

嘉实美国成长股票型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 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 8 月 29 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。本中期报告已经由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 08 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 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.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	40
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	40
7.4 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.....	40

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	77
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	79
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	79
7.8 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.....	79
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	79
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	79
7.11 投资组合报告附注.....	80
§8 基金份额持有人信息.....	81
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	81
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	81
8.3 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.....	82
§9 开放式基金份额变动.....	82
§10 重大事件揭示.....	82
10.1 基金份额持有人大会决议.....	82
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	83
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	83
10.4 基金投资策略的改变.....	83
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	83
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	83
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	83
10.8 其他重大事件.....	86
§11 备查文件目录.....	87
11.1 备查文件目录.....	87
11.2 存放地点.....	87
11.3 查阅方式.....	87

§ 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	368,014,200.11 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	363,004,297.41 份	5,009,902.70 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	010-66596688
	电子邮箱	service@jsfund.cn	fxjd_hq@bank-of-china.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	100020	100818	
法定代表人	经雷	葛海蛟	

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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 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
本期已实现收益	33,815,705.91	2,716,009.73
本期利润	315,660,160.30	25,072,648.30
加权平均基金份额本期利润	0.7833	4.8990
本期加权平均净值利润率	26.59%	27.18%
本期基金份额净	30.17%	25.49%

值增长率		
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)	
期末可供分配利润	263,157,519.23	25,958,642.96
期末可供分配基金份额利润	0.7249	5.1815
期末基金资产净值	1,265,482,943.58	106,561,716.05
期末基金份额净值	3.486	2.944
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	248.60%	194.40%

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
过去一个月	8.77%	0.88%	6.42%	0.85%	2.35%	0.03%
过去三个月	18.21%	0.98%	11.89%	0.88%	6.32%	0.10%
过去六个月	30.17%	1.10%	26.82%	1.04%	3.35%	0.06%
过去一年	32.60%	1.34%	24.53%	1.33%	8.07%	0.01%
过去三年	45.49%	1.38%	41.32%	1.35%	4.17%	0.03%
自基金合同生效起	248.60%	1.19%	252.50%	1.17%	-3.90%	0.02%

至今						
----	--	--	--	--	--	--

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
过去一个月	6.59%	0.88%	6.42%	0.85%	0.17%	0.03%
过去三个月	12.45%	0.95%	11.89%	0.88%	0.56%	0.07%
过去六个月	25.49%	1.06%	26.82%	1.04%	-1.33%	0.02%
过去一年	23.23%	1.29%	24.53%	1.33%	-1.30%	-0.04%
过去三年	42.64%	1.35%	41.32%	1.35%	1.32%	0.00%
自基金合同生效起至今	194.40%	1.17%	252.50%	1.17%	-58.10%	0.00%

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：

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

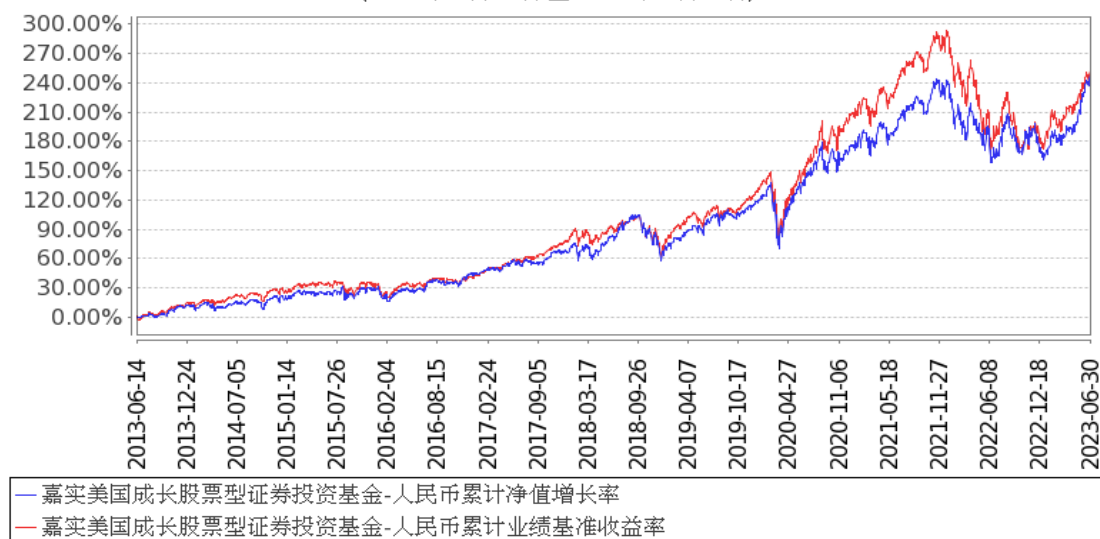
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

