19
182	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	纽约梅隆银行股份有限公司	BK UN	美国纽约证券交易所	美国	1,535	425,067.22	0.19
183	AMAZON.COM INC	亚马逊公司	AMZN UQ	纳斯达克证券交易所	美国	20	425,022.85	0.19
184	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	PNC 财务服务	PNC UN	美国纽	美国	437	424,855.81	0.19

				约证券交易所				
185	T ROWE PRICE GROUP INC	普信集团公司	TROW UQ	纳斯达克证券交易所	美国	430	424,755.98	0.19
186	GENUINE PARTS CO	原配部件	GPC UN	美国纽约证券交易所	美国	648	424,631.62	0.19
187	TJX COMPANIES INC	TJX公司	TJX UN	美国纽约证券交易所	美国	952	424,197.32	0.19
188	EQUINIX INC	Equinix有限公司	EQIX UQ	纳斯达克证券交	美国	91	424,055.73	0.19

				易所				
189	CSX CORP	CSX公司	CSX UQ	纳斯达克证券交易所	美国	716	423,968.43	0.19
190	VULCAN MATERIALS CO	Vulcan 材料	VMC UN	美国纽约证券交易所	美国	438	423,856.07	0.19
191	FORTIVE CORP	福迪威公司	FTV UN	美国纽约证券交易所	美国	917	423,739.66	0.19
192	BLACKROCK INC	贝莱德有限公司	BLK UN	美国纽约证券交易所	美国	90	423,717.87	0.19
1	DOLLAR TREE INC	Dollar Tree公司	DLT	纳	美	601	423,67	0.1

93			RUQ	斯达克证券交易所	国		5.07	9
194	HOLOGIC INC	豪洛捷公司	HOLXUQ	纳斯达克证券交易所	美国	891	423,410.74	0.19
195	JACOBS ENGINEERING GROUP INC	雅各布工程集团	JUN	美国纽约证券交易所	美国	595	423,017.10	0.19
196	COMCAST CORP-CLASS A	康卡斯特	CMCSAUQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,237	422,936.19	0.19
197	MCDONALD'S CORP	麦当劳	MCDUN	美国纽约证	美国	302	422,834.14	0.19

				券交易所				
198	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	洲际交易所（ICE）	ICE UN	美国纽约证券交易所	美国	562	422,767.72	0.19
199	EATON CORP PLC	伊顿	ETN UN	美国纽约证券交易所	美国	539	422,522.90	0.19
200	FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY	Fortune Brands 家居与安全有限	FBHS UN	美国纽约证券交易所	美国	755	422,282.39	0.19
201	AMCOR PLC	Amcor PLC	AMCR UN	美国纽约证券交易所	美国	5,497	422,159.01	0.19

202	JOHNSON & JOHNSON	强生	JNJ UN	美国纽约证券交易所	美国	411	422,051.28	0.19
203	WALT DISNEY CO/THE	华特迪士尼公司	DIS UN	美国纽约证券交易所	美国	357	422,038.75	0.19
204	WILLIS TOWERS WATSON PLC	韦莱韬睿惠悦公共有限公司	WLTW UQ	纳斯达克证券交易所	美国	307	422,022.44	0.19
205	REALTY INCOME CORP	Realty Income公司	O UN	美国纽约证券交易所	美国	1,040	421,879.15	0.19
206	ABBVIE INC	艾伯维生物制药公司	ABBV UN	美国纽	美国	603	421,583.25	0.19

				约证券交易所				
207	CMS ENERGY CORP	CMS 能源	CMS UN	美国纽约证券交易所	美国	1,059	421,571.11	0.19
208	COCA-COLA CO/THE	可口可乐	KO UN	美国纽约证券交易所	美国	1,178	421,518.46	0.19
209	JUNIPER NETWORKS INC	瞻博网络股份有限公司	JNPR UN	美国纽约证券交易所	美国	2,869	421,385.81	0.19
210	AMERICAN EXPRESS CO	美国运通	AXP UN	美国纽约证券交	美国	534	421,286.30	0.19

				易所				
211	SYSCO CORP	Sysco 公司	SYY UN	美国纽约证券交易所	美国	869	421,064.46	0.19
212	MCKESSON CORP	McKesson 公司	MCK UN	美国纽约证券交易所	美国	371	421,014.74	0.19
213	SEALED AIR CORP	希悦尔包装	SEE UN	美国纽约证券交易所	美国	1,409	420,974.22	0.19
214	MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	万豪国际	MAR UQ	纳斯达克证券交易所	美国	489	420,913.99	0.19
2	XCEL ENERGY INC	Xcel 能源	XEL	纳	美	967	420,65	0.1

15			UQ	斯达克证券交易所	国		9.59	9
216	NORTHERN TRUST CORP	北美信托	NTRS UQ	纳斯达克证券交易所	美国	692	420,548.60	0.19
217	CDW CORP/DE	特拉华CDW公司	CDW UQ	纳斯达克证券交易所	美国	489	420,499.20	0.19
218	STERIS PLC	STERIS PLC	STE UN	美国纽约证券交易所	美国	340	420,488.05	0.19
219	GLOBE LIFE INC	Globe Life股份有限公司	GL UN	美国纽约证	美国	678	420,091.85	0.19

				券交易所				
220	BANK OF AMERICA CORP	美国银行控股公司	BAC UN	美国纽约证券交易所	美国	2,124	420,062.88	0.19
221	MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	味好美股份有限公司/马里兰州	MKC UN	美国纽约证券交易所	美国	673	419,804.24	0.19
222	SBA COMMUNICATIONS CORP	SBA 通信公司	SBA C UQ	纳斯达克证券交易所	美国	228	419,718.37	0.19
223	EBAY INC	eBay 公司	EBA Y UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,280	419,681.57	0.19

224	RALPH LAUREN CORP	Ralph Lauren公司	RL UN	美国纽约证券交易所	美国	620	419,673.74	0.19
225	IHS MARKIT LTD	IHS Markit有限公司	INFO UN	美国纽约证券交易所	美国	716	419,670.35	0.19
226	PROLOGIS INC	安博	PLD UN	美国纽约证券交易所	美国	645	419,425.14	0.19
227	ABBOTT LABORATORIES	雅培制药	ABT UN	美国纽约证券交易所	美国	587	419,359.43	0.19
228	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	空气产品公司	APD UN	美国纽	美国	235	418,942.30	0.19

				约证券交易所				
229	AMERICAN TOWER CORP	美国发射塔公司	AMT UN	美国纽约证券交易所	美国	286	418,869.61	0.19
230	UNITEDHEALTH GROUP INC	联合健康	UNH UN	美国纽约证券交易所	美国	183	418,731.80	0.19
231	WASTE MANAGEMENT INC	废品管理	WM UN	美国纽约证券交易所	美国	544	418,597.91	0.19
232	HERSHEY CO/THE	好时食品	HSY UN	美国纽约证券交	美国	421	418,447.91	0.19

