

嘉实美国成长股票型证券投资基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2023 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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，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 2023 年 03 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	11
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	11
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	15
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	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容.....	16
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	19
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	24

§8 投资组合报告	53
8.1 期末基金资产组合情况.....	53
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	54
8.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	54
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.....	55
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	101
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	103
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.....	103
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.....	103
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.....	103
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.....	103
8.11 投资组合报告附注.....	104
§9 基金份额持有人信息	105
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	105
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	105
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.....	106
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.....	106
§10 开放式基金份额变动	106
§11 重大事件揭示	107
11.1 基金份额持有人大会决议.....	107
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.....	107
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	107
11.4 基金投资策略的改变.....	107
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	107
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.....	107
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	108
11.8 其他重大事件.....	111
§12 备查文件目录	112
12.1 备查文件目录.....	112
12.2 存放地点.....	112
12.3 查阅方式.....	112

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实美国成长股票型证券投资基金	
基金简称	嘉实美国成长股票（QDII）	
基金主代码	000043	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 6 月 14 日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
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	447,685,924.25 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币	嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇
下属分级基金的交易代码	000043	000044
报告期末下属分级基金的份额总额	442,563,854.58 份	5,122,069.67 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于美国大盘成长型股票，在股票选择及组合构建方面均运用量化投资方法并结合风险管理手段，力争获取长期资本增值。
投资策略	<p>本基金不尝试进行择时操作。在正常的市场条件下，本基金将在基金合同以及法律法规所允许的投资范围内，最大程度的持有股票类资产。当基金经理认为足够审慎时，本基金亦可以将小部分资产配置于债券类和现金类等大类资产上。</p> <p>本基金采用主动的量化投资策略。本基金将依托内部自主研发的定量投资模型以及强大的数据库系统，构建投资组合。嘉实量化投资团队将根据市场外在与内在变化趋势，定期或不定期地对模型进行复核，并做出相应调整，以不断改善模型的适用性。</p> <p>本基金主要投资于市值超过 20 亿美元的美国大盘股票；在此基础上，本基金将通过成长性模型挑选出足够数量的最具成长性的股票作为股票选择的样本空间。</p> <p>具体投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、固定收益投资策略、衍生品投资策略。</p>
业绩比较基准	95%×罗素 1000 成长指数收益率+5%×境内银行活期存款税后利率
风险收益特征	本基金主要投资于美国大盘成长型股票，属于主动投资的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金与混合型基金，为证券投资基金中的较高预期风险、较高预期收益的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	嘉实基金管理有限公司		中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	胡勇钦	许俊
	联系电话	(010)65215588	95566
	电子邮箱	service@jsfund.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话	400-600-8800		95566
传真	(010)65215588		(010)66594942
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 1806A 单元		北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街 21 号 北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层		北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	100005		100818
法定代表人	经雷		刘连舸

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 二座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	嘉实基金管理有限公司	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱 乐部 C 座写字楼 12A 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1. 1 期 间数 据和 指标	报告期（2022 年 1 月 1 日-2022 年 12 月 31 日）		报告期（2021 年 1 月 1 日-2021 年 12 月 31 日）		报告期（2020 年 1 月 1 日 -2020 年 12 月 31 日）	
	嘉实美国成长股 票型证券投资基 金-人民币	嘉实美国成长 股票型证券投 资基金-美元 现汇	嘉实美国成长股 票型证券投资基 金-人民币	嘉实美国成长 股票型证券投 资基金-美元 现汇	嘉实美国成长 股票型证券投 资基金-人民 币	嘉实美国成 长股票型证 券投资基金- 美元现汇
本期已实现收益	-14,819,682.18	-1,033,428.96	73,231,158.63	5,835,543.80	60,328,922.02	3,447,194.89
本期利润	-328,304,437.27	-21,364,826.72	205,539,509.02	17,389,003.43	240,302,644.30	11,572,962.71

加权平均基金份额本期利润	-0.7421	-4.3011	0.5960	3.7959	0.6707	3.1570
本期加权平均净值利润率	-25.68%	-24.43%	19.49%	20.24%	27.91%	21.72%
本期基金份额净值增长率	-20.82%	-27.48%	22.45%	25.29%	26.93%	35.75%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
期末可供分配利润	282,208,317.53	23,808,345.96	328,137,384.25	23,805,681.19	161,551,067.79	12,249,036.00
期末可供分配基金份额利润	0.6377	4.6482	0.6717	4.8555	0.4516	3.5145
期末基金资产净值	1,185,382,062.47	83,685,753.71	1,652,264,609.89	101,112,998.99	988,053,266.39	58,716,221.41
期末基金份额净值	2.678	2.346	3.382	3.235	2.762	2.582
3.1.3 累计期末指	2022 年末		2021 年末		2020 年末	

标						
基金份额累计净值增长率	167.80%	134.60%	238.20%	223.50%	176.20%	158.20%

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

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

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

（4）嘉实美国成长股票(QDII)美元现汇的期末基金份额净值单位为美元。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.00%	1.61%	1.86%	1.68%	-1.86%	-0.07%
过去六个月	1.86%	1.52%	-1.81%	1.55%	3.67%	-0.03%
过去一年	-20.82%	1.69%	-28.41%	1.74%	7.59%	-0.05%
过去三年	23.07%	1.69%	21.43%	1.69%	1.64%	0.00%
过去五年	61.91%	1.48%	57.12%	1.46%	4.79%	0.02%
自基金合同生效起至今	167.80%	1.20%	177.95%	1.17%	-10.15%	0.03%

嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.96%	1.54%	1.86%	1.68%	0.10%	-0.14%

过去六个月	-1.80%	1.47%	-1.81%	1.55%	0.01%	-0.08%
过去一年	-27.48%	1.65%	-28.41%	1.74%	0.93%	-0.09%
过去三年	23.34%	1.66%	21.43%	1.69%	1.91%	-0.03%
过去五年	51.26%	1.45%	57.12%	1.46%	-5.86%	-0.01%
自基金合同生效 起至今	134.60%	1.18%	177.95%	1.17%	-43.35%	0.01%

注：本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

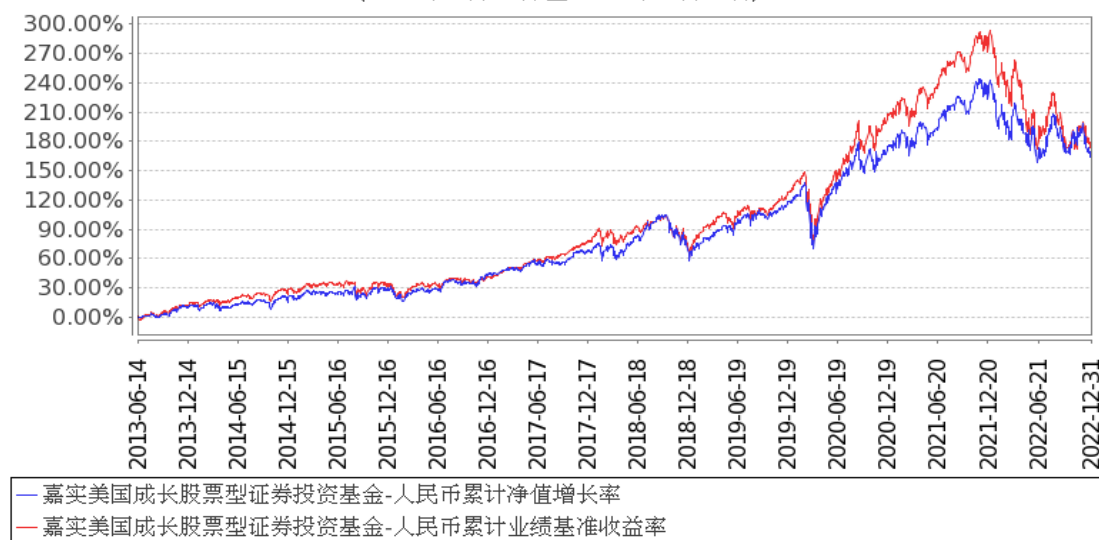
$$\text{Return}(t) = 95\% \times \text{罗素 1000 成长指数收益率}(t) + 5\% \times ((1 + \text{境内银行活期存款税后利率})^{1/365} - 1)$$

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

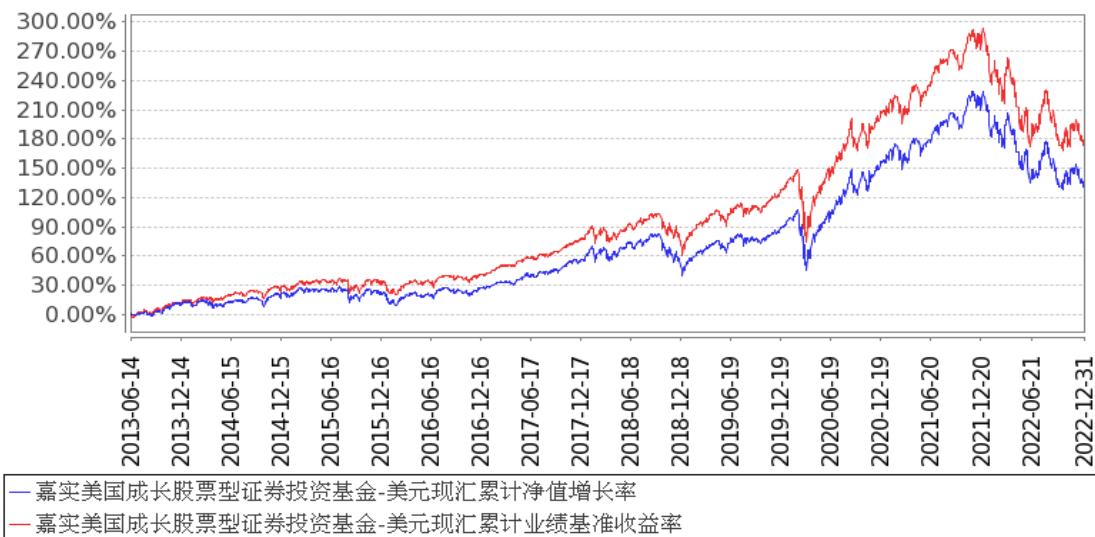
其中， $t = 1, 2, 3, \dots, T$ ， T 表示时间截至日。

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

嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2013年06月14日至2022年12月31日)



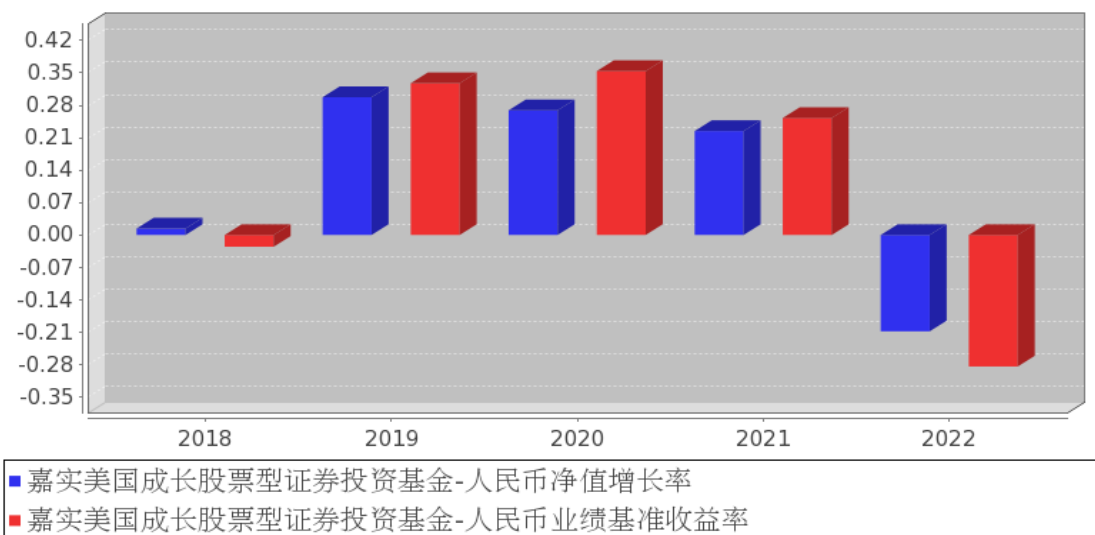
嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2013年06月14日至2022年12月31日)



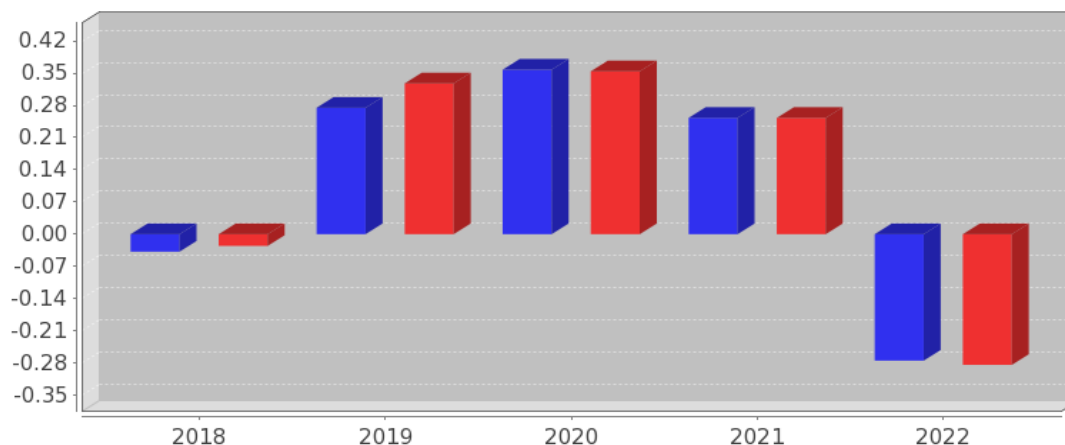
注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 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

嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



■ 嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇净值增长率
■ 嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇业绩基准收益率

注：上述数据根据基金当年实际存续期计算。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止2022年12月31日，基金管理人共管理298只开放式证券投资基金，覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF等不同类别。同时，还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张自	本基金、	2013年6	-	26年	曾任美国世纪投资管理公司（American

力	嘉实事件驱动股票、嘉实全球价值股票（QDII）基金经理	月 14 日			Century Investments）资深副总经理，研究部总监暨基金经理，负责直接管理、支持公司旗下近二百亿美元的多项大型公募基金和对冲基金类产品。2012 年 2 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任定量投资部负责人，现任人工智能投资部负责人。博士研究生，毕业于美国德州大学奥斯汀分校和中国科学技术大学，具有基金从业资格。美国国籍。
---	-----------------------------	--------	--	--	--

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

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

公司严格执行《公平交易管理制度》，各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司公

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的，合计 17 次，其中 1 次为旗下组合被动跟踪模拟组合权重配置需要与其他组合发生反向交易，另 16 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年，全球较为重大的经济和市场事件，为美联储较为坚定的持续加息，而俄乌冲突等国际局势的变化，以及欧佩克在增产上的态度等，导致上游大宗商品价格的波动，年末及 2023 年伊始随着美联储加息减缓预期的抬头，包括黄金价格、资本市场估值等都有逐步的上行。