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

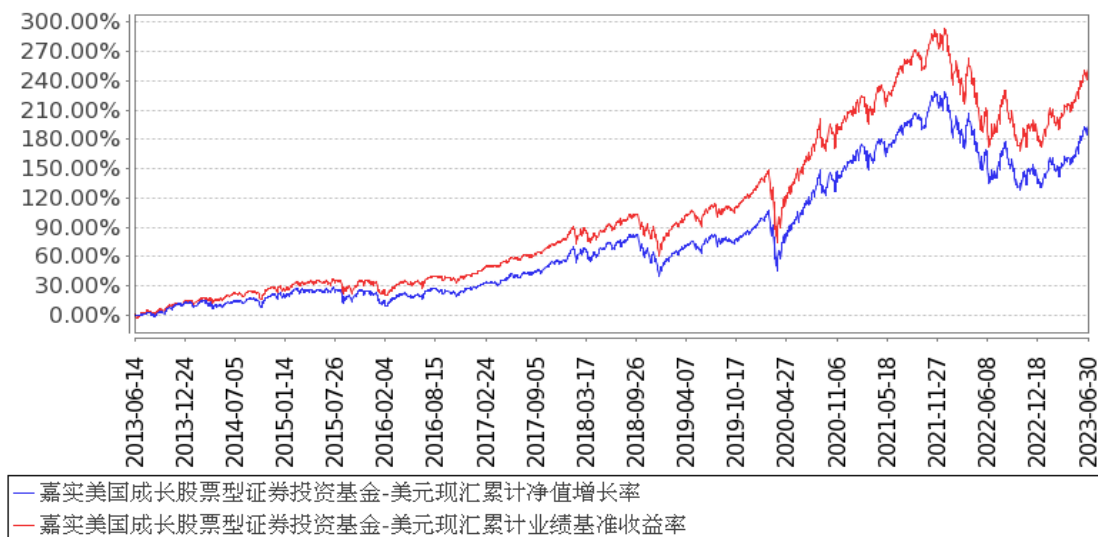
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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2023年06月30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2023年06月30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。

3.3 其他指标

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 2023 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 314 只公募基金，覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF、基础设施基金等不同类别。同时，还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张自力	本基金、嘉实事件	2013 年 6 月 14 日	-	27 年	曾任美国世纪投资管理公司（American Century Investments）资深副总经理，研

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

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 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，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；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 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 6 次，均为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年，美股资本市场情绪乐观、各大宽基指数整体走势强劲。纳指大幅领先道指和标普等大盘指数，罗素大盘分层内成长风格大幅战胜价值风格，反应了市场对资本市场估值空间的乐观，对科技板块、成长风格的偏好倾向。

报告期内，市场关注度最高的全局事件，依然为美国国内的经济增速、就业指标和美联储加息决策和远期政策的预期。随着通胀增速见顶、就业数据持续见好，尤其是 GDP 增速持续的超预期，不断缓和了投资者对高利率环境对经济活动产生压制的负面预期。

在成长风格内，新技术的出现是最强劲的成长股催化剂，对远期成长性的计价将超过当前业绩的增长本身。年初全球火热的 AI 技术新进展，尤其是大模型效果的确认，对由此衍生的云端、软件、硬件等 AI 相关供应链，以及有 AI 商业赋能潜力的传统业务领域，都获得了面向更远期的估值空间。

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，并通过对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 3.486 元，本报告期基金份额净值增长率为 30.17%；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 2.944 美元，本报告期基金份额净值增长率为 25.49%；业绩比较基准收益率为 26.82%。

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，美股权益类资产正处于较好的配置机会。美国通胀问题已经软着陆，而就业和 GDP 增速指标多次超预期，表明美国经济衰退的概率几近为零。本组合在历次的展望中均表达了对美国经济没有衰退担忧的乐观情绪，并在组合内积极配置侧重成长相关维度的核心指标。