				易所				
233	TRUIST FINANCIAL CORP	Truist金融公司	TFC UN	美国纽约证券交易所	美国	1,337	418,131.32	0.19
234	F5 NETWORKS INC	F5 Networks公司	FFIV UQ	纳斯达克证券交易所	美国	364	417,868.69	0.19
235	PULTEGROUP INC	Pulte集团公司	PHM UN	美国纽约证券交易所	美国	1,485	417,810.23	0.19
236	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	亿滋国际	MDLZ UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,095	417,754.44	0.19
2	AUTOZONE INC	AutoZone公司	AZO	美	美	54	417,68	0.1

37			UN	国纽约证券交易所	国		3.38	9
238	SNAP-ON INC	Snap-On 公司	SNA UN	美国纽约证券交易所	美国	374	417,635.10	0.19
239	PROCTER & GAMBLE CO/THE	宝洁	PG UN	美国纽约证券交易所	美国	460	417,622.31	0.19
240	KIMCO REALTY CORP	Kimco房地产公司	KIM UN	美国纽约证券交易所	美国	4,264	417,610.83	0.19
241	RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	雷神技术公司	RTX UN	美国纽约证	美国	895	417,603.06	0.19

				券交易所				
242	CONSTELLATION BRANDS INC-A	星座公司	STZ UN	美国纽约证券交易所	美国	292	417,349.57	0.19
243	NEWMONT CORP	纽蒙公司	NEM UN	美国纽约证券交易所	美国	1,068	417,349.05	0.19
244	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	宣威威廉斯	SHW UN	美国纽约证券交易所	美国	87	417,183.64	0.19
245	HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE INC	Huntington Ingalls工业公司	HII UN	美国纽约证券交易所	美国	375	417,136.86	0.19

246	LOWE'S COS INC	劳氏	LOW UN	美国纽约证券交易所	美国	398	416,830.06	0.19
247	WYNN RESORTS LTD	永利渡假村有限公司	WYNN UQ	纳斯达克证券交易所	美国	566	416,691.73	0.19
248	CHURCH & DWIGHT CO INC	切迟杜威股份有限公司	CHD UN	美国纽约证券交易所	美国	732	416,630.26	0.19
249	PACKAGING CORP OF AMERICA	美国包装公司	PKG UN	美国纽约证券交易所	美国	463	416,630.07	0.19
250	CARRIER GLOBAL CORP	Carrier Global Corp	CARR UN	美国纽	美国	1,692	416,433.73	0.19

				约证券交易所				
251	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	梅特勒-托利多国际股份有限公	MTD UN	美国纽约证券交易所	美国	56	416,432.69	0.19
252	INTUITIVE SURGICAL INC	直觉外科手术公司	ISRG UQ	纳斯达克证券交易所	美国	78	416,365.61	0.19
253	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	斑马技术公司	ZBRA UQ	纳斯达克证券交易所	美国	166	416,280.66	0.19
254	AUTOMATIC DATA PROCESSING	ADP公司	ADP UQ	纳斯达克证券交	美国	362	416,186.83	0.19

				易所				
255	TIFFANY & CO	蒂芙尼	TIF UN	美国纽约证券交易所	美国	485	415,983.58	0.19
256	REPUBLIC SERVICES INC	公共服务公司	RSG UN	美国纽约证券交易所	美国	662	415,966.29	0.19
257	PAYCHEX INC	Paychex 公司	PAYX UQ	纳斯达克证券交易所	美国	684	415,865.28	0.19
258	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	阿卡迈技术公司	AKAM UQ	纳斯达克证券交易所	美国	607	415,824.90	0.19
2	KROGER CO	克罗格公司	KR	美	美	2,0	415,70	0.1

59			UN	国纽约证券交易所	国	06	5.03	9
260	NORTHROP GRUMMAN CORP	诺斯洛普格鲁门公司	NOC UN	美国纽约证券交易所	美国	209	415,547.91	0.19
261	TRACTOR SUPPLY COMPANY	拖拉机供应公司	TSCO UQ	纳斯达克证券交易所	美国	453	415,523.51	0.19
262	BIOGEN INC	百健	BIIB UQ	纳斯达克证券交易所	美国	260	415,398.62	0.19
263	MARSH & MCLENNAN COS	Marsh & McLennan 股份有限公司	MMC UN	美国纽约证	美国	544	415,296.84	0.19

				券交易所				
264	CITIZENS FINANCIAL GROUP	公民金融集团	CFG UN	美国纽约证券交易所	美国	1,778	414,861.49	0.19
265	MASCO CORP	马斯可	MAS UN	美国纽约证券交易所	美国	1,157	414,683.56	0.19
266	BAXTER INTERNATIONAL INC	百特	BAX UN	美国纽约证券交易所	美国	792	414,657.92	0.19
267	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	Walgreens Boots Alliance公司	WBA UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,593	414,519.33	0.19

268	LAS VEGAS SANDS CORP	拉斯维加斯金沙集团	LVS UN	美国纽约证券交易所	美国	1,065	414,161.50	0.19
269	AMGEN INC	AMGEN-T	AMGN UQ	纳斯达克证券交易所	美国	276	414,056.58	0.19
270	S&P GLOBAL INC	标普全球	SPGI UN	美国纽约证券交易所	美国	193	413,971.56	0.19
271	CORTEVA INC	Corteva Inc	CTVA UN	美国纽约证券交易所	美国	1,638	413,831.08	0.19
272	PACCAR INC	帕卡	PCAR UQ	纳斯达	美国	735	413,781.75	0.19

				克证券交易所				
273	FIFTH THIRD BANCORP	五三银行	FITB UQ	纳斯达克证券交易所	美国	2,300	413,750.43	0.19
274	Host Hotels & Resorts Inc	豪斯特酒店及度假村	HST UQ	纳斯达克证券交易所	美国	4,334	413,720.55	0.19
275	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	罗宾逊全球物流有限公司	CHRW UQ	纳斯达克证券交易所	美国	675	413,432.35	0.19
276	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	O'Reilly 汽车股份有限公司	ORLY UQ	纳斯达克证券交	美国	140	413,416.36	0.19

				易所				
277	CROWN CASTLE INTL CORP	冠城国际公司	CCI UN	美国纽约证券交易所	美国	398	413,402.13	0.19
278	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	保德信金融集团	PRU UN	美国纽约证券交易所	美国	811	413,122.54	0.19
279	AMEREN CORPORATION	Ameren 公司	AEE UN	美国纽约证券交易所	美国	811	413,069.63	0.19
280	WW GRAINGER INC	固安捷公司	GWW UN	美国纽约证券交易所	美国	155	412,978.54	0.19
2	REGENERON PHARMACEUTICALS	再生元制药股份有限	REG	纳	美	131	412,94	0.1