美股 2022 年全年收益为负，其中价值风格显著占优，罗素 1000 价值跌幅在 10%以内，而纳指则达到-33%左右水平，成长风格、科技板块在市场整体下行过程中进一步大幅跑输价值风格，收到加息对估值收缩的显著影响。接近年末，随着美国通胀的逐步走平和向下，联储高强度加息的预测概率逐渐降低，科技板块在 2022 年末达到当年的最低位置。

投资业绩上，本基金纯股票头寸相对业绩基准取得了显著的正超额收益，受仓位水平、较高的交易成本和换汇成本的影响，组合净值层面的收益略有减损，费后净值依然显著战胜基准指数。

行业上，本基金主要配置于信息科技等行业，以高科技龙头企业为主要配置，除传统的几大科技公司外，还包括新兴人工智能的龙头公司，生物医药领域的高科技企业等，此外还配置非必须消费品等行业，并通过部分价值维度的补充来控制风格暴露的风险。

本报告期间，本基金运作主要包括应对净申赎造成的仓位波动和实现对美国成长股的筛选与投资过程。本基金资金运作流程较长，单向包括从人民币申购、确认、换汇和掉汇等一系列步骤，涉及国内外券商和银行的多个环节，在市场大幅震荡背景下，申赎的不确定性会直接影响仓位水平并影响投资业绩，本基金在保证 90%股票仓位和 5%现金仓位的合规约束下，成功实现了流动性

操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币基金份额净值为 2.678 元，本报告期基金份额净值增长率为-20.82%；截至本报告期末嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇基金份额净值为 2.346 美元，本报告期基金份额净值增长率为-27.48%；业绩比较基准收益率为-28.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为，站在当前时点，权益类资产迎来较好的配置机会。随着美国通胀问题的逐步减缓，以及美国经济衰退的概率逐步显现，美联储已经开始放轻加息步伐，当利率提升的预期升高，以致年内加息节奏停止或出现对降息的投资心理，资本市场的受压制的估值空间将再次打开。在此宏观背景下，我们使用企业盈利增速进一步对静态企业估值水平进行修正，以更精细的企业价值测算方式，挖掘个股投资机会。

如我们前次预测，在美国宏观经济层面，其国内通胀指标退居经济衰退之后的第二位，将对美联储加息等各项政策产生影响，进而需要重新审视投资逻辑和方向。就美国经济自身而言，当前美国非政府部门资产负债表状况相对较为健康，至少不会面临较大的债务危机风险，大概率不会出现类似 2008 年金融危机的深度衰退，因此在当前“经济增长放缓，未进入衰退，衰退不会产生严重经济危机”的大背景下，当美联储政策完成既定目标之后，如通胀出现显著拐点、且联邦基金利率有效超过中性利率时，联储的货币政策同时也达到退坡甚至转向的话，那么市场则可以进入增长放缓且政策宽松的交易逻辑，权益类资产是较好的配置选择，其中的结构将更倾向于在业绩与估值两方面具有投资价值的标的。

在行业层面，我们依然倾向于成长风格，科技、生物等依然是投资者最关注的区域。

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

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人有关监察稽核工作情况如下：

(1) 继续内控前置。在基金营销、投资管理、信息披露以及新产品设计开发、海外业务、另类业务、制度建设、合同管理、法律咨询等方面，事前进行合规性审核、监控。全力支持创新业务，包括新产品新业务，产品生命周期支持也包括从战略规划到具体产品方案、业务模式、制度流程。在制度流程、投资范围、投资工具、运作规则等方面，防控重大风险。

(2) 全流程动态开展投资交易监督。一是事前防范，主要从事前研讨，合规风险识别、评估

和分析，IT 事前设置，建立禁限库，合规培训、承诺书等方面开展；二是事中实时监控，如实时回答组合经理、交易员投资交易事项，盘中交易审批，盘中实时监控等；三是事后检查及改进，如检查投资交易合规情况，对异常行为进行提示、处理建议并督促改正。

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

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

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

此外，我们还积极配合监管，按时完成合规报告和各项统计报表以及专题报告。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括基金投资市场的各证券交易所以及境内相关机构等。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在嘉实美国成长股票型证券投资基金（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

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2023)第 25337 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	嘉实美国成长股票型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了嘉实美国成长股票型证券投资基金(以下简称“嘉实美国成长股票(QDII)基金”)的财务报表,包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表,2022 年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了嘉实美国成长股票(QDII)基金</p>

	2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。
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，我们独立于嘉实美国成长股票(QDII)基金，并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>嘉实美国成长股票(QDII)基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司(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。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估嘉实美国成长股票(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嘉实美国成长股票(QDII)基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督嘉实美国成长股票(QDII)基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对嘉实美</p>

	<p>国成长股票(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嘉实美国成长股票(QDII)基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>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。</p>
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	张勇 周祎
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2023 年 03 月 27 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：嘉实美国成长股票型证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	87,125,147.00	386,008,961.82
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	1,182,000,660.24	1,651,141,851.14
其中：股票投资		1,170,442,138.35	1,648,245,698.91
基金投资		11,558,521.89	2,896,152.23
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-

其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		1,895,547.95	272,255.93
应收申购款		6,808,639.22	7,464,249.19
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	11,797.88
资产总计		1,277,829,994.41	2,044,899,115.96
负债和净资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	255,695,400.05
应付赎回款		6,156,234.96	32,855,556.73
应付管理人报酬		1,983,130.05	2,202,834.89
应付托管费		385,608.61	428,329.00
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	7.4.7.9	237,204.61	339,386.41
负债合计		8,762,178.23	291,521,507.08
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	474,111,355.85	518,693,260.29
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	794,956,460.33	1,234,684,348.59
净资产合计		1,269,067,816.18	1,753,377,608.88
负债和净资产总计		1,277,829,994.41	2,044,899,115.96

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币基金份额净值 2.678 元，基金份额总额 442,563,854.58 份，嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇基金份额净值 2.346 美元，基金份额总额 5,122,069.67 份，基金份额总额合计为 447,685,924.25 份。

7.2 利润表

会计主体：嘉实美国成长股票型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021
----	-----	----------------------------	---------------------------------

		年 12 月 31 日	年 12 月 31 日
一、营业总收入		-319,977,041.35	248,136,016.77
1. 利息收入		191,115.28	172,982.92
其中：存款利息收入	7.4.7.13	191,115.28	172,982.92
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）		6,004,433.90	104,322,959.91
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-8,917,711.44	96,704,140.53
基金投资收益	7.4.7.15	-645,015.23	424,715.24
债券投资收益	7.4.7.16	-	-
资产支持证券投资	7.4.7.17	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.18	-	-
衍生工具收益	7.4.7.19	-	-
股利收益	7.4.7.20	15,567,160.57	7,194,104.14
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	-333,816,152.85	143,861,810.02
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		6,477,705.27	-1,602,951.44
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.22	1,165,857.05	1,381,215.36
减：二、营业总支出		29,692,222.64	25,207,504.32
1. 管理人报酬		24,668,322.80	20,462,353.64
2. 托管费		4,796,618.23	3,978,791.02
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		-	1,426.60
8. 其他费用	7.4.7.24	227,281.61	764,933.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-349,669,263.99	222,928,512.45

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-349,669,263.99	222,928,512.45
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-349,669,263.99	222,928,512.45

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：嘉实美国成长股票型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	518,693,260.29	-	1,234,684,348.59	1,753,377,608.88
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	518,693,260.29	-	1,234,684,348.59	1,753,377,608.88
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-44,581,904.44	-	-439,727,888.26	-484,309,792.70
（一）、综合收益总额	-	-	-349,669,263.99	-349,669,263.99
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值	-44,581,904.44	-	-90,058,624.27	-134,640,528.71

变动数 (净值 减少以 “-”号 填列)				
其中:1. 基金申 购款	291,722,966.64	-	553,856,748.46	845,579,715.10
2 .基金赎 回款	-336,304,871.08	-	-643,915,372.73	-980,220,243.81
(三)、 本期向 基金份 额持有 人分配 利润产 生的基 金净值 变动(净 值减少 以“-” 号填列)	-	-	-	-
(四)、 其他综 合收益 结转留 存收益	-	-	-	-
四、本期 期末净 资产(基 金净值)	474,111,355.85	-	794,956,460.33	1,269,067,816.18
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期 期末净 资产(基 金净值)	379,227,706.27	-	667,541,781.53	1,046,769,487.80
加:会计 政策变 更	-	-	-	-
前期差 错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本 期初 净 资 产 (基 金 净 值)	379,227,706.27	-	667,541,781.53	1,046,769,487.80
三、本 期 增 减 变 动 额 (减 少 以 “-” 号 填 列)	139,465,554.02	-	567,142,567.06	706,608,121.08
(一)、 综 合 收 益 总 额	-	-	222,928,512.45	222,928,512.45
(二)、 本 期 基 金 份 额 交 易 产 生 的 基 金 净 值 变 动 数 (净 值 减 少 以 “-” 号 填 列)	139,465,554.02	-	344,214,054.61	483,679,608.63
其中：1. 基 金 申 购 款	519,250,754.35	-	1,100,489,817.47	1,619,740,571.82
2 .基 金 赎 回 款	-379,785,200.33	-	-756,275,762.86	-1,136,060,963.19
(三)、 本 期 向 基 金 份 额 持 有 人 分 配 利 润 产 生 的 基 金 净 值 变 动 (净 值 减 少 以 “-” 号 填 列)	-	-	-	-
(四)、 其 他 综	-	-	-	-

合收益 结转留 存收益				
四、本期 期末净 资产(基 金净值)	518,693,260.29	-	1,234,684,348.59	1,753,377,608.88

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：

经雷

梁凯

李袁

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

嘉实美国成长股票型证券投资基金(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[2013]14 号《关于核准嘉实美国成长股票型证券投资基金募集的批复》核准,由嘉实基金管理有限公司依照《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《嘉实美国成长股票型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。经向中国证监会备案,《嘉实美国成长股票型证券投资基金基金合同》于 2013 年 6 月 14 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 477,029,933.09 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实美国成长股票型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本报告期末的财务状况以

及本报告期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

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

新金融工具准则

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

(1) 金融资产

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

债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资、资产支持证券投资 and 基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

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

中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债的分类

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

(3) 衍生金融工具

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(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。

基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券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，在资产负债表中以交易性金融资产列示。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融资产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，在资产负债表中以衍生金融资产列示。

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。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的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，在资产负债表中以衍生金融负债列示。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

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产

支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息

继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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和金融负债，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。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和金融负债，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

基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资 and 衍生工具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。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。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。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在交易所在地适用的预缴所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利扣除基金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扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除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。基金投资在持有期间应取得的现金红利扣除基金交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算或者发行价计算的利息扣除在交易所在地适用的预缴所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

基金收益分配是指按规定将基金的可分配收益按基金份额进行比例分配。由于本基金两类基金份额类别分别以人民币和美元计价，两类基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同类别的每份基金份额享有同等分配权。基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，对某一基金份额类别，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利。如果基金份额持有人选择或默认选择现金分红形式，则美元份额以美元进行现金分红，人民币份额以人民币进行现金分红；如果选择红利再投资形式，则同一类别基金份额的分红资金将按除息日该类别的基金份额净值转成相应的同一类别的基金份额，红利再投资的份额免收申购费。在符合基金收益分配条件的情况下，本基金收益每年最多分配 6 次，各类基金份额收益分配比例分别不得低于收益分配基准日该类基金份额的可供分配利润的 10%。基

金收益分配后各类基金份额的每一基金份额净值分别不能低于其面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

7.4.4.13 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金无其他重要的会计政策和会计估计。

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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，财政部于 2022 年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》（财会[2022]14 号），中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、应收利息、应收股利和应收申购款，金额分别为 386,008,961.82 元、11,797.88 元、272,255.93 元和 7,464,249.19 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、其他资产-应收利息、应收股利和应收申购款，金额分别为 386,014,752.82 元、0.00 元、272,255.93 元和 7,470,256.07 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 1,651,141,851.14 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 1,651,141,851.14 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费和其他负债-其他应付款，金额分别为 255,695,400.05 元、32,855,556.73 元、2,202,834.89 元、428,329.00 元和 339,386.41 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费和其他负债-其他应付款，金额分别为 255,695,400.05 元、32,855,556.73 元、2,202,834.89 元、428,329.00 元和 339,386.41 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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其他收益，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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
活期存款	87,125,147.00	386,008,961.82
等于：本金	87,118,276.25	386,008,961.82
加：应计利息	6,870.75	-

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	87,125,147.00	386,008,961.82

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,071,640,818.16	-	1,170,442,138.35	98,801,320.19
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		12,640,892.79	-	11,558,521.89	-1,082,370.90
其他		-	-	-	-
合计		1,084,281,710.95	-	1,182,000,660.24	97,718,949.29
项目		上年度末 2021 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,216,642,531.14	-	1,648,245,698.91	431,603,167.77
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		2,964,217.86	-	2,896,152.23	-68,065.63

其他	-	-	-	-
合计	1,219,606,749.00	-	1,651,141,851.14	431,535,102.14

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	11,797.88
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	11,797.88

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	16,204.61	118,386.41
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	-	-
预提费用	221,000.00	221,000.00
合计	237,204.61	339,386.41

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	488,500,747.66	488,500,747.66
本期申购	283,378,126.10	283,378,126.10
本期赎回（以“-”号填列）	-329,315,019.18	-329,315,019.18
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	442,563,854.58	442,563,854.58

嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	4,902,802.17	30,192,512.63
本期申购	1,354,476.57	8,344,840.54
本期赎回（以“-”号填列）	-1,135,209.07	-6,989,851.90
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	5,122,069.67	31,547,501.27

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	328,137,384.25	835,626,477.98	1,163,763,862.23
本期利润	-14,819,682.18	-313,484,755.09	-328,304,437.27
本期基金份额交易产生的变动数	-31,109,384.54	-61,531,832.53	-92,641,217.07
其中：基金申购款	189,855,424.02	348,067,454.48	537,922,878.50
基金赎回款	-220,964,808.56	-409,599,287.01	-630,564,095.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	282,208,317.53	460,609,890.36	742,818,207.89

嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	23,805,681.19	47,114,805.17	70,920,486.36
本期利润	-1,033,428.96	-20,331,397.76	-21,364,826.72
本期基金份额交易产生的变动数	1,036,093.73	1,546,499.07	2,582,592.80
其中：基金申购款	6,563,885.86	9,369,984.10	15,933,869.96
基金赎回款	-5,527,792.13	-7,823,485.03	-13,351,277.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,808,345.96	28,329,906.48	52,138,252.44

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
活期存款利息收入	190,109.54	166,347.40
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	1,005.74	6,635.52
合计	191,115.28	172,982.92

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-8,917,711.44	96,704,140.53
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	-8,917,711.44	96,704,140.53

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出股票成交总额	956,989,568.11	538,449,476.80
减：卖出股票成本总额	964,925,766.23	441,745,336.27
减：交易费用	981,513.32	-
买卖股票差价收入	-8,917,711.44	96,704,140.53

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出/赎回基金成交总额	3,868,797.92	6,394,914.33
减：卖出/赎回基金成本总额	4,502,446.83	5,970,199.09