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。

4.7 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“6.4.11 利润分配情况”。

4.8 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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、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”部分未在本托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	141,109,942.75	87,125,147.00
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,287,786,894.37	1,182,000,660.24
其中：股票投资		1,247,450,345.14	1,170,442,138.35
基金投资		40,336,549.23	11,558,521.89
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		4,027,410.33	-
应收股利		286,614.33	1,895,547.95
应收申购款		8,854,697.12	6,808,639.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,442,065,558.90	1,277,829,994.41
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		67,337,680.28	6,156,234.96

应付管理人报酬		2,007,435.95	1,983,130.05
应付托管费		390,334.72	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	6.4.7.9	285,448.32	237,204.61
负债合计		70,020,899.27	8,762,178.23
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	393,866,038.32	474,111,355.85
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	978,178,621.31	794,956,460.33
净资产合计		1,372,044,659.63	1,269,067,816.18
负债和净资产总计		1,442,065,558.90	1,277,829,994.41

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 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 3.486 元，基金份额总额 363,004,297.41 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 2.944 美元，基金份额总额 5,009,902.70 份，基金份额总额合计为 368,014,200.11 份。

6.2 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		354,491,569.88	-361,910,440.85
1. 利息收入		71,382.33	107,063.45
其中：存款利息收入	6.4.7.13	71,382.33	107,063.45
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）		47,019,859.81	14,386,359.92
其中：股票投资收益	6.4.7.14	42,408,682.78	7,807,448.40
基金投资收益	6.4.7.15	-777,489.81	-7,731.34
债券投资收益	6.4.7.16	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.17	-	-

收益			
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	5,388,666.84	6,586,642.86
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	304,201,092.96	-380,672,515.22
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		2,680,799.00	3,479,792.14
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	518,435.78	788,858.86
减：二、营业总支出		13,758,761.28	15,294,698.75
1. 管理人报酬		11,426,938.24	12,710,047.07
2. 托管费		2,221,904.63	2,471,397.99
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	6.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.24	109,918.41	113,253.69
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		340,732,808.60	-377,205,139.60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		340,732,808.60	-377,205,139.60
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		340,732,808.60	-377,205,139.60

6.3 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净	474,111,355.85	-	794,956,460.33	1,269,067,816.18

资产(基金净值)				
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	474,111,355.85	-	794,956,460.33	1,269,067,816.18
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-80,245,317.53	-	183,222,160.98	102,976,843.45
(一)、综合收益总额	-	-	340,732,808.60	340,732,808.60
(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)	-80,245,317.53	-	-157,510,647.62	-237,755,965.15
其中:1.基金申购款	106,490,440.74	-	212,255,638.41	318,746,079.15
2.基金赎回款	-186,735,758.27	-	-369,766,286.03	-556,502,044.30
(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)	393,866,038.32	-	978,178,621.31	1,372,044,659.63
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(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)	-46,204,319.01	-	-465,807,722.70	-512,012,041.71
(一)、综合收益总额	-	-	-377,205,139.60	-377,205,139.60
(二)、本期基	-46,204,319.01	-	-88,602,583.10	-134,806,902.11

金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）				
其中：1. 基金申购款	176,014,811.29	-	342,764,476.85	518,779,288.14
2. 基金赎回款	-222,219,130.30	-	-431,367,059.95	-653,586,190.25
（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、本期末净资产（基金净值）	472,488,941.28	-	768,876,625.89	1,241,365,567.17

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

经雷

基金管理人负责人

梁凯

主管会计工作负责人

李袁

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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。

6.4.2 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 6.4.4 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。

6.4.3 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。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
活期存款	141,109,942.75
等于：本金	141,104,750.65
加：应计利息	5,192.10

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	141,109,942.75

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	850,837,010.94	-	1,247,450,345.14	396,613,334.20
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	35,065,608.21	-	40,336,549.23	5,270,941.02
其他	-	-	-	-
合计	885,902,619.15	-	1,287,786,894.37	401,884,275.22

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	175,856.44
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	109,591.88
合计	285,448.32

6.4.7.10 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 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	442,563,854.58	442,563,854.58
本期申购	102,412,650.99	102,412,650.99
本期赎回（以“-”号填列）	-181,972,208.16	-181,972,208.16
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	363,004,297.41	363,004,297.41

嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,122,069.67	31,547,501.27
本期申购	660,947.42	4,077,789.75
本期赎回（以“-”号填列）	-773,114.39	-4,763,550.11
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	5,009,902.70	30,861,740.91