81		公司	NUQ	斯达克证券交易所	国		4.02	9
282	AMERICAN ELECTRIC POWER	美国电力	AEPUQ	纳斯达克证券交易所	美国	759	412,386.27	0.19
283	CARMAX INC	CarMax 股份有限公司	KMXUN	美国纽约证券交易所	美国	669	412,332.83	0.19
284	KLA CORP	KLA 公司	KLACUQ	纳斯达克证券交易所	美国	244	412,204.29	0.19
285	PPL CORP	PPL 公司	PPLUN	美国纽约证	美国	2,239	411,980.88	0.19

				券交易所				
286	VONTIER CORP	Vontier Corp	VNT UN	美国纽约证券交易所	美国	1,890	411,890.84	0.19
287	JM SMUCKER CO/THE	JM 斯马克公司	SJM UN	美国纽约证券交易所	美国	546	411,836.03	0.19
288	UDR INC	UDR 公司	UDR UN	美国纽约证券交易所	美国	1,642	411,734.63	0.19
289	SL GREEN REALTY CORP	SL Green 房地产公司	SLG UN	美国纽约证券交易所	美国	1,059	411,690.00	0.19

290	DOMINION ENERGY INC	Dominion能源公司	DUN	美国纽约证券交易所	美国	839	411,674.21	0.19
291	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	瓦里安医疗设备有限公司	VARUN	美国纽约证券交易所	美国	360	411,092.19	0.19
292	BALL CORP	波尔	BLLUN	美国纽约证券交易所	美国	676	411,001.36	0.19
293	ELI LILLY & CO	礼来	LLYUN	美国纽约证券交易所	美国	373	410,920.72	0.19
294	KELLOGG CO	家乐氏	KUN	美国纽	美国	1,012	410,917.06	0.19

				约证券交易所				
295	INTEL CORP	英特尔	INTC UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,264	410,889.13	0.19
296	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	布罗德里奇金融解决方案股份有	BR UN	美国纽约证券交易所	美国	411	410,841.63	0.19
297	HOME DEPOT INC	家得宝	HD UN	美国纽约证券交易所	美国	237	410,755.11	0.19
298	DOMINO'S PIZZA INC	达美乐披萨公司	DPZ UN	美国纽约证券交	美国	164	410,334.26	0.19

				易所				
299	WESTROCK CO	WestRock公司	WRK UN	美国纽约证券交易所	美国	1,444	410,137.73	0.19
300	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	CF工业控股股份有限公司	CF UN	美国纽约证券交易所	美国	1,623	409,935.52	0.19
301	QUANTA SERVICES INC	Quanta 服务股份有限公司	PWR UN	美国纽约证券交易所	美国	872	409,773.12	0.19
302	CLOROX COMPANY	高乐氏公司	CLX UN	美国纽约证券交易所	美国	311	409,744.93	0.19
3	ILLINOIS TOOL WORKS	伊利诺伊工具	ITW	美	美	308	409,73	0.1

03			UN	国纽约证券交易所	国		1.36	9
304	MONSTER BEVERAGE CORP	怪兽饮料公司	MNST UQ	纳斯达克证券交易所	美国	679	409,724.05	0.19
305	BOSTON PROPERTIES INC	波士顿地产公司	BXP UN	美国纽约证券交易所	美国	664	409,554.40	0.19
306	SALESFORCE.COM INC	Salesforce.com 股份有限公司	CRM UN	美国纽约证券交易所	美国	282	409,460.05	0.19
307	CINCINNATI FINANCIAL CORP	辛辛那提金融	CINF UQ	纳斯达克证	美国	718	409,317.81	0.19

				券交易所				
308	NUCOR CORP	纽柯公司	NUE UN	美国纽约证券交易所	美国	1,179	409,183.07	0.19
309	ADVANCE AUTO PARTS INC	领先汽车配件公司	AAP UN	美国纽约证券交易所	美国	398	409,039.33	0.19
310	ORACLE CORP	甲骨文	ORCL UN	美国纽约证券交易所	美国	969	409,010.81	0.19
311	WEC ENERGY GROUP INC	WEC 能源集团股份有限公司	WEC UN	美国纽约证券交易所	美国	681	408,931.34	0.19

312	ALLIANT ENERGY CORP	Alliant 能源公司	LNT UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,216	408,853.37	0.19
313	PPG INDUSTRIES INC	PPG 工业	PPG UN	美国纽约证券交易所	美国	434	408,403.15	0.19
314	CITRIX SYSTEMS INC	思杰系统	CTXS UQ	纳斯达克证券交易所	美国	481	408,315.84	0.19
315	ANSYS INC	ANSYS股份有限公司	ANSS UQ	纳斯达克证券交易所	美国	172	408,286.48	0.19
316	FACEBOOK INC-CLASS A	Facebook公司	FB UQ	纳斯达	美国	229	408,156.25	0.19

				克证券交易所				
317	METLIFE INC	大都会集团	MET UN	美国纽约证券交易所	美国	1,332	408,050.28	0.19
318	PVH CORP	PVH 公司	PVH UN	美国纽约证券交易所	美国	666	408,006.83	0.19
319	FLOWSERVE CORP	福斯公司	FLS UN	美国纽约证券交易所	美国	1,695	407,550.15	0.19
320	GENERAL MOTORS CO	通用汽车公司	GM UN	美国纽约证券交	美国	1,500	407,545.25	0.19

				易所				
321	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	人民联合金融股份有限公司	PBCTUQ	纳斯达克证券交易所	美国	4,830	407,492.40	0.19
322	BIO-RAD LABORATORIES-A	伯乐生命医学产品有限公司	BIOUN	美国纽约证券交易所	美国	107	406,987.90	0.18
323	BEST BUY CO INC	百思买	BBYUN	美国纽约证券交易所	美国	625	406,949.86	0.18
324	WESTERN UNION CO	西联汇款	WUUN	美国纽约证券交易所	美国	2,842	406,850.22	0.18
3	GENERAL MILLS INC	通用磨坊	GIS	美	美	1,0	406,68	0.1

25			UN	国纽约证券交易所	国	60	3.97	8
326	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	霍尼韦尔	HON UN	美国纽约证券交易所	美国	293	406,638.95	0.18
327	KIMBERLY-CLARK CORP	金佰利	KMB UN	美国纽约证券交易所	美国	462	406,445.55	0.18
328	PINNACLE WEST CAPITAL	Pinnacle 西部资本	PNW UN	美国纽约证券交易所	美国	779	406,377.62	0.18
329	CORNING INC	康宁公司	GLW UN	美国纽约证	美国	1,730	406,370.77	0.18