减：买卖基金差价收入应缴 纳增值税额	-	-
减：交易费用	11,366.32	-
基金投资收益	-645,015.23	424,715.24

7.4.7.16 债券投资收益

7.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

无。

7.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

7.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.17 资产支持证券投资收益

7.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.18 贵金属投资收益

7.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.19 衍生工具收益

7.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月 31日
股票投资产生的股利收益	15,521,474.56	7,186,380.92
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	45,686.01	7,723.22
合计	15,567,160.57	7,194,104.14

7.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
1. 交易性金融资产	-333,816,152.85	143,861,810.02
股票投资	-332,801,847.58	145,239,960.14
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-1,014,305.27	-1,378,150.12
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	-333,816,152.85	143,861,810.02

7.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
基金赎回费收入	1,165,857.05	1,381,215.36

合计	1,165,857.05	1,381,215.36
----	--------------	--------------

7.4.7.23 信用减值损失

无。

7.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
审计费用	101,000.00	101,000.00
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	6,281.61	18,082.27
交易费用	-	525,850.79
合计	227,281.61	764,933.06

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司（“嘉实基金”）	基金管理人
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
DWS Investments Singapore Limited	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
嘉实资本管理有限公司（“嘉实资本”）	基金管理人的控股子公司
嘉实财富管理有限公司（“嘉实财富”）	基金管理人的控股子公司

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 基金交易

无。

7.4.10.1.5 权证交易

无。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	24,668,322.80	20,462,353.64
其中：支付销售机构的客户维护费	8,210,184.77	6,837,928.35

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.80%/当年天数。2. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,796,618.23	3,978,791.02

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

无。

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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自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 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
中国银行股份有限公司 _活期	87,125,147.00	190,109.54	386,008,961.82	166,347.40

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本期(2022年1月1日至2022年12月31日),本基金未实施利润分配。

7.4.12 期末(2022年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金主要投资于美国大盘成长型股票，属于主动投资的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金与混合型基金，为证券投资基金中的较高预期风险、较高预期收益的投资品种。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。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主要投资于美国大盘成长型股票，在股票选择及组合构建等方面均运用量化投资方法并结合风险管理手段，力争获取长期资本增值。本基金的基金管理人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和 risk 管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

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

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

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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。

基金的银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均与授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算或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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照相关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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期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。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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，因此除附注

7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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。

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022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	87,125,147.00	-	-	-	87,125,147.00
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	1,182,000,660.24	1,182,000,660.24
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	1,895,547.95	1,895,547.95
应收申购款	-	-	-	6,808,639.22	6,808,639.22
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	87,125,147.00	-	-	-1,190,704,847.41	1,277,829,994.41
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	6,156,234.96	6,156,234.96
应付管理人报酬	-	-	-	1,983,130.05	1,983,130.05
应付托管费	-	-	-	385,608.61	385,608.61
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	-	-	-	237,204.61	237,204.61
负债总计	-	-	-	8,762,178.23	8,762,178.23
利率敏感度缺口	87,125,147.00	-	-	-1,181,942,669.18	1,269,067,816.18
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	386,008,961.82	-	-	-	386,008,961.82
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	1,651,141,851.14	1,651,141,851.14
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	272,255.93	272,255.93
应收申购款	-	-	-	7,464,249.19	7,464,249.19
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	11,797.88	11,797.88
资产总计	386,008,961.82	-	-	-1,658,890,154.14	2,044,899,115.96
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	-	-	-	255,695,400.05	255,695,400.05
应付赎回款	-	-	-	32,855,556.73	32,855,556.73
应付管理人报酬	-	-	-	2,202,834.89	2,202,834.89
应付托管费	-	-	-	428,329.00	428,329.00
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	-	-	-	339,386.41	339,386.41
负债总计	-	-	-	291,521,507.08	291,521,507.08
利率敏感度缺口	386,008,961.82	-	-	-1,367,368,647.06	1,753,377,608.88

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外币计价的资产和负债进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日			合计
	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	
以外币计价的资产				
银行存款	34,825,493.74	-	-	34,825,493.74
结算备付金	-	-	-	-

存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	1,182,000,660.24	-	-	1,182,000,660.24
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	1,895,547.95	-	-	1,895,547.95
应收申购款	94,267.60	-	-	94,267.60
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	1,218,815,969.53	-	-	1,218,815,969.53
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
应付赎回款	106,670.79	-	-	106,670.79
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
其他负债	402.00	-	-	402.00
负债合计	107,072.79	-	-	107,072.79
资产负债表外 汇风险敞口净额	1,218,708,896.74	-	-	1,218,708,896.74
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	美元	港币	其他币种	合计

	折合人民币元	折合人民币元	折合人民币元	
以外币计价的资产				
银行存款	299,734,747.33	-	-	299,734,747.33
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	1,651,141,851.14	-	-	1,651,141,851.14
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	272,255.93	-	-	272,255.93
应收申购款	101,847.85	-	-	101,847.85
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	1,237.72	-	-	1,237.72
资产合计	1,951,251,939.97	-	-	1,951,251,939.97
以外币计价的负债				
应付清算款	255,695,400.05	-	-	255,695,400.05
衍生金融负债	-	-	-	-
应付赎回款	9,443,645.02	-	-	9,443,645.02
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-

应付投资顾问费	-	-	-	-
其他负债	35,284.34	-	-	35,284.34
负债合计	265,174,329.41	-	-	265,174,329.41
资产负债表外 汇风险敞口净额	1,686,077,610.56	-	-	1,686,077,610.56

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	所有外币相对人民币升值 5%	60,935,444.84	84,303,880.53
	所有外币相对人民币贬值 5%	-60,935,444.84	-84,303,880.53

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。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、债券及基金，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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，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 2022年12月31日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	1,170,442,138.35	92.23	1,648,245,698.91	94.00

交易性金融资产—基金投资	11,558,521.89	0.91	2,896,152.23	0.17
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	1,182,000,660.24	93.14	1,651,141,851.14	94.17

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	59,618,884.11	94,845,261.59
	业绩比较基准下降5%	-59,618,884.11	-94,845,261.59

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	1,182,000,660.24	1,651,141,851.14
第二层次	-	-

第三层次	-	-
合计	1,182,000,660.24	1,651,141,851.14

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

无。

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

无。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债（上年度末：无）。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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

原“应收利息”、“其他资产”项目，合并列示在“其他资产”项目；

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

原“交易费用”、“其他费用”项目，合并列示在“其他费用”项目。

§ 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	1,170,442,138.35	91.60
	其中：普通股	1,150,631,903.01	90.05
	存托凭证	15,067,573.48	1.18
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	4,742,661.86	0.37
2	基金投资	11,558,521.89	0.90
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	87,125,147.00	6.82
8	其他各项资产	8,704,187.17	0.68
9	合计	1,277,829,994.41	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	1,170,442,138.35	92.23
合计	1,170,442,138.35	92.23

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
信息技术	458,576,021.61	36.13
非必需消费品	173,611,545.49	13.68
医疗保健	144,426,744.32	11.38
通信服务	77,841,607.63	6.13
金融	64,240,635.31	5.06
能源	67,565,935.70	5.32
必需消费品	68,595,375.92	5.41
工业	86,624,864.10	6.83
原材料	20,613,425.49	1.62
公用事业	3,210,329.37	0.25
房地产	392,991.55	0.03
房地产信托特殊类	1,080,696.56	0.09
房地产信托零售类	2,323,744.79	0.18

房地产信托工业类	1,114,584.84	0.09
房地产信托住宅类	98,403.53	0.01
房地产信托抵押类	125,232.14	0.01
合计	1,170,442,138.35	92.23

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代 码	所在证 券市场	所属 国家 (地 区)	数量 (股)	公允价值	占基 金资 产净 值比 例(%)
1	Apple Inc	苹果公司	AAPL UW	纳斯达克 证券交易 所	美国	124,048	112,252,334.97	8.85
2	Microsoft Corp	微软公司	MSFT UW	纳斯达克 证券交易 所	美国	66,615	111,263,728.53	8.77
3	Alphabet Inc	Alphabet 公司	GOOGL UW	纳斯达克 证券交易 所	美国	80,477	49,452,042.78	3.90
4	Amazon.com Inc	亚马逊 公司	AMZN UW	纳斯达克 证券交易 所	美国	70,257	41,102,199.78	3.24
5	NVIDIA Corp	英伟达	NVDA UW	纳斯达克 证券交易 所	美国	25,884	26,344,907.17	2.08
6	UnitedHealth Group Inc	联合健 康集团	UNH UN	纽约证 券交易 所	美国	6,202	22,900,833.08	1.80
7	Eli Lilly & Co	礼来	LLY UN	纽约证 券交易 所	美国	7,857	20,019,080.23	1.58
8	AbbVie Inc	艾伯维 公司	ABBV UN	纽约证 券交易 所	美国	16,836	18,949,743.07	1.49
9	Visa Inc	维萨公 司	V UN	纽约证 券交易 所	美国	12,879	18,635,466.05	1.47
10	Broadcom Inc	博通股 份有限 公司	AVGO UW	纳斯 达克证 券交易 所	美国	4,758	18,528,207.72	1.46
11	Tesla Inc	特斯拉	TSLA UW	纳斯 达克	美国	21,521	18,462,853.59	1.45

		公司		克证券 交易所				
12	Mastercard Inc	万事达股份有限公司	MA UN	纽约证 券交易 所	美国	7,063	17,105,175.93	1.35
13	Costco Wholesale Corp	开市客	COST UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	5,203	16,542,105.50	1.30
14	Home Depot Inc/The	家得宝	HD UN	纽约证 券交易 所	美国	6,098	13,414,615.51	1.06
15	Coca-Cola Co/The	可口可 乐	KO UN	纽约证 券交易 所	美国	28,538	12,642,853.56	1.00
16	PepsiCo Inc	百事可 乐	PEP UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	8,111	10,205,460.02	0.80
17	Lockheed Martin Corp	洛克希 德马丁	LMT UN	纽约证 券交易 所	美国	2,909	9,856,297.81	0.78
18	Netflix Inc	奈飞公 司	NFLX UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,412	9,061,018.15	0.71
19	Amgen Inc	AMGEN- T	AMGN UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,931	9,019,699.12	0.71
20	Oracle Corp	甲骨文	ORCL UN	纽约证 券交易 所	美国	15,266	8,690,726.24	0.68
21	Merck & Co Inc	默克	MRK UN	纽约证 券交易 所	美国	10,987	8,489,900.68	0.67
22	CVS Health Corp	CVS 健 康公司	CVS UN	纽约证 券交易 所	美国	12,852	8,341,347.36	0.66
23	NIKE Inc	耐克公 司	NKE UN	纽约证 券交易 所	美国	10,136	8,260,108.65	0.65
24	Lowe's Cos Inc	劳氏	LOW UN	纽约证 券交易 所	美国	5,866	8,139,819.42	0.64
25	McKesson Corp	McKesson 公 司	MCK UN	纽约证 券交易 所	美国	3,015	7,876,870.67	0.62

26	Chevron Corp	雪佛龙	CVX UN	纽约证券交易所	美国	6,031	7,539,208.68	0.59
27	Advanced Micro Devices Inc	AMD 公司	AMD UW	纳斯达克证券交易所	美国	16,137	7,279,354.58	0.57
28	Berkshire Hathaway Inc	伯克希尔哈撒韦公司	BRK/B UN	纽约证券交易所	美国	3,362	7,232,888.93	0.57
29	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM UW	纳斯达克证券交易所	美国	8,732	6,685,988.70	0.53
30	Exxon Mobil Corp	埃克森美孚石油公司	XOM UN	纽约证券交易所	美国	8,317	6,389,080.98	0.50
31	Starbucks Corp	星巴克公司	SBUX UW	纳斯达克证券交易所	美国	9,214	6,365,844.98	0.50
32	Adobe Inc	奥多比	ADBE UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,535	5,941,524.98	0.47
33	Ameriprise Financial Inc	阿默普莱斯金融公司	AMP UN	纽约证券交易所	美国	2,644	5,733,692.48	0.45
34	Texas Instruments Inc	德州仪器	TXN UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,902	5,640,688.32	0.44
35	Deere & Co	迪尔	DE UN	纽约证券交易所	美国	1,850	5,524,362.51	0.44
36	Vertex Pharmaceuticals Inc	福泰制药	VRTX UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,721	5,472,576.39	0.43
37	Boeing Co/The	波音	BA UN	纽约证券交易所	美国	4,108	5,450,028.77	0.43
38	Caterpillar Inc	卡特彼勒	CAT UN	纽约证券交易所	美国	3,212	5,359,027.92	0.42
39	Applied Materials	应用材料	AMAT UW	纳斯达克证券交易所	美国	7,321	4,965,195.53	0.39

	Inc			交易所				
40	Archer-Daniels-Midland Co	Archer-Daniels-Midland 公司	ADM UN	纽约证券交易所	美国	7,673	4,961,846.04	0.39
41	Humana Inc	Humana 股份有限公司	HUM UN	纽约证券交易所	美国	1,370	4,887,061.91	0.39
42	TJX Cos Inc/The	TJX 公司	TJX UN	纽约证券交易所	美国	8,589	4,761,588.37	0.38
43	KLA Corp	KLA 公司	KLAC UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,801	4,729,179.51	0.37
44	ON Semiconductor Corp	安森美半导体公司	ON UW	纳斯达克证券交易所	美国	10,514	4,567,093.42	0.36
45	Goldman Sachs Group Inc/The	高盛	GS UN	纽约证券交易所	美国	1,889	4,517,551.71	0.36
46	Intuit Inc	Intuit 股份有限公司	INTU UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,662	4,505,285.80	0.36
47	Albertsons Cos Inc	艾伯森股份有限公司	ACI UN	纽约证券交易所	美国	30,334	4,381,619.02	0.35
48	Dillard's Inc	Dillard's 公司	DDS UN	纽约证券交易所	美国	1,927	4,337,597.45	0.34
49	Cheniere Energy Inc	Cheniere 能源公司	LNG UA	纽约证券交易所	美国	4,138	4,321,774.44	0.34
50	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	3,663	4,098,140.02	0.32
51	United Parcel Service Inc	联合包裹服务股份有限公司	UPS UN	纽约证券交易所	美国	3,334	4,036,560.70	0.32
52	General	通用磨	GIS UN	纽约证	美国	6,520	3,807,560.75	0.30

	Mills Inc	坊		券交易所				
53	American Express Co	美国运通	AXP UN	纽约证券交易所	美国	3,685	3,791,937.41	0.30
54	Marathon Petroleum Corp	马拉松石油公司	MPC UN	纽约证券交易所	美国	4,677	3,791,222.01	0.30
55	McDonald's Corp	麦当劳	MCD UN	纽约证券交易所	美国	2,035	3,735,000.41	0.29
56	AutoZone Inc	AutoZone 股份有限公司	AZO UN	纽约证券交易所	美国	217	3,727,182.72	0.29
57	Lam Research Corp	泛林集团	LRCX UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,256	3,676,590.05	0.29
58	Hess Corp	赫斯公司	HES UN	纽约证券交易所	美国	3,524	3,480,723.77	0.27
59	Freeport-McMoRan Inc	自由港迈克墨伦股份有限公司	FCX UN	纽约证券交易所	美国	12,950	3,427,279.66	0.27
60	Matador Resources Co	Matador 资源公司	MTDR UN	纽约证券交易所	美国	8,511	3,392,941.67	0.27
61	EOG Resources Inc	EOG 资源	EOG UN	纽约证券交易所	美国	3,560	3,211,315.77	0.25
62	Synopsys Inc	新思科技公司	SNPS UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,443	3,208,838.25	0.25
63	O'Reilly Automotive Inc	O'Reilly 汽车股份有限公司	ORLY UW	纳斯达克证券交易所	美国	543	3,191,933.92	0.25
64	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	221	3,101,871.82	0.24
65	Rambus	Rambus	RMBS UW	纳斯达克	美国	12,401	3,093,701.92	0.24