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 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
上年度末	282,208,317.53	460,609,890.36	742,818,207.89
本期利润	33,815,705.91	281,844,454.39	315,660,160.30
本期基金份额交易产生的变动数	-52,866,504.21	-103,133,217.81	-155,999,722.02
其中：基金申购款	68,163,357.84	136,437,445.23	204,600,803.07
基金赎回款	-121,029,862.05	-239,570,663.04	-360,600,525.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	263,157,519.23	639,321,126.94	902,478,646.17

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
上年度末	23,808,345.96	28,329,906.48	52,138,252.44
本期利润	2,716,009.73	22,356,638.57	25,072,648.30
本期基金份额交易产生的变动数	-565,712.73	-945,212.87	-1,510,925.60
其中：基金申购款	3,142,171.61	4,512,663.73	7,654,835.34
基金赎回款	-3,707,884.34	-5,457,876.60	-9,165,760.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,958,642.96	49,741,332.18	75,699,975.14

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	71,026.52
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	355.81
合计	71,382.33

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	42,408,682.78
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	42,408,682.78

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	702,104,342.69
减：卖出股票成本总额	658,921,869.07
减：交易费用	773,790.84
买卖股票差价收入	42,408,682.78

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	10,115,020.49
减：卖出/赎回基金成本总额	10,862,007.56
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	30,502.74
基金投资收益	-777,489.81

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	5,278,039.22
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	110,627.62
合计	5,388,666.84

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	304,201,092.96
股票投资	297,847,781.04
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	6,353,311.92
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	304,201,092.96

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

基金赎回费收入	518,435.78
合计	518,435.78

6.4.7.23 信用减值损失

无。

6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	50,084.51
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	326.53
合计	109,918.41

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
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

6.4.10 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。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	11,426,938.24	12,710,047.07
其中：支付销售机构的客户维护费	4,372,419.95	4,116,475.82

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,221,904.63	2,471,397.99

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 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**6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司 _活期	141,109,942.75	71,026.52	95,327,471.60	106,234.56

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本期(2023年1月1日至2023年6月30日),本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末(2023年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 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约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。

6.4.13.3.1 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 6.4.12 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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	141,109,942.75	-	-	-	141,109,942.75
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-1,287,786,894.37	1,287,786,894.37
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	4,027,410.33	4,027,410.33
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	286,614.33	286,614.33
应收申购款	-	-	-	8,854,697.12	8,854,697.12
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	141,109,942.75	-	-	-1,300,955,616.15	1,442,065,558.90

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	-	-	-	67,337,680.28	67,337,680.28
应付管理人报酬	-	-	-	2,007,435.95	2,007,435.95
应付托管费	-	-	-	390,334.72	390,334.72
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	-	-	-	285,448.32	285,448.32
负债总计	-	-	-	70,020,899.27	70,020,899.27
利率敏感度缺口	141,109,942.75	-	-	-1,230,934,716.88	1,372,044,659.63
上年度末 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

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

6.4.13.4.1.2 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（2023年6月30日）	上年度末（2022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	-	-

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	49,164,953.92	-	-	49,164,953.92
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-

交易性金融资产	1,287,786,894.37	-	-	1,287,786,894.37
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	286,614.33	-	-	286,614.33
应收申购款	41,965.86	-	-	41,965.86
应收清算款	4,027,410.33	-	-	4,027,410.33
其他资产	-	-	-	-
资产合计	1,341,307,838.81	-	-	1,341,307,838.81
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
应付赎回款	877,906.16	-	-	877,906.16
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	2,342.17	-	-	2,342.17
负债合计	880,248.33	-	-	880,248.33
资产负债表外 汇风险敞口净额	1,340,427,590.48	-	-	1,340,427,590.48
项目	上年度末 2022 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	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

6.4.13.4.2.2 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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）	
分析	所有外币相对人民币升值 5%	67,021,379.52	60,935,444.84
	所有外币相对人民币贬值 5%	-67,021,379.52	-60,935,444.84

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022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	1,247,450,345.14	90.92	1,170,442,138.35	92.23
交易性金融资产—基金投资	40,336,549.23	2.94	11,558,521.89	0.91
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-

衍生金融资产 — 权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,287,786,894.37	93.86	1,182,000,660.24	93.14