				券交易所				
330	ROCKWELL AUTOMATION INC	罗克韦尔自动化	ROK UN	美国纽约证券交易所	美国	248	405,854.52	0.18
331	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	慧与	HPE UN	美国纽约证券交易所	美国	5,245	405,543.74	0.18
332	ASSURANT INC	安信龙集团	AIZ UN	美国纽约证券交易所	美国	456	405,302.78	0.18
333	PARKER HANNIFIN CORP	派克汉尼汾	PH UN	美国纽约证券交易所	美国	228	405,258.15	0.18

334	HORMEL FOODS CORP	荷美尔食品有限公司	HRL UN	美国纽约证券交易所	美国	1,332	405,095.28	0.18
335	CONSOLIDATED EDISON INC	联合爱迪生	ED UN	美国纽约证券交易所	美国	859	405,065.34	0.18
336	OTIS WORLDWIDE CORP	Otis Worldwide Corp	OTIS UN	美国纽约证券交易所	美国	919	405,055.68	0.18
337	SKYWORKS SOLUTIONS INC	思佳讯解决方案公司	SWKS UQ	纳斯达克证券交易所	美国	406	404,995.85	0.18
338	CISCO SYSTEMS INC	思科－T	CSCO UQ	纳斯达	美国	1,386	404,697.14	0.18

				克证券交易所				
339	MERCK & CO. INC.	默克	MRK UN	美国纽约证券交易所	美国	758	404,572.51	0.18
340	UNUM GROUP	尤那坦集团	UNM UN	美国纽约证券交易所	美国	2,702	404,438.62	0.18
341	STANLEY BLACK & DECKER INC	史丹利百得公司	SWK UN	美国纽约证券交易所	美国	347	404,284.89	0.18
342	DR HORTON INC	霍顿房屋公司	DHI UN	美国纽约证券交	美国	899	404,276.80	0.18

				易所				
343	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	Pioneer 自然资源公司	PXD UN	美国纽约证券交易所	美国	544	404,257.75	0.18
344	XILINX INC	赛灵思	XLNX UQ	纳斯达克证券交易所	美国	437	404,240.33	0.18
345	STATE STREET CORP	道富集团	STT UN	美国纽约证券交易所	美国	851	404,124.77	0.18
346	LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	美国实验控股	LH UN	美国纽约证券交易所	美国	304	403,755.59	0.18
3	VERISK ANALYTICS INC	Verisk 分析公司	VRS	纳	美	298	403,64	0.1

47			KUQ	斯达克证券交易所	国		2.19	8
348	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	Interpublic 集团	IPG UN	美国纽约证券交易所	美国	2,629	403,461.19	0.18
349	JOHNSON CONTROLS INTERNATION	江森自控国际有限公司	JCI UN	美国纽约证券交易所	美国	1,326	403,097.49	0.18
350	EXXON MOBIL CORP	埃克森美孚石油	XOM UN	美国纽约证券交易所	美国	1,498	402,896.65	0.18
351	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	微芯科技股份有限公司	MCHP UQ	纳斯达克证	美国	447	402,815.81	0.18

				券交易所				
352	MEDTRONIC PLC	美敦力	MDT UN	美国纽约证券交易所	美国	527	402,800.22	0.18
353	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	爱德华生命科学公司	EW UN	美国纽约证券交易所	美国	676	402,400.24	0.18
354	LINCOLN NATIONAL CORP	林肯国民	LNC UN	美国纽约证券交易所	美国	1,225	402,127.96	0.18
355	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	国际香料	IFF UN	美国纽约证券交易所	美国	566	401,956.29	0.18

356	COLGATE-PALMOLIVE CO	高露洁棕榄	CL UN	美国纽约证券交易所	美国	720	401,719.82	0.18
357	DOW INC	Dow Inc	DOW UN	美国纽约证券交易所	美国	1,109	401,604.33	0.18
358	CME GROUP INC	芝加哥商业交易所集团股份有限	CME UQ	纳斯达克证券交易所	美国	338	401,496.02	0.18
359	DEVON ENERGY CORP	戴文能源	DVN UN	美国纽约证券交易所	美国	3,892	401,493.54	0.18
360	FEDEX CORP	联邦快递	FDX UN	美国纽	美国	237	401,476.71	0.18

				约证券交易所				
361	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	公共服务企业集团	PEG UN	美国纽约证券交易所	美国	1,055	401,323.76	0.18
362	CENTERPOINT ENERGY INC	中点能源	CNP UN	美国纽约证券交易所	美国	2,842	401,287.09	0.18
363	ESSEX PROPERTY TRUST INC	埃塞克斯房地产信托公司	ESS UN	美国纽约证券交易所	美国	259	401,227.72	0.18
364	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	亚历山大房地产股份有限公司	ARE UN	美国纽约证券交	美国	345	401,189.35	0.18

				易所				
365	EASTMAN CHEMICAL CO	伊士曼化工	EMN UN	美国纽约证券交易所	美国	613	401,096.30	0.18
366	APPLIED MATERIALS INC	应用材料	AMAT UQ	纳斯达克证券交易所	美国	712	400,926.40	0.18
367	HUNTINGTON BANCSHARES INC	杭庭顿银行	HBAN UQ	纳斯达克证券交易所	美国	4,864	400,839.74	0.18
368	LOCKHEED MARTIN CORP	洛克希德马丁	LMT UN	美国纽约证券交易所	美国	173	400,704.16	0.18
3	VORNADO REALTY TRUST	沃那多房地产信托	VNO	美	美	1,6	400,54	0.1

69			UN	国纽约证券交易所	国	44	3.78	8
370	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	美国国际集团	AIG UN	美国纽约证券交易所	美国	1,621	400,440.03	0.18
371	INVESCO LTD	景顺有限公司	IVZ UN	美国纽约证券交易所	美国	3,521	400,439.83	0.18
372	FORD MOTOR CO	福特汽车	F UN	美国纽约证券交易所	美国	6,972	399,871.19	0.18
373	FASTENAL CO	快扣公司	FAST UQ	纳斯达克证	美国	1,255	399,856.64	0.18

				券交易所				
374	VERIZON COMMUNICATIONS INC	Verizon通信股份有限公司	VZ UN	美国纽约证券交易所	美国	1,042	399,438.07	0.18
375	NVR INC	NVR 股份有限公司	NVR UN	美国纽约证券交易所	美国	15	399,310.18	0.18
376	ROBERT HALF INTL INC	罗致恒富国际公司	RHI UN	美国纽约证券交易所	美国	979	399,114.56	0.18
377	CARDINAL HEALTH INC	康德乐公司	CAH UN	美国纽约证券交易所	美国	1,142	399,098.90	0.18

378	TECHNIPFMC PLC	TechnipFMC公共有限公司	FTI UN	美国纽约证券交易所	美国	6,504	398,916.73	0.18
379	CERNER CORP	塞纳公司	CERN UQ	纳斯达克证券交易所	美国	779	398,905.76	0.18
380	MOTOROLA SOLUTIONS INC	摩托罗拉解决方案股份有限公司	MSI UN	美国纽约证券交易所	美国	359	398,355.19	0.18
381	IRON MOUNTAIN INC	美国铁山公司	IRM UN	美国纽约证券交易所	美国	2,070	398,172.89	0.18
382	SIMON PROPERTY GROUP INC	西蒙房地产集团公司	SPG UN	美国纽	美国	715	397,857.08	0.18