	Inc	股份有限公司		克证券交易所				
66	Royal Caribbean Cruises Ltd	皇家加勒比国际游轮有限公司	RCL UN	纽约证券交易所	美国	8,777	3,021,571.58	0.24
67	Accenture PLC	埃森哲公司	ACN UN	纽约证券交易所	美国	1,613	2,997,653.82	0.24
68	Bristol-Myers Squibb Co	百时美施贵宝公司	BMJ UN	纽约证券交易所	美国	5,880	2,946,485.46	0.23
69	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	5,958	2,915,029.85	0.23
70	Meta Platforms Inc	Meta 平台股份有限公司	META UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,421	2,867,208.40	0.23
71	Principal Financial Group Inc	信安金融	PFG UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,814	2,813,634.88	0.22
72	General Dynamics Corp	通用动力	GD UN	纽约证券交易所	美国	1,610	2,782,058.92	0.22
73	Union Pacific Corp	联合太平洋	UNP UN	纽约证券交易所	美国	1,924	2,774,715.31	0.22
74	ASML Holding NV	阿斯麦控股公司	ASML UW	纳斯达克证券交易所	美国	727	2,766,567.56	0.22
75	Automatic Data Processing Inc	ADP 公司	ADP UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,632	2,714,937.03	0.21
76	Activision Blizzard Inc	动视暴雪股份有限公司	ATVI UW	纳斯达克证券交易所	美国	5,038	2,685,959.97	0.21
77	Marathon Oil Corp	Marathon 石油公司	MRO UN	纽约证券交易所	美国	14,213	2,679,601.36	0.21

78	Ovintiv Inc	Ovintiv 股份有限公司	OVV UN	纽约证券交易所	美国	7,468	2,637,509.90	0.21
79	General Electric Co	通用电气	GE UN	纽约证券交易所	美国	4,412	2,574,683.64	0.20
80	Quanta Services Inc	Quanta 服务股份有限公司	PWR UN	纽约证券交易所	美国	2,555	2,535,723.80	0.20
81	Arista Networks Inc	Arista 网络股份有限公司	ANET UN	纽约证券交易所	美国	2,962	2,503,346.77	0.20
82	Marriott International Inc/MD	万豪国际	MAR UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,407	2,495,961.02	0.20
83	Lattice Semiconductor Corp	莱迪斯半导体公司	LSCC UW	纳斯达克证券交易所	美国	5,485	2,478,469.92	0.20
84	Capri Holdings Ltd	Capri 控股有限公司	CPRI UN	纽约证券交易所	美国	6,154	2,456,743.71	0.19
85	Chesapeake Energy Corp	切萨皮克能源公司	CHK UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,726	2,448,910.90	0.19
86	NXP Semiconductors NV	恩智浦半导体公司	NXPI UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,218	2,441,165.71	0.19
87	APA Corp	APA	APA UW	纳斯达克证券交易所	美国	7,505	2,439,932.00	0.19
88	Pfizer Inc	辉瑞制药	PFE UN	纽约证券交易所	美国	6,757	2,411,344.26	0.19
89	Xponential Fitness Inc	Xponential Fitness Inc	XPOF UN	纽约证券交易所	美国	14,670	2,342,773.74	0.18
90	Agilent Technologies Inc	安捷伦	A UN	纽约证券交易所	美国	2,207	2,300,251.02	0.18

91	Cigna Corp	信诺集团	CI UN	纽约证券交易所	美国	990	2,284,574.06	0.18
92	Occidental Petroleum Corp	西方石油	OXY UN	纽约证券交易所	美国	5,182	2,273,344.20	0.18
93	United Rentals Inc	联合租赁公司	URI UN	纽约证券交易所	美国	915	2,264,952.69	0.18
94	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	132	2,155,114.40	0.17
95	HCA Healthcare Inc	HCA 医疗保健有限公司	HCA UN	纽约证券交易所	美国	1,288	2,152,538.34	0.17
96	Arch Capital Group Ltd	阿契资本集团	ACGL UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,902	2,143,338.66	0.17
97	Regeneron Pharmaceuticals Inc	再生元制药股份有限公司	REGN UW	纳斯达克证券交易所	美国	419	2,105,428.60	0.17
98	Moody's Corp	穆迪	MCO UN	纽约证券交易所	美国	1,070	2,076,310.23	0.16
99	Motorola Solutions Inc	摩托罗拉解决方案股份有限公司	MSI UN	纽约证券交易所	美国	1,150	2,064,074.13	0.16
100	H&R Block Inc	H&R Block 股份有限公司	HRB UN	纽约证券交易所	美国	8,089	2,056,851.07	0.16
101	Progressive Corp/The	前进保险公司	PGR UN	纽约证券交易所	美国	2,248	2,030,794.34	0.16
102	Gartner Inc	Gartner 公司	IT UN	纽约证券交易所	美国	860	2,013,329.35	0.16
103	S&P	标普全	SPGI UN	纽约证	美国	853	1,989,812.82	0.16

3	Global Inc	球		券交易所				
104	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	1,075	1,983,740.95	0.16
105	American International Group Inc	美国国际集团	AIG UN	纽约证券交易所	美国	4,501	1,982,426.31	0.16
106	Dexcom Inc	Dexcom 股份有限公司	DXCM UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,513	1,981,930.99	0.16
107	Pinduoduo Inc	拼多多	PDD UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,488	1,981,055.40	0.16
108	Magnolia Oil & Gas Corp	Magnolia Oil & Gas Corp	MGY UN	纽约证券交易所	美国	12,044	1,967,024.51	0.15
109	Mettler-Toledo International Inc	梅特勒-托利多国际股份有限公司	MTD UN	纽约证券交易所	美国	195	1,963,061.31	0.15
110	Ryder System Inc	莱德系统股份有限公司	R UN	纽约证券交易所	美国	3,311	1,927,106.70	0.15
111	Halliburton Co	哈利伯顿	HAL UN	纽约证券交易所	美国	6,888	1,887,704.68	0.15
112	Pioneer Natural Resources Co	Pioneer 自然资源公司	PXD UN	纽约证券交易所	美国	1,186	1,886,504.96	0.15
113	Crocs Inc	卡骆驰股份有限公司	CROX UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,479	1,872,070.34	0.15
114	ServiceNow Inc	ServiceNow 公司	NOW UN	纽约证券交易所	美国	687	1,857,747.78	0.15
115	Booz Allen	博思艾伦咨询	BAH UN	纽约证券交易所	美国	2,551	1,856,974.92	0.15

	Hamilton Holding Corp	控股公司		所				
116	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	台积电	TSM UN	纽约证券交易所	美国	3,562	1,847,940.86	0.15
117	Moderna Inc	莫德纳公司	MRNA UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,474	1,843,946.66	0.15
118	Datadog Inc	Datadog 股份有限公司	DDOG UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,545	1,814,678.76	0.14
119	CDW Corp/DE	特拉华 CDW 公司	CDW UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,432	1,781,033.20	0.14
120	PVH Corp	PVH 公司	PVH UN	纽约证券交易所	美国	3,595	1,767,413.85	0.14
121	Block Inc	Block 股份有限公司	SQ UN	纽约证券交易所	美国	4,030	1,763,751.52	0.14
122	Hilton Grand Vacations Inc	希尔顿度假酒店集团	HGV UN	纽约证券交易所	美国	6,559	1,760,538.47	0.14
123	Caesars Entertainment Inc	凯撒娱乐集团	CZR UW	纳斯达克证券交易所	美国	6,021	1,744,448.43	0.14
124	Trip.com Group Ltd	携程集团	TCOM UW	纳斯达克证券交易所	美国	7,269	1,741,523.30	0.14
125	Elevance Health Inc	Elevance 健康股份有限公司	ELV UN	纽约证券交易所	美国	483	1,725,580.71	0.14
126	Trade Desk Inc/The	Trade Desk 股份有限公司	TTD UQ	纳斯达克证券交易所	美国	5,497	1,716,289.93	0.14
12	ExlService	ExlSer	EXLS UW	纳斯达克	美国	1,436	1,694,497.49	0.13

7	e Holdings Inc	vice 控股公司		克证券交易所				
128	Analog Devices Inc	亚德诺半导体	ADI UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,472	1,681,617.71	0.13
129	Tapestry Inc	TPR-DR S-RS	TPR UN	纽约证券交易所	美国	6,319	1,675,874.43	0.13
130	Workday Inc	Workday 股份有限公司	WDAY UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,426	1,661,841.17	0.13
131	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	3,739	1,661,132.39	0.13
132	GLOBALFOUNDRIES Inc	格罗方德半导体股份有限公司	GFS UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,392	1,648,415.52	0.13
133	Veritiv Corp	Veritiv 有限公司	VRTV UN	纽约证券交易所	美国	1,940	1,644,463.24	0.13
134	Macy's Inc	梅西百货股份有限公司	M UN	纽约证券交易所	美国	11,391	1,638,242.12	0.13
135	PDC Energy Inc	PDC 能源股份有限公司	PDCE UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,694	1,633,164.71	0.13
136	Simon Property Group Inc	西蒙房地产集团公司	SPG UN	纽约证券交易所	美国	1,986	1,624,947.60	0.13
137	Hub Group Inc	中心集团	HUBG UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,876	1,592,199.77	0.13
138	Honeywell International Inc	霍尼韦尔	HON UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,059	1,580,572.09	0.12
13	Nucor	纽柯公	NUE UN	纽约证	美国	1,721	1,579,884.76	0.12

9	Corp	司		券交易 所				
14 0	Keysight Technolog ies Inc	是德科 技公司	KEYS UN	纽约证 券交易 所	美国	1,307	1,557,204.40	0.12
14 1	Amphenol Corp	安费诺 公司	APH UN	纽约证 券交易 所	美国	2,925	1,551,082.58	0.12
14 2	Intuitive Surgical Inc	直觉外 科手术 公司	ISRG UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	833	1,539,431.16	0.12
14 3	Bunge Ltd	邦吉有 限公司	BG UN	纽约证 券交易 所	美国	2,205	1,532,162.20	0.12
14 4	Sanmina Corp	Sanmin a 公司	SANM UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,802	1,517,005.35	0.12
14 5	WEX Inc	WEX 股 份有限 公司	WEX UN	纽约证 券交易 所	美国	1,326	1,511,317.50	0.12
14 6	HP Inc	惠普	HPQ UN	纽约证 券交易 所	美国	8,058	1,507,964.47	0.12
14 7	Commercia l Metals Co	美国商 业金属 公司	CMC UN	纽约证 券交易 所	美国	4,443	1,494,581.57	0.12
14 8	3M Co	3M 公司	MMM UN	纽约证 券交易 所	美国	1,784	1,489,987.58	0.12
14 9	Baidu Inc	百度	BIDU UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,870	1,489,662.47	0.12
15 0	Schlumber ger Ltd	斯伦贝 谢有限 公司	SLB UN	纽约证 券交易 所	美国	3,956	1,472,927.65	0.12
15 1	MSCI Inc	MSCI 明晟	MSCI UN	纽约证 券交易 所	美国	449	1,454,635.62	0.11
15 2	Morgan Stanley	摩根士 丹利	MS UN	纽约证 券交易 所	美国	2,421	1,433,547.44	0.11
15 3	Cisco Systems Inc	思科系 统股份 有限公	CSCO UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,310	1,430,030.17	0.11

		司						
154	Wynn Resorts Ltd	永利渡假村有限公司	WYNN UN	纳斯达克证券交易所	美国	2,436	1,399,166.69	0.11
155	VMware Inc	VMware 股份有限公司	VMW UN	纽约证券交易所	美国	1,631	1,394,463.08	0.11
156	Colgate-Palmolive Co	高露洁棕榄	CL UN	纽约证券交易所	美国	2,535	1,391,058.01	0.11
157	NetEase Inc	网易	NTES UN	纳斯达克证券交易所	美国	2,732	1,381,951.87	0.11
158	Applied Industrial Technologies Inc	应用工业技术公司	AIT UN	纽约证券交易所	美国	1,569	1,377,187.46	0.11
159	Pure Storage Inc	Pure 储存股份有限公司	PSTG UN	纽约证券交易所	美国	7,379	1,375,244.12	0.11
160	Domino's Pizza Inc	达美乐披萨公司	DPZ UN	纽约证券交易所	美国	565	1,363,083.65	0.11
161	Procter & Gamble Co/The	宝洁	PG UN	纽约证券交易所	美国	1,281	1,352,165.67	0.11
162	Scotts Miracle-Gro Co/The	Scotts Miracle-Gro 公司	SMG UN	纽约证券交易所	美国	3,960	1,340,103.26	0.11
163	WW Grainger Inc	固安捷股份有限公司	GWV UN	纽约证券交易所	美国	345	1,336,550.27	0.11
164	Model N Inc	Model N 股份有限公司	MODN UN	纽约证券交易所	美国	4,708	1,329,935.50	0.10
165	Comcast Corp	康卡斯特公司	CMCSA UN	纳斯达克证券交易所	美国	5,455	1,328,576.50	0.10
166	Fair Isaac Corp	费埃哲公司	FICO UN	纽约证券交易所	美国	317	1,321,531.87	0.10

167	Las Vegas Sands Corp	拉斯维加斯金沙集团	LVS UN	纽约证券交易所	美国	3,876	1,297,639.54	0.10
168	DocuSign Inc	DocuSign 股份有限公司	DOCU UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,354	1,294,570.65	0.10
169	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	1,340	1,276,508.10	0.10
170	Walgreens Boots Alliance Inc	沃博联股份有限公司	WBA UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,900	1,274,967.53	0.10
171	ChampionX Corp	ChampionX 公司	CHX UW	纳斯达克证券交易所	美国	6,281	1,268,157.48	0.10
172	Coca-Cola Consolidated Inc	可口可乐装瓶有限公司	COKE UW	纳斯达克证券交易所	美国	351	1,252,502.24	0.10
173	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	1,542	1,246,523.69	0.10
174	Super Micro Computer Inc	Super Micro Computer 股份有限公司	SMCI UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,171	1,241,364.04	0.10
175	Paychex Inc	Paychex 公司	PAYX UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,530	1,231,388.64	0.10
176	ConocoPhillips	康菲石油	COP UN	纽约证券交易所	美国	1,489	1,223,694.15	0.10
177	Tetra Tech Inc	Tetra 科技股份有限公司	TTEK UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,205	1,218,484.28	0.10
178	Constellation	美国联合能源	CEG UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,016	1,210,443.02	0.10