6.4.13.4.3.2 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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	67,766,683.02	59,618,884.11
	业绩比较基准下降5%	-67,766,683.02	-59,618,884.11

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	1,287,786,894.37	1,182,000,660.24
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	1,287,786,894.37	1,182,000,660.24

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 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）。

6.4.14.4 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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告**7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,247,450,345.14	86.50
	其中：普通股	1,232,256,808.81	85.45
	存托凭证	12,364,241.39	0.86
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	2,829,294.94	0.20
2	基金投资	40,336,549.23	2.80
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	-	-

	产		
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	141,109,942.75	9.79
8	其他各项资产	13,168,721.78	0.91
9	合计	1,442,065,558.90	100.00

7.2 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	1,247,450,345.14	90.92
合计	1,247,450,345.14	90.92

7.3 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	588,576,032.71	42.90
非必需消费品	200,439,595.25	14.61
通信服务	130,284,860.96	9.50
医疗保健	102,112,367.82	7.44
工业	82,953,877.03	6.05
金融	64,080,975.37	4.67
必需消费品	50,194,086.90	3.66
能源	13,169,206.99	0.96
原材料	10,506,664.53	0.77
公用事业	1,483,551.32	0.11
房地产	819,831.32	0.06
房地产信托数据中心类	1,336,844.10	0.10
房地产信托特殊类	783,367.48	0.06
房地产信托工业类	636,487.48	0.05
房地产信托零售类	72,595.88	0.01
房地产信托抵押类	-	-
合计	1,247,450,345.14	90.92

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

7.4 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	101,824	142,715,339.89	10.40
2	Microsoft	微软公司	MSFT UW	纳斯达克	美国	55,998	137,792,818.84	10.04

	Corp	司		克证券 交易所				
3	NVIDIA Corp	英伟达	NVDA UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	31,614	96,633,183.36	7.04
4	Alphabet Inc	Alphabet 公司	GOOGL UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	100,455	86,886,368.36	6.33
5	Amazon.com Inc	亚马逊公司	AMZN UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	82,158	77,389,162.55	5.64
6	Tesla Inc	特斯拉公司	TSLA UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	25,725	48,658,777.46	3.55
7	Broadcom Inc	博通股份有限公司	AVGO UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,243	26,594,596.57	1.94
8	Eli Lilly & Co	礼来	LLY UN	纽约证 券交易 所	美国	7,543	25,561,384.12	1.86
9	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	10,169	21,087,049.39	1.54
10	Visa Inc	维萨公司	V UN	纽约证 券交易 所	美国	9,771	16,766,869.74	1.22
11	Adobe Inc	奥多比	ADBE UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,096	14,472,576.79	1.05
12	Costco Wholesale Corp	开市客	COST UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,678	14,308,251.98	1.04
13	Advanced Micro Devices Inc	AMD 公司	AMD UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	17,327	14,261,695.64	1.04
14	UnitedHealth Group Inc	联合健康集团	UNH UN	纽约证 券交易 所	美国	3,283	11,401,886.94	0.83
15	Mastercard Inc	万事达股份有限公司	MA UN	纽约证 券交易 所	美国	4,008	11,390,363.82	0.83
16	Oracle	甲骨文	ORCL UN	纽约证	美国	12,879	11,082,643.80	0.81

	Corp			券交易所				
17	PepsiCo Inc	百事可乐	PEP UW	纳斯达克证券交易所	美国	8,223	11,005,356.28	0.80
18	Applied Materials Inc	应用材料	AMAT UW	纳斯达克证券交易所	美国	9,661	10,090,113.91	0.74
19	Home Depot Inc/The	家得宝	HD UN	纽约证券交易所	美国	3,901	8,756,272.42	0.64
20	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM UW	纳斯达克证券交易所	美国	9,836	8,460,526.21	0.62
21	General Electric Co	通用电气	GE UN	纽约证券交易所	美国	9,809	7,785,934.26	0.57
22	Coca-Cola Co/The	可口可乐	KO UN	纽约证券交易所	美国	17,269	7,514,392.53	0.55
23	Netflix Inc	奈飞公司	NFLX UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,322	7,390,676.71	0.54
24	ServiceNow Inc	ServiceNow 公司	NOW UN	纽约证券交易所	美国	1,754	7,122,437.68	0.52
25	KLA Corp	KLA 公司	KLAC UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,032	7,121,464.07	0.52
26	Lam Research Corp	泛林集团	LRCX UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,446	6,716,927.08	0.49
27	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	3,957	6,705,510.90	0.49
28	AbbVie Inc	艾伯维公司	ABBV UN	纽约证券交易所	美国	6,134	5,971,645.50	0.44
29	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	297	5,795,077.22	0.42