				约证券交易所				
383	FEDERAL REALTY INVS TRUST	联邦房地产投资信托公司	FRT UN	美国纽约证券交易所	美国	716	397,666.03	0.18
384	GAP INC/THE	Gap公司	GPS UN	美国纽约证券交易所	美国	3,016	397,321.00	0.18
385	GENERAL ELECTRIC CO	通用电气	GE UN	美国纽约证券交易所	美国	5,635	397,092.36	0.18
386	SMITH (A.O.) CORP	AO 史密斯公司	AOS UN	美国纽约证券交	美国	1,110	397,041.47	0.18

				易所				
387	CINTAS CORP	CINTAS 公司	CTAS UQ	纳斯达克证券交易所	美国	172	396,682.08	0.18
388	IDEX CORP	艺达思集团	IEX UN	美国纽约证券交易所	美国	305	396,426.82	0.18
389	DIAMONDBACK ENERGY INC	Diamondback 能源股份有限公司	FANG UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,255	396,335.48	0.18
390	IQVIA HOLDINGS INC	IQVIA 控股股份有限公司	IQV UN	美国纽约证券交易所	美国	339	396,313.49	0.18
3	WELLTOWER INC	Welltower 股份有限	WEL	美	美	939	395,91	0.1

91		公司	LUN	国纽约证券交易所	国		9.06	8
392	TYLER TECHNOLOGIES INC	Tyler科技公司	TYLUN	美国纽约证券交易所	美国	139	395,906.66	0.18
393	KRAFT HEINZ CO/THE	卡夫亨氏公司	KHCUQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,750	395,767.81	0.18
394	EVEREST RE GROUP LTD	安富来集团有限公司	REUN	美国纽约证券交易所	美国	259	395,600.18	0.18
395	KANSAS CITY SOUTHERN	Kansas City Southern	KSUUN	美国纽约证	美国	297	395,582.57	0.18

				券交易所				
396	VENTAS INC	Ventas 公司	VTR UN	美国纽约证券交易所	美国	1,236	395,496.63	0.18
397	DOVER CORP	多佛	DOV UN	美国纽约证券交易所	美国	480	395,408.94	0.18
398	MARATHON PETROLEUM CORP	马拉松石油公司	MPC UN	美国纽约证券交易所	美国	1,465	395,359.35	0.18
399	LKQ CORP	LKQ 公司	LKQ UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,719	395,262.52	0.18

400	NETFLIX INC	奈飞公司	NFLX UQ	纳斯达克证券交易所	美国	112	395,159.43	0.18
401	DELTA AIR LINES INC	达美航空有限公司	DAL UN	美国纽约证券交易所	美国	1,506	395,123.54	0.18
402	UNITED RENTALS INC	联合租赁公司	URI UN	美国纽约证券交易所	美国	261	394,942.47	0.18
403	VERISIGN INC	威瑞信股份有限公司	VRSN UQ	纳斯达克证券交易所	美国	279	393,944.75	0.18
404	PEPSICO INC	百事可乐	PEP UQ	纳斯达	美国	407	393,830.57	0.18

				克证券交易所				
405	SEAGATE TECHNOLOGY	希捷科技公司	STX UQ	纳斯达克证券交易所	美国	971	393,825.74	0.18
406	NORFOLK SOUTHERN CORP	诺福克南方	NSC UN	美国纽约证券交易所	美国	254	393,796.90	0.18
407	NORWEGIAN CRUISE LINE HLDGS LTD	挪威邮轮控股有限公司	NCLH UN	美国纽约证券交易所	美国	2,372	393,581.71	0.18
408	NATIONAL OILWELL VARCO INC	美国国民油井	NOV UN	美国纽约证券交	美国	4,392	393,465.56	0.18

				易所				
409	GILEAD SCIENCES INC	吉利德科学	GILD UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,035	393,445.60	0.18
410	VALERO ENERGY CORP	Valero 能源	VLO UN	美国纽约证券交易所	美国	1,065	393,105.98	0.18
411	CABOT OIL & GAS CORP	卡伯特石油天然气公司	COG UN	美国纽约证券交易所	美国	3,699	392,927.65	0.18
412	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	查特通信公司	CHTR UQ	纳斯达克证券交易所	美国	91	392,805.83	0.18
4	CUMMINS INC	康明斯	CMI	美	美	265	392,67	0.1

13			UN	国纽约证券交易所	国		8.27	8
414	CENTURYLINK INC	世纪电信公司	LUMN UN	美国纽约证券交易所	美国	6,172	392,648.91	0.18
415	VISA INC-CLASS A SHARES	维萨公司	V UN	美国纽约证券交易所	美国	275	392,477.63	0.18
416	FIDELITY NATL INFORMATION SERVICES INC	繁德信息技术有限公司	FIS UN	美国纽约证券交易所	美国	425	392,280.25	0.18
417	NEXTERA ENERGY INC	新纪元能源公司	NEE UN	美国纽约证	美国	779	392,145.51	0.18

				券交易所				
418	ACCENTURE PLC-CL A	埃森哲公司	ACN UN	美国纽约证券交易所	美国	230	392,004.90	0.18
419	MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	莫尔森库尔斯饮料公司	TAP UN	美国纽约证券交易所	美国	1,329	391,869.25	0.18
420	MICROSOFT CORP	微软	MSFT UQ	纳斯达克证券交易所	美国	270	391,842.43	0.18
421	AMERICAN WATER WORKS CO INC	美国自来水股份有限公司	AWK UN	美国纽约证券交易所	美国	391	391,538.17	0.18

422	LAM RESEARCH CORP	泛林集团	LRCX UQ	纳斯达克证券交易所	美国	127	391,352.34	0.18
423	WABTEC CORP	西屋制动公司	WAB UN	美国纽约证券交易所	美国	819	391,172.97	0.18
424	ALTRIA GROUP INC	高特利	MO UN	美国纽约证券交易所	美国	1,462	391,115.56	0.18
425	EQUITY RESIDENTIAL	公寓物业权益信托	EQR UN	美国纽约证券交易所	美国	1,011	391,050.83	0.18
426	HALLIBURTON CO	哈利伯顿	HAL UN	美国纽	美国	3,171	391,049.65	0.18

				约证券交易所				
427	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	Healthpeak 物业股份有限公司	PEAK UN	美国纽约证券交易所	美国	1,982	390,944.99	0.18
428	COSTCO WHOLESALE CORP	好市多批发	COST UQ	纳斯达克证券交易所	美国	159	390,893.84	0.18
429	HUMANA INC	Humana 公司	HUM UN	美国纽约证券交易所	美国	146	390,837.73	0.18
430	SCHLUMBERGER LTD	斯伦贝谢公众有限公司	SLB UN	美国纽约证券交	美国	2,741	390,424.11	0.18