	Energy Corp	公司		交易所				
179	JPMorgan Chase & Co	摩根大通	JPM UN	纽约证券交易所	美国	1,288	1,202,931.28	0.09
180	Gilead Sciences Inc	吉利德科学	GILD UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,975	1,180,874.05	0.09
181	Bilibili Inc	哔哩哔哩	BILI UW	纳斯达克证券交易所	美国	7,123	1,175,233.56	0.09
182	Trane Technologies PLC	特灵科技公共有限公司	TT UN	纽约证券交易所	美国	1,000	1,170,679.61	0.09
183	Antero Resources Corp	Antero 资源公司	AR UN	纽约证券交易所	美国	5,409	1,167,440.45	0.09
184	Valaris Ltd	Valaris 有限公司	VAL UN	纽约证券交易所	美国	2,473	1,164,650.08	0.09
185	Avnet Inc	安富利股份有限公司	AVT UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,010	1,161,248.15	0.09
186	Phillips 66	Phillips 66	PSX UN	纽约证券交易所	美国	1,579	1,144,578.52	0.09
187	Exelon Corp	Exelon 公司	EXC UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,763	1,132,962.75	0.09
188	Amkor Technology Inc	安靠技术公司	AMKR UW	纳斯达克证券交易所	美国	6,629	1,107,116.63	0.09
189	Onto Innovation Inc	Onto 创新股份有限公司	ONTO UN	纽约证券交易所	美国	2,299	1,090,230.89	0.09
190	FMC Corp	FMC 公司	FMC UN	纽约证券交易所	美国	1,252	1,088,215.96	0.09
191	Johnson Controls International plc	江森自控国际有限公司	JCI UN	纽约证券交易所	美国	2,429	1,082,688.86	0.09

19 2	Foot Locker Inc	富乐客公司	FL UN	纽约证券交易所	美国	4,100	1,079,088.16	0.09
19 3	Ralph Lauren Corp	拉夫劳伦	RL UN	纽约证券交易所	美国	1,437	1,057,559.12	0.08
19 4	DoorDash Inc	DoorDash 股份有限公司	DASH UN	纽约证券交易所	美国	3,105	1,055,736.55	0.08
19 5	Hancock Whitney Corp	Hancock Whitney 公司	HWC UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,126	1,053,515.12	0.08
19 6	BrightSphere Investment Group Inc	BrightSphere 投资集团有限公司	BSIG UN	纽约证券交易所	美国	7,265	1,041,303.12	0.08
19 7	Spirit Airlines Inc	Spirit 航空股份有限公司	SAVE UN	纽约证券交易所	美国	7,655	1,038,556.97	0.08
19 8	Jabil Inc	捷普集团	JBL UN	纽约证券交易所	美国	2,163	1,027,394.11	0.08
19 9	ANSYS Inc	ANSYS 股份有限公司	ANSS UW	纳斯达克证券交易所	美国	606	1,019,642.09	0.08
20 0	Murphy Oil Corp	墨菲石油公司	MUR UN	纽约证券交易所	美国	3,401	1,018,760.86	0.08
20 1	MetLife Inc	大都会集团	MET UN	纽约证券交易所	美国	1,979	997,471.61	0.08
20 2	Etsy Inc	Etsy 股份有限公司	ETSY UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,194	996,058.43	0.08
20 3	Teleflex Inc	泰利福公司	TFX UN	纽约证券交易所	美国	567	985,770.95	0.08
20 4	Novanta Inc	Novanta 股份有限公司	NOVT UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,040	984,131.41	0.08

		司						
20 5	Ulta Beauty Inc	Ulta 美 容产品 公司	ULTA UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	301	983,332.36	0.08
20 6	Calix Inc	Calix 公司	CALX UN	纽约证 券交易 所	美国	2,056	979,864.06	0.08
20 7	Estee Lauder Cos Inc/The	雅诗兰 黛	EL UN	纽约证 券交易 所	美国	566	978,040.59	0.08
20 8	Altria Group Inc	高特利	MO UN	纽约证 券交易 所	美国	3,028	963,969.45	0.08
20 9	Olin Corp	奥林公 司	OLN UN	纽约证 券交易 所	美国	2,614	963,797.29	0.08
21 0	MACOM Te chnology Solutio ns Hol dings In c	MACOM 技术解 决方案 控股股 份有限 公司	MTSI UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,181	956,653.14	0.08
21 1	Philip Morris Internati onal Inc	菲利普 莫里斯 国际集 团公司	PM UN	纽约证 券交易 所	美国	1,357	956,531.88	0.08
21 2	Nutanix Inc	Nutani x 股份 有限公司	NTNX UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	5,247	951,951.82	0.08
21 3	Nexstar Media Group Inc	Nexsta r 媒体 集团股 份有限 公司	NXST UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	778	948,392.84	0.07
21 4	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	1,498	932,290.27	0.07
21 5	MongoDB Inc	MongoD B 股份 有限公司	MDB UQ	纳斯达 克证券 交易所	美国	661	906,172.74	0.07

216	Atlas Air Worldwide Holdings Inc	阿特拉斯航空全球控股有限公司	AAWW UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,284	901,408.68	0.07
217	Five9 Inc	Five9 公司	FIVN UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,873	885,213.06	0.07
218	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	3,369	884,582.90	0.07
219	Cintas Corp	CINTAS 公司	CTAS UW	纳斯达克证券交易所	美国	281	883,844.10	0.07
220	Bank of America Corp	美国银行公司	BAC UN	纽约证券交易所	美国	3,819	880,919.38	0.07
221	Array Technologies Inc	Array Technologies 股份有限公司	ARRY UQ	纳斯达克证券交易所	美国	6,534	879,644.44	0.07
222	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	2,052	876,774.89	0.07
223	Neurocrine Biosciences Inc	Neurocrine 生物科学股份有限公司	NBIX UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,053	875,939.97	0.07
224	Teradata Corp	美商天睿信息系统有限公司	TDC UN	纽约证券交易所	美国	3,718	871,604.93	0.07
225	Omnicom Group Inc	Omnicom 集团	OMC UN	纽约证券交易所	美国	1,531	869,764.81	0.07
226	Stifel Financial Corp	斯迪富融资公司	SF UN	纽约证券交易所	美国	2,120	861,830.25	0.07
227	PNC Financial Services	PNC 财务服务	PNC UN	纽约证券交易所	美国	778	855,791.38	0.07

	Services Group Inc/The			所				
228	Axis Capital Holdings Ltd	阿克西斯资本控股有限公司	AXS UN	纽约证券交易所	美国	2,267	855,276.49	0.07
229	Aon PLC	怡安集团	AON UN	纽约证券交易所	美国	408	852,864.86	0.07
230	Chubb Ltd	邱博保险集团	CB UN	纽约证券交易所	美国	553	849,624.09	0.07
231	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	3,098	849,460.14	0.07
232	ONEOK Inc	Oneok 股份有限公司	OKE UN	纽约证券交易所	美国	1,845	844,224.44	0.07
233	Juniper Networks Inc	瞻博网络股份有限公司	JNPR UN	纽约证券交易所	美国	3,760	836,933.20	0.07
234	Chipotle Mexican Grill Inc	Chipotle Mexican Grill 股份有限公司	CMG UN	纽约证券交易所	美国	86	831,044.91	0.07
235	Teradyne Inc	泰瑞达	TER UN	纳斯达克证券交易所	美国	1,362	828,583.34	0.07
236	State Street Corp	道富集团	STT UN	纽约证券交易所	美国	1,529	826,033.11	0.07
237	Skechers USA Inc	斯凯奇美国公司	SKX UN	纽约证券交易所	美国	2,804	819,230.58	0.06
238	Dell Technologies Inc	戴尔科技公司	DELL UN	纽约证券交易所	美国	2,918	817,379.11	0.06
239	Herc Holdings	Herc 控股公司	HRI UN	纽约证券交易所	美国	887	812,786.86	0.06

	Inc			所				
24 0	PerkinElmer Inc	珀金埃尔默	PKI UN	纽约证券交易所	美国	824	804,698.80	0.06
24 1	Linde PLC	林德公共有限公司	LIN UN	纽约证券交易所	美国	344	781,469.35	0.06
24 2	Under Armour Inc	安德玛股份有限公司	UAA UN	纽约证券交易所	美国	11,025	780,132.70	0.06
24 3	Aspen Technology Inc	艾斯本技术有限公司	AZPN UW	纳斯达克证券交易所	美国	541	773,916.10	0.06
24 4	Boston Scientific Corp	波士顿科学	BSX UN	纽约证券交易所	美国	2,397	772,438.14	0.06
24 5	Affiliated Managers Group Inc	Affiliated Managers 集团股份有限公司	AMG UN	纽约证券交易所	美国	696	767,967.50	0.06
24 6	Tractor Supply Co	拖拉机供应公司	TSCO UW	纳斯达克证券交易所	美国	490	767,744.77	0.06
24 7	Eaton Corp PLC	伊顿	ETN UN	纽约证券交易所	美国	696	760,793.40	0.06
24 8	ZTO Express Cayman Inc	中通快递	ZTO UN	纽约证券交易所	美国	4,047	757,350.73	0.06
24 9	Targa Resources Corp	Targa 资源公司	TRGP UN	纽约证券交易所	美国	1,464	749,418.82	0.06
25 0	PBF Energy Inc	PBF 能源股份有限公司	PBF UN	纽约证券交易所	美国	2,631	747,247.12	0.06
25 1	Murphy USA Inc	Murphy 美国股份有限公司	MUSA UN	纽约证券交易所	美国	383	745,656.68	0.06
25	Hershey	好时公	HSY UN	纽约证	美国	461	743,497.31	0.06

2	Co/The	司		券交易 所				
25 3	Chegg Inc	Chegg 股份有 限公司	CHGG UN	纽约证 券交易 所	美国	4,196	738,476.87	0.06
25 4	Organon & Co	Organo n & Co	OGN UN	纽约证 券交易 所	美国	3,687	717,199.95	0.06
25 5	AECOM	AECOM 公司	ACM UN	纽约证 券交易 所	美国	1,206	713,353.19	0.06
25 6	Jefferies Financial Group Inc	杰富瑞 金融集 团	JEF UN	纽约证 券交易 所	美国	2,972	709,554.56	0.06
25 7	elf Beauty Inc	elf Beauty 股份有 限公司	ELF UN	纽约证 券交易 所	美国	1,834	706,351.12	0.06
25 8	Tencent Holdings Ltd	腾讯控 股	TCEHY UV	纽约证 券交易 所	美国	2,393	705,983.95	0.06
25 9	Southern Copper Corp	南方铜 业公司	SCCO UN	纽约证 券交易 所	美国	1,661	698,603.63	0.06
26 0	Walt Disney Co/The	华特迪 士尼公 司	DIS UN	纽约证 券交易 所	美国	1,144	692,216.61	0.05
26 1	EMCOR Group Inc	埃姆科 集团公 司	EME UN	纽约证 券交易 所	美国	670	691,123.03	0.05
26 2	AT&T Inc	美国电 话电报 公司	T UN	纽约证 券交易 所	美国	5,382	690,070.82	0.05
26 3	Expedito rs Intern ational of Was hington Inc	华盛顿 康捷国 际物流 公司	EXPD UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	953	689,744.45	0.05
26 4	Biogen Inc	百健	BIIB UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	357	688,523.42	0.05
26 5	Bruker Corp	布鲁克 公司	BRKR UW	纳斯达 克证券	美国	1,423	677,391.27	0.05

				交易所				
266	CF Industries Holdings Inc	CF 工业控股股份有限公司	CF UN	纽约证券交易所	美国	1,138	675,270.90	0.05
267	Fluor Corp	福陆	FLR UN	纽约证券交易所	美国	2,789	673,245.18	0.05
268	Dow Inc	陶氏公司	DOW UN	纽约证券交易所	美国	1,899	666,446.82	0.05
269	Alnylam Pharmaceuticals Inc	Alnylam 制药股份有限公司	ALNY UW	纳斯达克证券交易所	美国	401	663,710.01	0.05
270	DuPont de Nemours Inc	杜邦公司	DD UN	纽约证券交易所	美国	1,386	662,480.97	0.05
271	Iron Mountain Inc	美国铁山公司	IRM UN	纽约证券交易所	美国	1,908	662,429.57	0.05
272	Science Applications International Corp	科学应用国际公司	SAIC UN	纽约证券交易所	美国	855	660,558.53	0.05
273	Celanese Corp	塞拉尼斯公司	CE UN	纽约证券交易所	美国	922	656,519.97	0.05
274	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴巴	BABA UN	纽约证券交易所	美国	1,070	656,457.43	0.05
275	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	1,074	655,246.28	0.05
276	Comfort Systems USA Inc	美国舒适系统公司	FIX UN	纽约证券交易所	美国	809	648,402.31	0.05
277	Genuine Parts Co	原配部件	GPC UN	纽约证券交易所	美国	536	647,717.27	0.05

278	Ingersoll Rand Inc	英格索兰股份有限公司	IR UN	纽约证券交易所	美国	1,779	647,378.72	0.05
279	Sprouts Farmers Market Inc	Sprouts Farmers Market 股份有限公司	SFM UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,861	644,995.58	0.05
280	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	1,299	644,328.44	0.05
281	Univar Solutions Inc	尤尼威尔解决方案股份有限公司	UNVR UN	纽约证券交易所	美国	2,908	644,047.21	0.05
282	Sherwin-Williams Co/The	宣伟公司	SHW UN	纽约证券交易所	美国	388	641,328.50	0.05
283	Walmart Inc	沃尔玛股份有限公司	WMT UN	纽约证券交易所	美国	648	639,906.89	0.05
284	Splunk Inc	Splunk 公司	SPLK UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,065	638,555.27	0.05
285	Wintrust Financial Corp	Wintrust 金融公司	WTFC UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,081	636,328.48	0.05
286	US Bancorp	美国合众银行	USB UN	纽约证券交易所	美国	2,093	635,698.95	0.05
287	eBay Inc	eBay 公司	EBAY UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,198	634,830.67	0.05
288	Snowflake Inc	Snowflake 股份有限公司	SNOW UN	纽约证券交易所	美国	632	631,809.57	0.05
289	Louisiana-Pacific Corp	路易斯安娜太平洋	LPX UN	纽约证券交易所	美国	1,529	630,413.31	0.05

290	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	641	628,976.44	0.05
291	RenaissanceRe Holdings Ltd	复兴再保险控股公司	RNR UN	纽约证券交易所	美国	488	626,147.07	0.05
292	GXO Logistics Inc	GXO Logistics 股份有限公司	GXO UN	纽约证券交易所	美国	2,104	625,558.70	0.05
293	Hewlett Packard Enterprise Co	慧与	HPE UN	纽约证券交易所	美国	5,585	620,800.76	0.05
294	Steel Dynamics Inc	Steel Dynamics 股份有限公司	STLD UW	纳斯达克证券交易所	美国	905	615,799.49	0.05
295	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	507	615,674.26	0.05
296	API Group Corp	API 集团公司	APG UN	纽约证券交易所	美国	4,675	612,444.29	0.05
297	Akamai Technologies Inc	阿卡迈技术公司	AKAM UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,033	606,490.60	0.05
298	Shopify Inc	Shopify 股份有限公司	SHOP UN	纽约证券交易所	美国	2,505	605,561.87	0.05
299	Toro Co/The	托罗公司	TTC UN	纽约证券交易所	美国	767	604,697.22	0.05
300	Zions Bancorp NA	锡安银行	ZION UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,766	604,642.61	0.05
30	Plexus	Plexus	PLXS UW	纳斯达克	美国	837	600,017.07	0.05