30	Intuitive Surgical Inc	直觉外科手术公司	ISRG UN	纳斯达克证券交易所	美国	2,340	5,781,648.72	0.42
31	Merck & Co Inc	默克	MRK UN	纽约证券交易所	美国	6,660	5,553,008.51	0.40
32	Uber Technologies Inc	优步技术股份有限公司	UBER UN	纽约证券交易所	美国	16,552	5,163,194.23	0.38
33	Zoetis Inc	硕腾股份有限公司	ZTS UN	纽约证券交易所	美国	4,088	5,086,923.31	0.37
34	Lowe's Cos Inc	劳氏	LOW UN	纽约证券交易所	美国	3,062	4,993,702.69	0.36
35	Intuit Inc	Intuit 股份有限公司	INTU UN	纳斯达克证券交易所	美国	1,494	4,946,319.22	0.36
36	Fortinet Inc	Fortinet 股份有限公司	FTNT UN	纳斯达克证券交易所	美国	8,891	4,856,248.39	0.35
37	Vertex Pharmaceuticals Inc	福泰制药	VRTX UN	纳斯达克证券交易所	美国	1,890	4,805,951.12	0.35
38	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	台积电	TSM UN	纽约证券交易所	美国	6,499	4,739,251.06	0.35
39	Marriott International Inc/MD	万豪国际	MAR UN	纳斯达克证券交易所	美国	3,443	4,569,918.70	0.33
40	HubSpot Inc	HubSpot 公司	HUBS UN	纽约证券交易所	美国	1,150	4,421,492.31	0.32
41	Synopsys Inc	新思科技公司	SNPS UN	纳斯达克证券交易所	美国	1,278	4,020,825.17	0.29
42	Chipotle	Chipot	CMG UN	纽约证	美国	252	3,894,908.52	0.28

	Mexican Grill Inc	le Mexican Grill 股份有限公司		券交易所				
43	NIKE Inc	耐克公司	NKE UN	纽约证券交易所	美国	4,876	3,888,666.30	0.28
44	TJX Cos Inc/The	TJX 公司	TJX UN	纽约证券交易所	美国	6,233	3,818,806.90	0.28
45	Caterpillar Inc	卡特彼勒	CAT UN	纽约证券交易所	美国	2,115	3,760,275.61	0.27
46	Dexcom Inc	Dexcom 股份有限公司	DXCM UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,992	3,706,921.53	0.27
47	McDonald's Corp	麦当劳	MCD UN	纽约证券交易所	美国	1,701	3,667,782.91	0.27
48	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	2,010	3,620,071.61	0.26
49	HCA Healthcare Inc	HCA 医疗保健有限公司	HCA UN	纽约证券交易所	美国	1,611	3,532,739.00	0.26
50	Quanta Services Inc	Quanta 服务股份有限公司	PWR UN	纽约证券交易所	美国	2,469	3,504,766.26	0.26
51	ON Semiconductor Corp	安森美半导体公司	ON UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,856	3,318,668.89	0.24
52	Palo Alto Networks Inc	Palo Alto Networks 股份有限公司	PANW UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,747	3,225,423.48	0.24
53	McKesson Corp	McKesson 公	MCK UN	纽约证券交易所	美国	987	3,047,517.06	0.22