				易所				
431	DANAHER CORP	丹纳赫	DHR UN	美国纽约证券交易所	美国	269	389,899.71	0.18
432	SEMPRA ENERGY	桑普拉能源	SRE UN	美国纽约证券交易所	美国	469	389,897.29	0.18
433	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	Thermo Fisher Scientific 公司	TMO UN	美国纽约证券交易所	美国	128	389,013.49	0.18
434	CBRE GROUP INC - A	世邦魏理仕	CBRE UN	美国纽约证券交易所	美国	950	388,779.64	0.18
4	BECTON DICKINSON AND CO	碧迪	BDX	美	美	238	388,57	0.1

35			UN	国纽约证券交易所	国		3.19	8
436	ROPER TECHNOLOGIES INC	儒博技术公司	ROP UN	美国纽约证券交易所	美国	138	388,169.04	0.18
437	DUKE REALTY CORP	杜克房地产公司	DRE UN	美国纽约证券交易所	美国	1,488	388,070.78	0.18
438	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	Archer-Daniels-Midland公司	ADM UN	美国纽约证券交易所	美国	1,179	387,796.93	0.18
439	MARATHON OIL CORP	Marathon石油公司	MRO UN	美国纽约证	美国	8,908	387,685.81	0.18

				券交易所				
440	MID-AMERICA APARTMENT COMM	Mid-America Apartment Commun	MAA UN	美国纽约证券交易所	美国	468	386,867.32	0.18
441	QUEST DIAGNOSTICS INC	Quest Diagnostics 股份有限公	DGX UN	美国纽约证券交易所	美国	497	386,453.45	0.18
442	HOLLYFRONTIER CORP	HollyFrontier 公司	HFC UN	美国纽约证券交易所	美国	2,288	385,913.91	0.18
443	L BRANDS INC	蕾碧裳股份有限公司	LB UN	美国纽约证券交易所	美国	1,590	385,831.04	0.18

444	EVERGY INC	Evergy股份有限公司	EVRG UN	美国纽约证券交易所	美国	1,064	385,377.82	0.18
445	AVALONBAY COMMUNITIES INC	AvalonBay社区股份有限公司	AVB UN	美国纽约证券交易所	美国	368	385,218.61	0.18
446	NVIDIA CORP	英伟达	NVDA UQ	纳斯达克证券交易所	美国	113	385,025.21	0.17
447	KINDER MORGAN INC	特拉华州金德摩根公司	KMI UN	美国纽约证券交易所	美国	4,312	384,610.49	0.17
448	DUKE ENERGY CORP	杜克能源	DUK UN	美国纽	美国	643	384,140.96	0.17

				约证券交易所				
449	CHEVRON CORP	雪佛龙	CVX UN	美国纽约证券交易所	美国	697	384,066.38	0.17
450	PERRIGO CO PLC	Perrigo 公共有限公司	PRG0 UN	美国纽约证券交易所	美国	1,315	383,708.49	0.17
451	CENTENE CORP	Centene 公司	CNC UN	美国纽约证券交易所	美国	979	383,464.26	0.17
452	CAMPBELL SOUP CO	金宝汤	CPB UN	美国纽约证券交	美国	1,215	383,306.88	0.17

				易所				
453	UNION PACIFIC CORP	联合太平洋	UNP UN	美国纽约证券交易所	美国	282	383,129.34	0.17
454	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	伯克希尔哈撒韦公司	BRK/B UN	美国纽约证券交易所	美国	253	382,770.93	0.17
455	HESS CORP	赫斯公司	HES UN	美国纽约证券交易所	美国	1,110	382,338.91	0.17
456	EOG RESOURCES INC	EOG资源	EOG UN	美国纽约证券交易所	美国	1,173	381,690.40	0.17
4	BOEING CO/THE	波音	BA	美	美	273	381,30	0.1

57			UN	国纽约证券交易所	国		4.59	7
458	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	联合包裹服务股份有限公司	UPS UN	美国纽约证券交易所	美国	347	381,281.23	0.17
459	WR BERKLEY CORP	WR Berkley公司	WRB UN	美国纽约证券交易所	美国	879	380,944.41	0.17
460	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	皇家加勒比海游轮有限公司	RCL UN	美国纽约证券交易所	美国	781	380,616.27	0.17
461	ECOLAB INC	艺康集团	ECL UN	美国纽约证	美国	269	379,754.66	0.17

				券交易所				
462	AMERICAN AIRLINES GROUP INC	美国航空集团公司	AAL UQ	纳斯达克证券交易所	美国	3,688	379,486.62	0.17
463	CONAGRA BRANDS INC	康尼格拉品牌股份有限公司	CAG UN	美国纽约证券交易所	美国	1,603	379,258.38	0.17
464	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	百时美施贵宝公司	BMY UN	美国纽约证券交易所	美国	937	379,240.96	0.17
465	ONEOK INC	Oneok 股份有限公司	OKE UN	美国纽约证券交易所	美国	1,513	378,894.03	0.17

466	3M CO	3M公司	MMM UN	美国纽约证券交易所	美国	332	378,641.77	0.17
467	CONCHO RESOURCES INC	康丘资源公司	CXO UN	美国纽约证券交易所	美国	994	378,443.55	0.17
468	BAKER HUGHES CO	贝克休斯公司	BKR UN	美国纽约证券交易所	美国	2,774	377,386.51	0.17
469	DOLLAR GENERAL CORP	达乐公司	DG UN	美国纽约证券交易所	美国	275	377,351.28	0.17
470	CONOCOPHILLIPS	康菲石油	COP UN	美国纽	美国	1,446	377,305.87	0.17

				约证券交易所				
471	FIRSTENERGY CORP	第一能源	FE UN	美国纽约证券交易所	美国	1,884	376,286.02	0.17
472	WHIRLPOOL CORP	惠而浦	WHR UN	美国纽约证券交易所	美国	319	375,679.67	0.17
473	NISOURCE INC	NiSource 公司	NI UN	美国纽约证券交易所	美国	2,508	375,400.46	0.17
474	INTL BUSINESS MACHINES CORP	国际商业机器	IBM UN	美国纽约证券交	美国	457	375,358.97	0.17

				易所				
475	FMC CORP	FMC公司	FMC UN	美国纽约证券交易所	美国	499	374,203.47	0.17
476	AMERISOURCEBERGEN CORP	美源伯根	ABC UN	美国纽约证券交易所	美国	586	373,794.30	0.17
477	L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	L3Harris Technologies股份有	LHX UN	美国纽约证券交易所	美国	303	373,700.99	0.17
478	EVERSOURCE ENERGY	Eversource能源公司	ES UN	美国纽约证券交易所	美国	662	373,678.54	0.17
4	WALMART INC	沃尔玛股份有限公司	WMT	美	美	396	372,46	0.1