1	Corp	有限公司		克证券 交易所				
30 2	DXC Technolog y Co	DXC 技 术公司	DXC UN	纽约证 券交易 所	美国	3,226	595,396.69	0.05
30 3	Emerson Electric Co	艾默生 电气	EMR UN	纽约证 券交易 所	美国	889	594,758.31	0.05
30 4	Airbnb Inc	爱彼迎 股份有 限公司	ABNB UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	982	584,754.78	0.05
30 5	Lululemon Athletica Inc	Lulule mon Athlet ica 股 份有限 公司	LULU UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	262	584,605.46	0.05
30 6	Lennar Corp	Lennar 公司	LEN UN	纽约证 券交易 所	美国	919	579,242.30	0.05
30 7	Textron Inc	德事隆	TXT UN	纽约证 券交易 所	美国	1,172	577,905.79	0.05
30 8	Paramount Global	派拉蒙 全球	PARA UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,914	577,701.87	0.05
30 9	Peloton Interacti ve Inc	派乐腾	PTON UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	10,439	577,265.47	0.05
31 0	World Wrestling Entertain ment Inc	世界摔 角娱乐 公司	WWE UN	纽约证 券交易 所	美国	1,192	568,839.56	0.04
31 1	Pathward Financial Inc	Pathwa rd 金融 股份有 限公司	CASH UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,895	568,170.33	0.04
31 2	Coherent Corp	相干公 司	COHR UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,304	563,229.99	0.04
31 3	Prologis Inc	安博	PLD UN	纽约证 券交易 所	美国	716	562,145.46	0.04
31	Kinsale	Kinsal	KNSL UN	纽约证	美国	307	559,164.33	0.04

4	Capital Group Inc	e 资本集团股份有限公司		券交易所				
315	STAG Industrial Inc	STAG 实业公司	STAG UN	纽约证券交易所	美国	2,455	552,439.38	0.04
316	Wells Fargo & Co	富国银行	WFC UN	纽约证券交易所	美国	1,919	551,843.63	0.04
317	Horizon Therapeutics Plc	Horizon Therapeutic 公共有限公司	HZNP UW	纳斯达克证券交易所	美国	694	550,044.61	0.04
318	Waters Corp	沃特世公司	WAT UN	纽约证券交易所	美国	228	543,992.65	0.04
319	PulteGroup Inc	Pulte 集团公司	PHM UN	纽约证券交易所	美国	1,714	543,506.38	0.04
320	Howmet Aerospace Inc	Howmet 航空航天股份有限公司	HWM UN	纽约证券交易所	美国	1,980	543,460.27	0.04
321	Sea Ltd	Sea 有限公司	SE UN	纽约证券交易所	美国	1,470	532,681.16	0.04
322	MGM Resorts International	美高梅国际酒店集团	MGM UN	纽约证券交易所	美国	2,267	529,396.73	0.04
323	MP Materials Corp	MP Materials 公司	MP UN	纽约证券交易所	美国	3,130	529,284.53	0.04
324	Iridium Communications Inc	Iridium 通信股份有限公司	IRDM UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,476	528,379.13	0.04
325	Penske Automotive Group	Penske 汽车集团股份	PAG UN	纽约证券交易所	美国	653	522,688.29	0.04

	Inc	有限公司						
326	Marvell Technology Inc	美满电子科技公司	MRVL UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,015	519,807.10	0.04
327	Sterling Infrastructure Inc	Sterling 基础设施股份有限公司	STRL UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,265	517,414.06	0.04
328	Synaptics Inc	Synaptics 股份有限公司	SYNA UW	纳斯达克证券交易所	美国	777	514,957.79	0.04
329	Okta Inc	Okta Inc	OKTA UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,055	502,065.13	0.04
330	Smartsheet Inc	Smartsheet 股份有限公司	SMAR UN	纽约证券交易所	美国	1,824	500,007.02	0.04
331	Old Dominion Freight Line Inc	Old Dominion Freight Line 股份有限公司	ODFL UW	纳斯达克证券交易所	美国	252	498,056.38	0.04
332	Freshpet Inc	Freshpet 公司	FRPT UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,349	495,787.10	0.04
333	Axon Enterprise Inc	Axon Enterprise 股份有限公司	AXON UW	纳斯达克证券交易所	美国	429	495,767.88	0.04
334	Weatherford International PLC	威德福国际公共有限公司	WFRD UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,395	494,719.22	0.04
335	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	172	488,699.85	0.04
336	Ingredion Inc	宜瑞安公司	INGR UN	纽约证券交易所	美国	715	487,660.94	0.04

				所				
33 7	Invesco Ltd	景顺有 限公司	IVZ UN	纽约证 券交易 所	美国	3,844	481,626.88	0.04
33 8	Lincoln Electric Holdings Inc	林肯电 气控股 股份有 限公司	LECO UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	478	481,018.60	0.04
33 9	Newmont Corp	纽蒙黄 金公司	NEM UN	纽约证 券交易 所	美国	1,457	478,958.33	0.04
34 0	New Relic Inc	New Relic 股份有 限公司	NEWR UN	纽约证 券交易 所	美国	1,218	478,858.73	0.04
34 1	Johnson & Johnson	强生	JNJ UN	纽约证 券交易 所	美国	388	477,355.08	0.04
34 2	Vishay Intertech Inc	威世公 司	VSH UN	纽约证 券交易 所	美国	3,140	471,710.97	0.04
34 3	Teladoc Health Inc	Telado c 健康 股份有 限公司	TDOC UN	纽约证 券交易 所	美国	2,851	469,596.16	0.04
34 4	Littelfus e Inc	Littel fuse 股 份有限 公司	LFUS UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	302	463,148.69	0.04
34 5	Inspire Medical Systems Inc	Inspir e 医疗 系统股 份有限 公司	INSP UN	纽约证 券交易 所	美国	264	463,120.27	0.04
34 6	Virtus Investmen t Partners Inc	维德思 投资合 伙人股 份有限 公司	VRTS UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	347	462,656.15	0.04
34 7	Signet Jewelers Ltd	英国西 格尼珠 宝有限 公司	SIG UN	纽约证 券交易 所	美国	965	457,017.05	0.04

348	Dick's Sporting Goods Inc	迪克体育用品股份有限公司	DKS UN	纽约证券交易所	美国	541	453,234.51	0.04
349	PTC Inc	PTC 公司	PTC UW	纳斯达克证券交易所	美国	528	441,424.15	0.03
350	Thermo Fisher Scientific Inc	Thermo Fisher Scientific 公司	TMO UN	纽约证券交易所	美国	114	437,228.26	0.03
351	United Bankshares Inc/WV	United Bankshares 股份有限公司 /WV	UBSI UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,538	433,710.85	0.03
352	Valero Energy Corp	Valero 能源	VLO UN	纽约证券交易所	美国	487	430,278.70	0.03
353	Waste Management Inc	废品管理	WM UN	纽约证券交易所	美国	391	427,209.12	0.03
354	CSX Corp	CSX 公司	CSX UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,974	425,916.77	0.03
355	Shift4 Payments Inc	Shift4 Payments 股份有限公司	FOUR UN	纽约证券交易所	美国	1,092	425,366.85	0.03
356	Franklin Resources Inc	富兰克林资源	BEN UN	纽约证券交易所	美国	2,274	417,793.26	0.03
357	Kimco Realty Corp	Kimco Realty Corp	KIM UN	纽约证券交易所	美国	2,831	417,601.46	0.03
358	Republic Services Inc	公共服务公司	RSG UN	纽约证券交易所	美国	461	414,145.69	0.03
359	International Business Machines	国际商业机器	IBM UN	纽约证券交易所	美国	421	413,103.09	0.03

	Corp							
360	IDEX Corp	艺达思集团	IEX UN	纽约证券交易所	美国	257	408,688.37	0.03
361	Graphic Packaging Holding Co	图像包装控股公司	GPK UN	纽约证券交易所	美国	2,631	407,705.94	0.03
362	Universal Display Corp	美国通用显示器公司	OLED UW	纳斯达克证券交易所	美国	540	406,325.91	0.03
363	Air Products and Chemicals Inc	空气产品公司	APD UN	纽约证券交易所	美国	187	401,471.72	0.03
364	Uber Technologies Inc	优步技术股份有限公司	UBER UN	纽约证券交易所	美国	2,309	397,689.59	0.03
365	Hartford Financial Services Group Inc/The	哈特福德金融服务	HIG UN	纽约证券交易所	美国	752	397,150.46	0.03
366	Halozyne Therapeutics Inc	Halozyne Therapeutics 股份有限公司	HALO UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,002	397,078.31	0.03
367	Citi Trends Inc	Citi Trends 股份有限公司	CTRN UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,152	396,877.45	0.03
368	Five Below Inc	Five Below 股份有限公司	FIVE UW	纳斯达克证券交易所	美国	322	396,648.87	0.03
369	Best Buy Co Inc	百思买	BBY UN	纽约证券交易所	美国	710	396,627.70	0.03
370	PG&E Corp	太平洋煤气电	PCG UN	纽约证券交易所	美国	3,494	395,675.92	0.03

		力		所				
37 1	Amerisour ceBergen Corp	美源伯 根	ABC UN	纽约证 券交易 所	美国	341	393,549.42	0.03
37 2	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	445	391,620.85	0.03
37 3	West Pharmaceu tical Services Inc	西氏医 药服务 公司	WST UN	纽约证 券交易 所	美国	237	388,471.11	0.03
37 4	Howard Hughes Corp/The	霍华德 休斯公 司	HHC UN	纽约证 券交易 所	美国	727	386,934.65	0.03
37 5	Victoria' s Secret & Co	维多利 亚的秘 密	VSCO UN	纽约证 券交易 所	美国	1,552	386,748.14	0.03
37 6	Monster Beverage Corp	怪兽饮 料公司	MNST UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	546	386,085.25	0.03
37 7	SM Energy Co	SM 能 源公司	SM UN	纽约证 券交易 所	美国	1,550	375,994.38	0.03
37 8	Toll Brothers Inc	托尔兄 弟公司	TOL UN	纽约证 券交易 所	美国	1,068	371,314.58	0.03
37 9	FNB Corp/PA	FNB/宾 州	FNB UN	纽约证 券交易 所	美国	3,914	355,735.75	0.03
38 0	American Eagle Outfitter s Inc	美鹰傲 飞 AEO 有限公 司	AEO UN	纽约证 券交易 所	美国	3,649	354,777.00	0.03
38 1	Amcors PLC	安姆科 公司	AMCR UN	纽约证 券交易 所	美国	4,261	353,443.07	0.03
38 2	American Airlines Group Inc	美国航 空集团 公司	AAL UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,978	352,409.87	0.03
38 3	Bio-Techn e Corp	Bio-te chne 公	TECH UW	纳斯达 克证券	美国	608	350,953.44	0.03

		司		交易所				
384	Albemarle Corp	雅保公司	ALB UN	纽约证券交易所	美国	230	347,378.93	0.03
385	RingCentral Inc	RingCentral 股份有限公司	RNG UN	纽约证券交易所	美国	1,378	339,741.55	0.03
386	Morningstar Inc	晨星公司	MORN UN	纳斯达克证券交易所	美国	225	339,404.11	0.03
387	SolarEdge Technologies Inc	SolarEdge 科技股份有限公司	SEDG UN	纳斯达克证券交易所	美国	171	337,359.44	0.03
388	AutoNation Inc	AutoNation 股份有限公司	AN UN	纽约证券交易所	美国	444	331,801.90	0.03
389	Artisan Partners Asset Management Inc	阿尔笛生合伙人资产管理股份有限公司	APAM UN	纽约证券交易所	美国	1,590	328,889.31	0.03
390	Atkore Inc	Atkore 股份有限公司	ATKR UN	纽约证券交易所	美国	415	327,818.85	0.03
391	Sysco Corp	Sysco 公司	SYN UN	纽约证券交易所	美国	588	313,076.88	0.02
392	Mosaic Co/The	Mosaic 公司	MOS UN	纽约证券交易所	美国	1,005	307,064.69	0.02
393	AGCO Corp	爱科集团	AGCO UN	纽约证券交易所	美国	313	302,333.08	0.02
394	Raytheon Technologies Corp	雷神技术公司	RTX UN	纽约证券交易所	美国	430	302,233.00	0.02
395	Terex Corp	特雷克斯公司	TEX UN	纽约证券交易所	美国	1,006	299,312.88	0.02

396	Parker-Hannifin Corp	派克汉尼汾公司	PH UN	纽约证券交易所	美国	147	297,924.69	0.02
397	Planet Fitness Inc	Planet Fitness 股份有限公司	PLNT UN	纽约证券交易所	美国	536	294,162.42	0.02
398	SVB Financial Group	硅谷银行金融集团	SIVB UW	纳斯达克证券交易所	美国	178	285,304.28	0.02
399	Regency Centers Corp	Regency Centers 公司	REG UW	纳斯达克证券交易所	美国	646	281,195.73	0.02
400	Celsius Holdings Inc	Celsius 控股股份有限公司	CELH UR	纳斯达克证券交易所	美国	380	275,346.85	0.02
401	Performance Food Group Co	Performance Food 集团公司	PFGC UN	纽约证券交易所	美国	675	274,497.52	0.02
402	Crown Holdings Inc	Crown 控股股份有限公司	CCK UN	纽约证券交易所	美国	477	273,111.01	0.02
403	Dover Corp	都福	DOV UN	纽约证券交易所	美国	287	270,662.95	0.02
404	Home BancShares Inc/AR	阿肯色 Home BancShares 公司	HOMB UN	纽约证券交易所	美国	1,692	268,559.71	0.02
405	Crane Holdings Co	Crane Holdings Co	CR UN	纽约证券交易所	美国	383	267,944.53	0.02
406	DR Horton Inc	霍顿房屋公司	DHI UN	纽约证券交易所	美国	430	266,954.51	0.02
407	Evercore Inc	Evercore 股份有限公司	EVR UN	纽约证券交易所	美国	351	266,654.20	0.02

408	Equinix Inc	Equinix 有限公司	EQIX UW	纳斯达克证券交易所	美国	58	264,597.27	0.02
409	WillScot Mobile Mini Holdings Corp	WillScot Mobile Mini 控股公司	WSC UR	纳斯达克证券交易所	美国	837	263,312.65	0.02
410	Everest Re Group Ltd	安富来集团有限公司	RE UN	纽约证券交易所	美国	114	263,016.59	0.02
411	Valley National Bancorp	Valley National Bancorp	VLY UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,330	262,302.85	0.02
412	Haemonetics Corp	美商良卫股份有限公司	HAE UN	纽约证券交易所	美国	472	258,545.45	0.02
413	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	108	254,213.19	0.02
414	YETI Holdings Inc	YETI 控股股份有限公司	YETI UN	纽约证券交易所	美国	865	248,867.10	0.02
415	Summit Materials Inc	Summit 材料股份有限公司	SUM UN	纽约证券交易所	美国	1,257	248,540.32	0.02
416	General Motors Co	通用汽车公司	GM UN	纽约证券交易所	美国	1,059	248,112.20	0.02
417	Danaher Corp	丹纳赫	DHR UN	纽约证券交易所	美国	134	247,704.91	0.02
418	SiteOne Landscape Supply Inc	SiteOne Landscape Supply	SITE UN	纽约证券交易所	美国	303	247,577.32	0.02

		股份有 限公司						
41 9	Cerence Inc	Cerenc e Inc	CRNC UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,904	245,718.89	0.02
42 0	Lancaster Colony Corp	Lancas ter Colony 公司	LANC UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	178	244,592.57	0.02
42 1	Intel Corp	英特尔	INTC UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,319	242,794.10	0.02
42 2	Rollins Inc	Rollin s 公司	ROL UN	纽约证 券交易 所	美国	951	242,016.65	0.02
42 3	New York Times Co/The	纽约时 报	NYT UN	纽约证 券交易 所	美国	1,055	238,504.82	0.02
42 4	Red Rock Resorts Inc	红岩赌 场度假 村股份 有限公司	RRR UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	853	237,691.56	0.02
42 5	Vertiv Holdings Co	维谛技 术	VRT UN	纽约证 券交易 所	美国	2,472	235,177.27	0.02
42 6	Laborator y Corp of Ameri ca Hol dings	美国实 验控股	LH UN	纽约证 券交易 所	美国	143	234,523.43	0.02
42 7	CCC Inte lligent Soluti ons Ho ldings Inc	CCC I ntelli gent Soluti ons H olding s Inc	CCCS UN	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,820	231,461.52	0.02
42 8	Atlassian Corp	Atlass ian Corp	TEAM UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	255	228,532.21	0.02
42 9	Cooper Cos Inc/The	库柏股 份有限 公司	COO UN	纽约证 券交易 所	美国	99	227,995.44	0.02

430	A O Smith Corp	AO 史密斯公司	AOS UN	纽约证券交易所	美国	566	225,638.00	0.02
431	Boise Cascade Co	Boise Cascade 公司	BCC UN	纽约证券交易所	美国	461	220,477.44	0.02
432	Cathay General Bancorp	国泰万通金控	CATY UW	纳斯达克证券交易所	美国	774	219,882.59	0.02
433	Ormat Technologies Inc	奥玛特科技公司	ORA UN	纽约证券交易所	美国	361	217,429.80	0.02
434	Corteva Inc	科迪华公司	CTVA UN	纽约证券交易所	美国	530	216,970.97	0.02
435	Bank of New York Mellon Corp/The	纽约梅隆银行股份有限公司	BK UN	纽约证券交易所	美国	678	214,945.39	0.02
436	Otis Worldwide Corp	奥的斯电梯公司	OTIS UN	纽约证券交易所	美国	393	214,341.35	0.02
437	Intra-Cellular Therapies Inc	Intra-Cellular Therapies 公司	ITCI UW	纳斯达克证券交易所	美国	581	214,137.21	0.02
438	Equitable Holdings Inc	Equitable 控股股份有限公司	EQH UN	纽约证券交易所	美国	1,023	204,481.35	0.02
439	Henry Schein Inc	亨利香恩公司	HSIC UW	纳斯达克证券交易所	美国	367	204,148.37	0.02
440	FedEx Corp	联邦快递	FDX UN	纽约证券交易所	美国	164	197,828.07	0.02
441	Carlisle Cos Inc	卡莱股份有限公司	CSL UN	纽约证券交易所	美国	120	196,944.96	0.02
442	Carnival Corp	嘉年华公司	CCL UN	纽约证券交易所	美国	3,315	186,086.45	0.01

				所				
44 3	Korn Ferry	光辉国 际	KFY UN	纽约证 券交易 所	美国	523	184,382.63	0.01
44 4	IQVIA Holdings Inc	IQVIA 控股股 份有限 公司	IQV UN	纽约证 券交易 所	美国	129	184,080.02	0.01
44 5	Altair Engineer ing Inc	Altair Engine ering 股份有 限公司	ALTR UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	565	178,924.40	0.01
44 6	Vulcan Materials Co	Vulcan 材料	VMC UN	纽约证 券交易 所	美国	146	178,057.38	0.01
44 7	Element Solutions Inc	Elemen t 解决 方案股 份有限 公司	ESI UN	纽约证 券交易 所	美国	1,404	177,867.25	0.01
44 8	Westlake Corp	Westla ke 公司	WLK UN	纽约证 券交易 所	美国	248	177,109.22	0.01
44 9	Vistra Corp	Vistra 公司	VST UN	纽约证 券交易 所	美国	1,075	173,697.12	0.01
45 0	Brighthou se Financial Inc	Bright house 金融股 份有限 公司	BHF UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	486	173,538.47	0.01
45 1	Saia Inc	Saia 股 份有限 公司	SAIA UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	113	165,018.12	0.01
45 2	Vail Resorts Inc	范尔度 度假村 股份有 限公司	MTN UN	纽约证 券交易 所	美国	99	164,341.23	0.01
45 3	NVR Inc	NVR 股 份有限 公司	NVR UN	纽约证 券交易 所	美国	5	160,623.87	0.01
45 4	First Horizon	第一线 国民银	FHN UN	纽约证 券交易	美国	925	157,835.25	0.01

	Corp	行		所				
45 5	Pacific Premier Bancorp Inc	太平洋 第一合 众银行	PPBI UN	纳斯达 克证券 交易所	美国	713	156,719.38	0.01
45 6	VICI Propertie s Inc	VICI Proper ties 股 份有限 公司	VICI UN	纽约证 券交易 所	美国	681	153,669.72	0.01
45 7	OneMain Holdings Inc	OneMai n 控股 股份有 限公司	OMF UN	纽约证 券交易 所	美国	653	151,490.01	0.01
45 8	Southwest Airlines Co	西南航 空	LUV UN	纽约证 券交易 所	美国	645	151,251.26	0.01
45 9	XPO Inc	XPO 股 份有限 公司	XPO UN	纽约证 券交易 所	美国	637	147,689.43	0.01
46 0	Olympic Steel Inc	奥林匹 克钢铁 股份有 限公司	ZEUS UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	627	146,637.29	0.01
46 1	Darden Restauran ts Inc	达登餐 饮公司	DRI UN	纽约证 券交易 所	美国	148	142,585.14	0.01
46 2	Penumbra Inc	Penumb ra 股 份有限 公司	PEN UN	纽约证 券交易 所	美国	91	140,990.39	0.01
46 3	Discover Financial Services	Discover 金融 服务公 司	DFS UN	纽约证 券交易 所	美国	206	140,357.44	0.01
46 4	Quest Diagnosti cs Inc	Quest Diagno stics 股份有 限公司	DGX UN	纽约证 券交易 所	美国	128	139,461.38	0.01
46 5	Manhattan Associates Inc	曼哈顿 联合软 件公司	MANH UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	163	137,816.90	0.01
46	FactSet	FactSe	FDS UN	纽约证	美国	49	136,919.09	0.01

6	Research Systems Inc	t 研究系统股份有限公司		券交易所				
467	Tradeweb Markets Inc	Tradeweb Markets 股份有限公司	TW UW	纳斯达克证券交易所	美国	285	128,880.27	0.01
468	Doximity Inc	Doximity Inc	DOCS UN	纽约证券交易所	美国	544	127,150.19	0.01
469	SeaWorld Entertainment Inc	海洋世界娱乐股份有限公司	SEAS UN	纽约证券交易所	美国	338	125,964.40	0.01
470	Citigroup Inc	花旗集团	C UN	纽约证券交易所	美国	398	125,373.53	0.01
471	Annaly Capital Management Inc	Annaly 资本管理股份有限公司	NLY UN	纽约证券交易所	美国	853	125,232.14	0.01
472	BOK Financial Corp	BOK 金融公司	BOKF UW	纳斯达克证券交易所	美国	172	124,331.20	0.01
473	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	81	124,278.41	0.01
474	LKQ Corp	LKQ 公司	LKQ UW	纳斯达克证券交易所	美国	327	121,637.23	0.01
475	Perficient Inc	Perficient 股份有限公司	PRFT UW	纳斯达克证券交易所	美国	249	121,098.17	0.01
476	Cabot Corp	卡博特公司	CBT UN	纽约证券交易所	美国	256	119,171.55	0.01
477	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	81	118,975.57	0.01

		公司						
478	Boyd Gaming Corp	Boyd 博彩公司	BYD UN	纽约证券交易所	美国	311	118,111.47	0.01
479	American Financial Group Inc/OH	美国金融集团公司/俄亥俄州	AFG UN	纽约证券交易所	美国	123	117,600.34	0.01
480	Fortinet Inc	Fortinet 股份有限公司	FTNT UW	纳斯达克证券交易所	美国	336	114,407.76	0.01
481	Northrop Grumman Corp	诺斯洛普格鲁门公司	NOC UN	纽约证券交易所	美国	30	113,998.66	0.01
482	Interpublic Group of Cos Inc/The	Interpublic 集团	IPG UN	纽约证券交易所	美国	479	111,123.61	0.01
483	HEICO Corp	海科航空公司	HEI/A UN	纽约证券交易所	美国	131	109,346.66	0.01
484	NetApp Inc	美国网络存储技术有限公司	NTAP UW	纳斯达克证券交易所	美国	261	109,174.70	0.01
485	Umpqua Holdings Corp	Umpqua 控股公司	UMPQ UW	纳斯达克证券交易所	美国	855	106,291.98	0.01
486	Travelers Cos Inc/The	旅行家集团	TRV UN	纽约证券交易所	美国	81	105,769.22	0.01
487	Seaboard Corp	Seaboard 公司	SEB UA	纽约证券交易所	美国	4	105,171.31	0.01
488	Beacon Roofing Supply Inc	Beacon Roofing Supply 股份有限公司	BECN UW	纳斯达克证券交易所	美国	283	104,048.13	0.01
489	Boston Beer Co	波士顿啤酒公	SAM UN	纽约证券交易	美国	45	103,273.87	0.01

	Inc/The	司		所				
490	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	1,206	102,807.53	0.01
491	Blackstone Inc	黑石集团股份有限公司	BX UN	纽约证券交易所	美国	191	98,690.40	0.01
492	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	90	98,403.53	0.01
493	Jack Henry & Associates Inc	Jack Henry & Associates 公司	JKHY UW	纳斯达克证券交易所	美国	78	95,371.00	0.01
494	Ares Management Corp	阿瑞斯管理有限合伙企业	ARES UN	纽约证券交易所	美国	200	95,331.44	0.01
495	Valmont Industries Inc	维蒙特工业公司	VMI UN	纽约证券交易所	美国	41	94,422.36	0.01
496	Landstar System Inc	Landstar 系统股份有限公司	LSTR UW	纳斯达克证券交易所	美国	83	94,166.27	0.01
497	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	125	93,020.94	0.01
498	Avis Budget Group Inc	安飞士百捷乐集团股份有限公司	CAR UW	纳斯达克证券交易所	美国	81	92,478.26	0.01

		公司						
49	KeyCorp	KeyCorp 公司	KEY UN	纽约证券交易所	美国	755	91,599.12	0.01
50	MasTec Inc	MasTec 股份有限公司	MTZ UN	纽约证券交易所	美国	146	86,766.24	0.01
50	Marriott Vacations Worldwide Corp	万豪环球度假	VAC UN	纽约证券交易所	美国	86	80,613.43	0.01
50	WR Berkley Corp	WR Berkley 公司	WRB UN	纽约证券交易所	美国	159	80,361.94	0.01
50	AES Corp/The	爱伊斯公司	AES UN	纽约证券交易所	美国	400	80,120.76	0.01
50	ROBLOX Corp	Roblox 公司	RBLX UN	纽约证券交易所	美国	401	79,483.22	0.01
50	Intercontinental Exchange Inc	洲际交易所 (ICE)	ICE UN	纽约证券交易所	美国	111	79,309.31	0.01
50	Brink's Co/The	Brink's 公司	BCO UN	纽约证券交易所	美国	208	77,806.28	0.01
50	MercadoLibre Inc	MercadoLibre 股份有限公司	MELI UW	纳斯达克证券交易所	美国	13	76,618.40	0.01
50	Altra Industrial Motion Corp	Altra Industrial Motion 公司	AIMC UW	纳斯达克证券交易所	美国	181	75,320.41	0.01
50	Primerica Inc	Primerica 股份有限公司	PRI UN	纽约证券交易所	美国	73	72,103.53	0.01
51	Snap-on Inc	实耐宝	SNA UN	纽约证券交易所	美国	45	71,610.37	0.01
51	Monolithi	芯源系	MPWR UW	纳斯达克	美国	29	71,419.81	0.01

1	c Power Systems Inc	统有限公司		克证券交易所				
51 2	Norfolk Southern Corp	诺福克南方	NSC UN	纽约证券交易所	美国	41	70,364.89	0.01
51 3	Westrock Co	WestRock 公司	WRK UN	纽约证券交易所	美国	268	65,626.59	0.01
51 4	Ford Motor Co	福特汽车	F UN	纽约证券交易所	美国	792	64,150.65	0.01
51 5	Adient PLC	安道拓	ADNT UN	纽约证券交易所	美国	252	60,883.70	0.00
51 6	Paycom Software Inc	Paycom 软件股份有限公司	PAYC UN	纽约证券交易所	美国	28	60,513.18	0.00
51 7	Webster Financial Corp	韦伯斯特金融公司	WBS UN	纽约证券交易所	美国	176	58,027.93	0.00
51 8	GMS Inc	GMS 股份有限公司	GMS UN	纽约证券交易所	美国	167	57,921.79	0.00
51 9	Manulife Financial Corp	宏利金融	MFC UN	纽约证券交易所	美国	457	56,781.55	0.00
52 0	Arcosa Inc	Arcosa Inc	ACA UN	纽约证券交易所	美国	146	55,254.63	0.00
52 1	BankUnited Inc	BankUnited 公司	BKU UN	纽约证券交易所	美国	231	54,651.70	0.00
52 2	AAR Corp	AAR 公司	AIR UN	纽约证券交易所	美国	171	53,473.50	0.00
52 3	Asbury Automotive Group Inc	阿斯伯里汽车集团股份有限公司	ABG UN	纽约证券交易所	美国	42	52,432.99	0.00
52 4	Kinder Morgan	特拉华州金德	KMI UN	纽约证券交易	美国	415	52,256.79	0.00