79			UN	国纽约证券交易所	国		3.48	7
480	TYSON FOODS INC-CL A	泰森食品公司	TSN UN	美国纽约证券交易所	美国	884	371,690.67	0.17
481	ENTERGY CORP	Entergy 公司	ETR UN	美国纽约证券交易所	美国	570	371,324.23	0.17
482	ATMOS ENERGY CORP	美国阿特摩斯能源公司	ATO UN	美国纽约证券交易所	美国	593	369,244.03	0.17
483	DTE ENERGY COMPANY	DTE 能源	DTE UN	美国纽约证	美国	466	369,159.66	0.17

				券交易所				
484	PFIZER INC	辉瑞制药	PFE UN	美国纽约证券交易所	美国	1,532	367,958.16	0.17
485	HENRY SCHEIN INC	亨利香恩公司	HSIC UQ	纳斯达克证券交易所	美国	841	366,890.30	0.17
486	UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	美国联合航空控股股份有限公司	UAL UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,300	366,862.50	0.17
487	HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	JB Hunt运输服务股份有限公司	JBHT UQ	纳斯达克证券交易所	美国	409	364,675.68	0.17

488	GENERAL DYNAMICS CORP	通用动力	GD UN	美国纽约证券交易所	美国	374	363,167.32	0.17
489	APACHE CORP	阿帕契	APA UQ	纳斯达克证券交易所	美国	3,906	361,650.02	0.16
490	AT&T INC	美国电话电报公司	T UN	美国纽约证券交易所	美国	1,919	360,112.10	0.16
491	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	菲利普莫里斯国际集团公司	PM UN	美国纽约证券交易所	美国	666	359,770.85	0.16
492	DISH NETWORK CORP-A	DISH网络公司	DISH UQ	纳斯达	美国	1,702	359,147.98	0.16

				克证券交易所				
493	OLD DOMINION FREIGHT LINE	Old Dominion Freight Line股份有限公司	ODFL UQ	纳斯达克证券交易所	美国	282	359,135.45	0.16
494	WILLIAMS COS INC	威廉姆斯公司	WMB UN	美国纽约证券交易所	美国	2,677	350,216.50	0.16
495	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	西方石油	OXY UN	美国纽约证券交易所	美国	3,010	339,967.52	0.15
496	NEWS CORP - CLASS A	新闻集团	NWSA UQ	纳斯达克证券交	美国	2,796	327,837.86	0.15

				易所				
497	DISCOVERY INC-C	探索通信公司	DISCK UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,680	287,090.38	0.13
498	FOX CORP - CLASS A	福克斯公司	FOXA UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,358	258,026.91	0.12
499	ALPHABET INC-CL A	Alphabet 公司	GOOGL UQ	纳斯达克证券交易所	美国	19	217,280.21	0.10
500	UNDER ARMOUR INC-CLASS A	安德玛公司	UAA UN	美国纽约证券交易所	美国	1,920	215,102.46	0.10
5	ALPHABET INC-CL C	Alphabet 公司	GOO	纳	美	17	194,32	0.0

01			GUQ	斯达克证券交易所	国		4.31	9
502	UNDER ARMOUR INC-CLASS C	安德玛公司	UAUN	美国纽约证券交易所	美国	1,981	192,336.30	0.09
503	DISCOVERY INC - A	探索通信公司	DISCAUQ	纳斯达克证券交易所	美国	917	180,038.50	0.08
504	FOX CORP - CLASS B	福克斯公司	FOXUQ	纳斯达克证券交易所	美国	652	122,862.30	0.06
505	NEWS CORP - CLASS B	新闻集团	NWSUQ	纳斯达克证	美国	939	108,874.68	0.05

				券交易所				

8.4.2 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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	APARTMENT INVT & MGMT CO -A	公寓投资与管理	AIV UN	美国纽约证券交易所	美国	1,592	54,846.74	0.02

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	CHEVRON CORP	CVX UN	900,021.21	0.37
2	PAYCOM SOFTWARE INC	PAYC UN	720,388.93	0.29
3	CENTENE CORP	CNC UN	717,569.56	0.29
4	ABBVIE INC	ABBV UN	617,275.48	0.25
5	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	WST UN	572,565.70	0.23
6	DEXCOM INC	DXCM UQ	569,421.99	0.23
7	DOMINO'S PIZZA INC	DPZ UN	531,913.66	0.22
8	HOWMET AEROSPACE INC	HWM UN	529,260.03	0.22
9	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	OXY UN	528,340.64	0.22
10	OTIS WORLDWIDE CORP	OTIS UN	518,482.21	0.21
11	DIAMONDBACK ENERGY INC	FANG UQ	516,888.30	0.21
12	TYLER TECHNOLOGIES INC	TYL UN	515,763.74	0.21
13	CARRIER GLOBAL CORP	CARR UN	513,177.09	0.21

14	TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	TDY UN	508,150.95	0.21
15	TRANE TECHNOLOGIES PLC	TT UN	504,098.93	0.21
16	MARATHON OIL CORP	MRO UN	491,424.00	0.20
17	BIO-RAD LABORATORIES-A	BIO UN	481,781.58	0.20
18	MORGAN STANLEY	MS UN	481,299.85	0.20
19	DEVON ENERGY CORP	DVN UN	468,724.95	0.19
20	APACHE CORP	APA UQ	452,563.81	0.19

注：本期累计买入金额指买入成交金额（成交单价乘以成交数量），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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	NOBLE ENERGY INC	NBL UQ	829,105.99	0.34
2	MYLAN NV	MYL UQ	730,798.17	0.30
3	CENTENE CORP	CNC UN	697,784.38	0.29
4	MORGAN STANLEY	MS UN	673,846.43	0.28
5	CAPRI HOLDINGS LTD	CPRI UN	637,211.62	0.26
6	ADVANCED MICRO DEVICES	AMD UQ	632,307.64	0.26
7	NVIDIA CORP	NVDA UQ	620,073.82	0.25
8	L BRANDS INC	LB UN	614,804.22	0.25
9	NEWMONT CORP	NEM UN	602,164.11	0.25
10	FREEPORT-MCMORAN INC	FCX UN	591,105.58	0.24
11	NETFLIX INC	NFLX UQ	588,559.52	0.24
12	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	ADS UN	586,726.05	0.24
13	HELMERICH & PAYNE	HP UN	581,590.42	0.24
14	CHEVRON CORP	CVX UN	576,697.95	0.24
15	HARLEY-DAVIDSON INC	HOG UN	569,319.43	0.23
16	REGENERON PHARMACEUTICALS	REGN UQ	547,523.92	0.22
17	SERVICENOW INC	NOW UN	546,915.06	0.22
18	KOHLS CORP	KSS UN	544,990.34	0.22
19	LAM RESEARCH CORP	LRCX UQ	542,123.59	0.22
20	OLD DOMINION FRE	ODFL UQ	530,750.07	0.22