	Inc	摩根公司		所				
525	LPL Financial Holdings Inc	LPL 金融控股公司	LPLA UW	纳斯达克证券交易所	美国	33	49,682.74	0.00
526	Lumen Technologies Inc	Lumen 科技股份有限公司	LUMN UN	纽约证券交易所	美国	1,259	45,771.21	0.00
527	ABM Industries Inc	ABM Industries 股份有限公司	ABM UN	纽约证券交易所	美国	147	45,477.03	0.00
528	Sonos Inc	搜诺思	SONO UW	纳斯达克证券交易所	美国	386	45,432.87	0.00
529	Hawaiian Holdings Inc	夏威夷控股有限公司	HA UW	纳斯达克证券交易所	美国	610	43,588.65	0.00
530	UniFirst Corp/MA	UniFirst 公司 / 马萨诸塞州	UNF UN	纽约证券交易所	美国	32	43,011.14	0.00
531	PagerDuty Inc	PagerDuty Inc	PD UN	纽约证券交易所	美国	225	41,620.45	0.00
532	Delta Air Lines Inc	达美航空有限公司	DAL UN	纽约证券交易所	美国	178	40,736.50	0.00
533	Plug Power Inc	普拉格动力公司	PLUG UR	纳斯达克证券交易所	美国	471	40,577.64	0.00
534	Chemed Corp	Chemed 公司	CHE UN	纽约证券交易所	美国	11	39,104.35	0.00
535	AstraZeneca PLC	阿斯利康公共有限公司	AZN UW	纳斯达克证券交易所	美国	66	31,165.19	0.00
536	TripAdvisor Inc	猫途鹰股份有限公司	TRIP UW	纳斯达克证券交易所	美国	242	30,304.09	0.00

537	Entegris Inc	Entegris 股份有限公司	ENTG UW	纳斯达克证券交易所	美国	59	26,951.68	0.00
538	Masimo Corp	Masimo 公司	MASI UW	纳斯达克证券交易所	美国	26	26,790.73	0.00
539	ModivCare Inc	ModivCare 股份有限公司	MODV UW	纳斯达克证券交易所	美国	41	25,622.28	0.00
540	U-Haul Holding Co	U-Haul 控股公司	UHAL UN	纽约证券交易所	美国	61	25,571.16	0.00
541	AMC Networks Inc	AMC 网络公司	AMCX UW	纳斯达克证券交易所	美国	210	22,918.41	0.00
542	QIAGEN NV	德国 QIAGEN 公共有限公司	QGEN UN	纽约证券交易所	美国	64	22,228.77	0.00
543	News Corp	新闻集团	NWS UW	纳斯达克证券交易所	美国	172	22,089.48	0.00
544	Upstart Holdings Inc	Upstart Holdings Inc	UPST UW	纳斯达克证券交易所	美国	239	22,005.21	0.00
545	LendingClub Corp	LendingClub 公司	LC UN	纽约证券交易所	美国	350	21,450.97	0.00
546	Unisys Corp	优利系统	UIS UN	纽约证券交易所	美国	446	15,872.74	0.00
547	Coinbase Global Inc	Coinbase 全球股份有限公司	COIN UW	纳斯达克证券交易所	美国	57	14,049.20	0.00
548	TopBuild Corp	TopBuild 公司	BLD UN	纽约证券交易所	美国	12	13,078.68	0.00
549	RH	RH	RH UN	纽约证券交易所	美国	7	13,026.10	0.00

550	MicroStrategy Inc	微策略公司	MSTR UW	纳斯达克证券交易所	美国	13	12,817.72	0.00
551	Snap Inc	Snap 股份有限公司	SNAP UN	纽约证券交易所	美国	205	12,778.30	0.00
552	Stanley Black & Decker Inc	史丹利百得公司	SWK UN	纽约证券交易所	美国	21	10,986.80	0.00
553	AZEK Co Inc/The	AZEK 有限公司	AZEK UN	纽约证券交易所	美国	77	10,897.09	0.00
554	Twilio Inc	Twilio 股份有限公司	TWLO UN	纽约证券交易所	美国	31	10,570.59	0.00
555	Owens & Minor Inc	Owens & Minor 公司	OMI UN	纽约证券交易所	美国	63	8,569.17	0.00
556	Repligen Corp	Repligen 公司	RGEN UW	纳斯达克证券交易所	美国	7	8,254.23	0.00
557	SiTime Corp	SiTime Corp	SITM UQ	纳斯达克证券交易所	美国	11	7,785.17	0.00
558	SkyWest Inc	SkyWest 股份有限公司	SKYW UW	纳斯达克证券交易所	美国	63	7,244.09	0.00
559	Groupon Inc	Groupon 股份有限公司	GRPN UW	纳斯达克证券交易所	美国	118	7,051.24	0.00
560	iHeartMedia Inc	iHeartMedia 股份有限公司	IHRT UW	纳斯达克证券交易所	美国	156	6,660.11	0.00
561	Zillow Group Inc	Zillow 集团股份有限公司	Z UW	纳斯达克证券交易所	美国	27	6,056.90	0.00
562	Eastman Chemical Co	伊士曼化工	EMN UN	纽约证券交易所	美国	10	5,671.97	0.00

563	Wayfair Inc	Wayfair 股份有限公司	W UN	纽约证券交易所	美国	19	4,352.25	0.00
564	Carvana Co	Carvana 公司	CVNA UN	纽约证券交易所	美国	90	2,971.10	0.00
565	Berry Global Group Inc	Berry 全球集团股份有限公司	BERY UN	纽约证券交易所	美国	7	2,946.10	0.00
566	Churchill Downs Inc	丘吉尔唐斯股份有限公司	CHDN UW	纳斯达克证券交易所	美国	2	2,945.05	0.00
567	Brunswick Corp/DE	宾士域集团 (特拉华州)	BC UN	纽约证券交易所	美国	3	1,506.03	0.00
568	Silvergate Capital Corp	Silvergate Capital Corp	SI UN	纽约证券交易所	美国	11	1,333.02	0.00
569	PACCAR Inc	帕卡	PCAR UW	纳斯达克证券交易所	美国	1	689.29	0.00

注：本表所使用的证券代码为彭博代码。

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	Amazon.com Inc	AMZN UW	30,722,560.93	1.75
2	UnitedHealth Group Inc	UNH UN	17,818,097.38	1.02
3	Tesla Inc	TSLA UW	17,251,078.17	0.98
4	Microsoft Corp	MSFT UW	14,231,140.90	0.81
5	Apple Inc	AAPL UW	13,911,254.93	0.79
6	AbbVie Inc	ABBV UN	12,580,210.38	0.72
7	Coca-Cola Co/The	KO UN	11,488,599.60	0.66
8	Lockheed Martin Corp	LMT UN	9,048,788.61	0.52

9	Advanced Micro Devices Inc	AMD UW	8,988,340.31	0.51
10	Amgen Inc	AMGN UW	8,940,030.44	0.51
11	PepsiCo Inc	PEP UW	8,836,953.21	0.50
12	Netflix Inc	NFLX UW	8,685,935.48	0.50
13	Eli Lilly & Co	LLY UN	8,278,874.40	0.47
14	American Express Co	AXP UN	6,670,690.69	0.38
15	Starbucks Corp	SBUX UW	6,481,716.77	0.37
16	Berkshire Hathaway Inc	BRK/B UN	6,401,333.16	0.37
17	Caterpillar Inc	CAT UN	6,049,016.67	0.35
18	Alphabet Inc	GOOGL UW	5,934,204.02	0.34
19	Archer-Daniels-Midland Co	ADM UN	5,899,602.06	0.34
20	Boeing Co/The	BA UN	5,525,891.28	0.32

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	Apple Inc	AAPL UW	42,462,168.02	2.42
2	Alphabet Inc	GOOGL UW	26,555,997.86	1.51
3	Amazon.com Inc	AMZN UW	26,124,811.01	1.49
4	NVIDIA Corp	NVDA UW	23,222,513.22	1.32
5	Microsoft Corp	MSFT UW	23,117,053.55	1.32
6	Meta Platforms Inc	META UW	21,589,896.32	1.23
7	Tesla Inc	TSLA UW	16,395,884.42	0.94
8	Advanced Micro Devices Inc	AMD UW	12,701,051.67	0.72
9	Home Depot Inc/The	HD UN	10,831,487.65	0.62
10	FACEBOOK INC-A	FB UW	10,018,533.45	0.57
11	QUALCOMM Inc	QCOM UW	9,294,398.07	0.53
12	Netflix Inc	NFLX UW	9,243,351.51	0.53
13	Adobe Inc	ADBE UW	8,774,091.27	0.50
14	Accenture PLC	ACN UN	8,143,720.12	0.46
15	Intuit Inc	INTU UW	7,985,334.83	0.46
16	Blackstone Inc	BX UN	7,358,882.92	0.42
17	Fortinet Inc	FTNT UW	7,308,275.55	0.42
18	SALESFORCE INC	CRM UN	7,056,852.76	0.40
19	Devon Energy Corp	DVN UN	6,690,014.52	0.38
20	Eli Lilly & Co	LLY UN	6,636,483.90	0.38

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	819,785,608.06
------------	----------------

卖出收入（成交）总额	956,989,568.11
------------	----------------

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

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	Invesco Golden Dragon China ETF	ETF	交易型开放式	Invesco Capital Management LLC	3,977,777.94	0.31
2	ARK Innovation ETF	ETF	交易型开放式	ARK Investment Management LLC	2,740,780.99	0.22
3	iShares 20+ Year Treasury Bond ETF	ETF	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	2,587,058.89	0.20
4	SPDR Gold Shares	ETF	交易型开放式	State Street Global Advisors Inc	1,032,608.93	0.08
5	VanEck Gold Miners ETF/USA	ETF	交易型开放式	Van Eck Associates Corp	729,757.47	0.06
6	iMGP DBi	ETF	交易型开放	Litman	210,038.13	0.02

	Managed Futures Strategy ETF		式	Gregory Fund Advisors LLC		
7	iShares S&P GSCI Commodity Indexed Trust	ETF	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	148,745.61	0.01
8	ARK Next Generation Internet ETF	ETF	交易型开放式	ARK Investment Management LLC	72,491.04	0.01
9	ARK Autonomous Technology & Robotics ETF	ETF	交易型开放式	ARK Investment Management LLC	37,415.99	-
10	ARK Fintech Innovation ETF	ETF	交易型开放式	ARK Investment Management LLC	20,175.12	-

8.11 投资组合报告附注

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

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

8.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	1,895,547.95
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,808,639.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,704,187.17

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币	186,807	2,369.10	46,715,740.51	10.56	395,848,114.07	89.44
嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇	635	8,066.25	-	-	5,122,069.67	100.00
合计	187,363	2,389.40	46,715,740.51	10.43	400,970,183.74	89.57

注：(1) 嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币：机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币份额占嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币总份额比例、个人投资者持有嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币份额占嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币总份额比例；

(2) 嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇：机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇份额占嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇总份额比例、个人投资者持有嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇份额占嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇总份额比例。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
----	------	-----------	-------------

基金管理人所有从业人员持有本基金	嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币	36,083.51	0.01
	嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇	-	-
	合计	36,083.51	0.01

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币	0
	嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币	0
	嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇	0
	合计	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

项目	嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币	嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇
基金合同生效日 (2013年6月14日) 基金份额总额	430,245,997.74	7,592,329.66
本报告期期初基金份额总额	488,500,747.66	4,902,802.17
本报告期基金总申购份额	283,378,126.10	1,354,476.57
减：本报告期基金总赎回份额	329,315,019.18	1,135,209.07
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	442,563,854.58	5,122,069.67

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

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

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。报告年度应支付普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的审计费 101,000.00 元，该审计机构已连续 10 年为本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2022 年 6 月 2 日
采取稽查或处罚等措施的机构	北京证监局
受到的具体措施类型	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	对子公司管控不严格
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已完成整改并通过北京证监局验收
其他	-
措施 2	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2022 年 6 月 14 日
采取稽查或处罚等措施的机构	北京证监局
受到的具体措施类型	警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	对子公司管控不严格

管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	-
其他	-
措施 3	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2022 年 12 月 26 日
采取稽查或处罚等措施的机构	北京证监局
受到的具体措施类型	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	内控管理不完善
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已完成整改并通过北京证监局验收
其他	-

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金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 (%)	
野村证券 NOMURA	2	1,257,892,435.75	71.94	890,163.35	90.96	-
瑞士信贷 (香港)有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	1	418,414,810.35	23.93	68,678.68	7.02	-
麦格理银行有限公司香港分行 Macquaire Bank Limited Hong Kong Branch.	1	72,286,353.39	4.13	19,832.48	2.03	-
Wolfe Research	1	-	-	-	-	-

Securities						
德意志银行	1	-	-	-	-	-
花旗环球金融亚洲有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited	1	-	-	-	-	-
金贝塔证券有限公司 iGoldenbeta Securities Company Limited	1	-	-	-	-	-
麦格理资本证券股份有限公司 Macquarie Securities Group	1	-	-	-	-	-
瑞士信贷（香港）有限公司	1	-	-	-	-	-
瑞银集团 Union Bank of Switzerland	1	-	-	-	-	-
中信证券国际有限公司 CITIC Securities International Company	1	-	-	-	-	-

Limited						
---------	--	--	--	--	--	--

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

2. 交易单元的选择标准和程序

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

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
野村证券 NOMURA	-	-	-	-	-	-	14,132,475.48	78.31
瑞士信贷（香港）有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	3,915,444.21	21.69
麦格理银行有限公司香港分行 Macquaire Bank Limited Hong Kong Branch.	-	-	-	-	-	-	-	-
Wolfe Research Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
德意志银行	-	-	-	-	-	-	-	-
花旗环球金融 亚洲有限公司 Citigroup	-	-	-	-	-	-	-	-

Global Markets Asia Limited									
金贝塔证券有限公司 iGoldenbeta Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
麦格理资本证券股份有限公司 Macquarie Securities Group	-	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞士信贷（香港）有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银集团 Union Bank of Switzerland	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券国际有限公司 CITIC Securities International Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于嘉实美国成长股票（QDII）2022年1月17日暂停申购、赎回及定投业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年1月13日
2	关于嘉实美国成长股票（QDII）2022年2月21日暂停申购、赎回及定投业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年2月17日
3	关于嘉实美国成长股票（QDII）2022年4月15日暂停申购、赎回及定投业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年4月13日
4	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年5月12日
5	关于嘉实美国成长股票（QDII）2022年5月30日暂停申购、赎回及定投业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年5月26日
6	关于嘉实美国成长股票（QDII）2022	证券日报、基金管理人	2022年6月16日

	年 6 月 20 日暂停申购、赎回及定投业务的公告	网站及中国证监会基金电子披露网站	
7	关于嘉实美国成长股票（QDII）2022 年 7 月 4 日暂停申购、赎回及定投业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 6 月 30 日
8	关于嘉实美国成长股票（QDII）2022 年 9 月 5 日暂停申购、赎回及定投业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 9 月 1 日
9	嘉实基金管理有限公司住所变更公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 11 月 10 日
10	关于嘉实美国成长股票（QDII）2022 年 11 月 24 日暂停申购、赎回及定投业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 11 月 22 日
11	嘉实基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善客户身份信息的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 12 月 21 日
12	关于嘉实美国成长股票（QDII）2022 年 12 月 26 日暂停申购、赎回及定投业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 12 月 22 日

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会核准嘉实美国成长股票型证券投资基金募集的文件；
- (2) 《嘉实美国成长股票型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实美国成长股票型证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实美国成长股票型证券投资基金基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；(6) 报告期内嘉实美国成长股票型证券投资基金公告的各项原稿。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

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

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

嘉实基金管理有限公司

2023 年 3 月 30 日