	IGHT LINE			

注：本期累计卖出金额指卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），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	124,513,418.25
卖出收入（成交）总额	147,869,045.25

注：本项中“买入股票的成本(成交)总额”及“卖出股票的收入(成交)总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

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

无。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

无。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

无。

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

无。

8.11 投资组合报告附注

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

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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	253,532.40
4	应收利息	423.34
5	应收申购款	856,800.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	196,351.92
8	其他	-
9	合计	1,307,108.18

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§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（%）
45,945	2,447.47	36,263.78	0.03	112,412,595.64	99.97

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）

基金管理人所有从业人员持有本基金	3,407.50	0.0030

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

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

无。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 3 月 23 日）基金份额总额	822,754,222.26
本报告期期初基金份额总额	122,182,590.21
本报告期基金总申购份额	201,071,418.43
减：本报告期基金总赎回份额	210,805,149.22
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	112,448,859.42

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

无。

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

一、基金管理人的重大人事变动

1.2020 年 12 月 28 日,经大成基金管理有限公司 2020 年第一次临时股东会审议通过,选举林昌先生担任公司股东董事,翟斌先生不再担任公司股东董事。

2.2020 年 12 月 28 日，经大成基金管理有限公司第七届董事会第八次会议审议通过，选举林昌先生担任公司第七届董事会副董事长，同时，选举其担任第七届董事会合规与风险管理委员会委员，第七届董事会审计委员会委员。翟斌先生不再担任公司第七届董事会副董事长、第七届董事会合规与风险管理委员会委员、第七届董事会审计委员会委员。

上述变更详见公司相关公告。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

无。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

11.4 基金投资策略的改变

无。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），本年度支付的审计费用为 6 万元整。该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

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

本报告期内，基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
摩根士丹利	1	270,086,707.61	100.00%	80,994.56	100.00%	-

注：1、公司作为管理人负责选择代理各投资组合证券买卖的境外券商，具体选择标准如下：

（一）具备该机构所在国家或地区政府、监管机构核发的营业执照、业务许可证明文件；

（二）资历雄厚，信誉良好；

（三）财务状况良好，经营行为规范；

（四）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度(包括但不限于公平交易制度及保密制度)，能满足各投资组合运作高度保密的要求；

（五）证券研究或市场研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为各投资组合提供宏观经济、行业情况、个股分析、市场研究等各方面研究报告及周到的

信息服务，并能根据各投资组合投资的特定要求，提供专题研究报告；

（六）具备各投资组合运作所需的交易执行能力。能够准确、及时、高质量完成各投资组合下达的交易指令。

（七）具备各投资组合运作所需的后台清算执行能力。能及时、高效处理交易清算、证券交收等后台清算业务。

（八）能提供各投资组合运作、管理所需的其他服务。

（九）相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

交易管理部在每半年 15 个交易日内，汇总上半年境外券商综合服务评价结果，作为当次境外券商交易量分配依据。并依此制作交易量分配计划，报部门及公司分管领导批准；

交易量分配计划获批后，作为选择交易券商的依据，供交易员在交易时进行券商选择。

券商服务出现重大失误或其他异常情况时，及时报公司监察稽核部及相关领导。可暂停与该券商的合作，并对其失误所造成的损失进行追偿。

2、本报告期内本基金无新增或退租境外交易单元。

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

无。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 12 月 31 日
2	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2021 年境外主要市场节假日暂停申购赎回安排的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 12 月 30 日
3	大成基金管理有限公司关于提示泰诚财富基金销售（大连）有限公司代销客户及时办理转托管业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 12 月 17 日
4	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 11 月 25 日
5	关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金调整大额申购（含定期定额申购）业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 11 月 12 日
6	大成标普 500 等权重指数证券投资基	中国证监会基金电子披	2020 年 10 月 28 日

	金第三季度报告	露网站、规定报刊及本公司网站	
7	关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金调整大额申购（含定期定额申购）业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 9 月 4 日
8	大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 8 月 27 日
9	大成标普 500 等权重指数证券投资基金中期报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 8 月 28 日
10	大成标普 500 等权重指数证券投资基金第二季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 7 月 21 日
11	关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金调整大额申购（含定期定额申购）业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 7 月 17 日
12	关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 7 月 1 日
13	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加泛华普益基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 6 月 5 日
14	关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金调整大额申购（含定期定额申购）业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 6 月 3 日
15	关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金调整大额申购（含定期定额申购）业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 5 月 23 日
16	大成标普 500 等权重指数 QDII2019 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 4 月 29 日
17	大成基金关于终止泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 4 月 25 日
18	大成标普 500 等权重指数 QDII 招募说明书摘要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 4 月 23 日
19	大成标普 500 等权重指数 QDII 招募说明书更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 4 月 23 日
20	大成标普 500 等权重指数 QDII2020 年第一季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 4 月 21 日

21	大成基金关于旗下部分基金增加上海浦东发展银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年4月21日
22	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加浙江绍兴瑞丰农村商业银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年3月30日
23	大成标普500等权重指数QDII基金调整大额申购（含定期定额申购）业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年3月28日
24	大成基金管理有限公司关于延迟披露旗下公募基金2019年年度报告的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年3月25日
25	大成标普500等权重指数QDII基金调整大额申购（含定期定额申购）业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年3月25日
26	大成基金管理有限公司关于注销南京分公司的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年3月21日
27	大成标普500等权重指数QDII基金调整大额申购（含定期定额申购）业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年3月11日
28	大成基金管理有限公司关于注销青岛分公司的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年2月29日
29	大成基金关于APP交易平台汇款交易费率优惠的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年2月26日
30	大成标普500等权重指数QDII基金调整大额申购（含定期定额申购）业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年2月18日
31	大成标普500等权重指数QDII基金调整大额申购（含定期定额申购）业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年2月11日
32	大成基金管理有限公司关于2020年春节假期延长期间调整公司公募基金开放时间等相关事宜的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年1月30日
33	大成标普500等权重指数QDII2019年第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年1月17日
34	大成标普500等权重指数QDII2019年度第1次分红的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年1月15日
35	大成标普500等权重指数QDII基金暂停大额申购（含定期定额申购）业务	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本	2020年1月9日

	的公告	公司网站	
36	大成标普500等权重指数QDII2020年境外主要市场节假日暂停申购赎回安排的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年1月4日

§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

无。

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大成标普500等权重指数证券投资基金的文件；

2、《大成标普500等权重指数证券投资基金基金合同》；

3、《大成标普500等权重指数证券投资基金托管协议》；

4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；

5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

13.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，或登录本基金管理人网站http://www.dcfund.com.cn进行查阅。

大成基金管理有限公司

2021年3月30日