		司		所				
54	ASML Holding NV	阿斯麦控股公司	ASML UN	纳斯达克证券交易所	美国	580	3,037,401.16	0.22
55	Deere & Co	迪尔	DE UN	纽约证券交易所	美国	1,034	3,027,367.85	0.22
56	Stryker Corp	史赛克	SYK UN	纽约证券交易所	美国	1,274	2,808,557.62	0.20
57	Workday Inc	Workday 股份有限公司	WDAY UN	纳斯达克证券交易所	美国	1,685	2,750,317.60	0.20
58	Snowflake Inc	Snowflake 股份有限公司	SNOW UN	纽约证券交易所	美国	2,146	2,728,845.63	0.20
59	Microchip Technology Inc	微芯科技股份有限公司	MCHP UN	纳斯达克证券交易所	美国	4,211	2,726,030.53	0.20
60	Hershey Co/The	好时公司	HSY UN	纽约证券交易所	美国	1,476	2,663,120.62	0.19
61	Penumbra Inc	Penumbra 股份有限公司	PEN UN	纽约证券交易所	美国	1,055	2,622,844.73	0.19
62	ANSYS Inc	ANSYS 股份有限公司	ANSS UN	纳斯达克证券交易所	美国	1,086	2,591,700.95	0.19
63	Lockheed Martin Corp	洛克希德马丁	LMT UN	纽约证券交易所	美国	773	2,571,472.47	0.19
64	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	3,085	2,562,418.62	0.19
65	West Pharmaceutical Services Inc	西氏医药服务公司	WST UN	纽约证券交易所	美国	908	2,509,395.77	0.18

66	Boeing Co/The	波音	BA UN	纽约证券交易所	美国	1,641	2,503,837.68	0.18
67	PulteGroup Inc	Pulte 集团公司	PHM UN	纽约证券交易所	美国	4,413	2,477,017.54	0.18
68	NXP Semiconductors NV	恩智浦半导体公司	NXPI UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,668	2,466,933.21	0.18
69	Comfort Systems USA Inc	美国舒适系统公司	FIX UN	纽约证券交易所	美国	2,077	2,464,311.40	0.18
70	Accenture PLC	埃森哲公司	ACN UN	纽约证券交易所	美国	1,098	2,448,251.63	0.18
71	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	3,239	2,427,968.95	0.18
72	Spotify Technology SA	Spotify 科技股份有限公司	SPOT UN	纽约证券交易所	美国	2,047	2,374,729.18	0.17
73	United Parcel Service Inc	联合包裹服务股份有限公司	UPS UN	纽约证券交易所	美国	1,785	2,311,976.00	0.17
74	Comcast Corp	康卡斯特公司	CMCSA UW	纳斯达克证券交易所	美国	7,657	2,298,876.35	0.17
75	Procter & Gamble Co/The	宝洁	PG UN	纽约证券交易所	美国	2,037	2,233,454.17	0.16
76	elf Beauty Inc	elf Beauty 股份有限公司	ELF UN	纽约证券交易所	美国	2,684	2,215,382.01	0.16
77	Occidental Petroleum Corp	西方石油	OXY UN	纽约证券交易所	美国	5,182	2,201,712.82	0.16
78	WW Grainger	固安捷股份有	GWV UN	纽约证券交易所	美国	380	2,165,313.58	0.16

	Inc	限公司		所				
79	Verisk Analytics Inc	Verisk 分析公司	VRSK UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,319	2,154,253.55	0.16
80	NVR Inc	NVR 股份有限公司	NVR UN	纽约证券交易所	美国	46	2,110,862.26	0.15
81	Onto Innovation Inc	Onto 创新股份有限公司	ONTO UN	纽约证券交易所	美国	2,505	2,108,180.26	0.15
82	JPMorgan Chase & Co	摩根大通	JPM UN	纽约证券交易所	美国	1,948	2,047,192.85	0.15
83	Salesforce Inc	Salesforce 股份有限公司	CRM UN	纽约证券交易所	美国	1,318	2,011,956.67	0.15
84	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	5,149	1,987,153.46	0.14
85	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	546	1,981,441.39	0.14
86	MongoDB Inc	MongoDB 股份有限公司	MDB UQ	纳斯达克证券交易所	美国	661	1,962,992.55	0.14
87	Las Vegas Sands Corp	拉斯维加斯金沙集团	LVS UN	纽约证券交易所	美国	4,585	1,921,556.99	0.14
88	Moody's Corp	穆迪	MCO UN	纽约证券交易所	美国	742	1,864,315.94	0.14
89	Fair Isaac Corp	费埃哲公司	FICO UN	纽约证券交易所	美国	317	1,853,559.11	0.14
90	Shopify Inc	Shopify 股份有限公司	SHOP UN	纽约证券交易所	美国	3,926	1,832,604.51	0.13
91	Sterling Infrastructure	Sterling 基础	STRL UW	纳斯达克证券	美国	4,509	1,818,027.18	0.13

	cture Inc	设施股份有限公司		交易所				
92	Amphenol Corp	安费诺公司	APH UN	纽约证券交易所	美国	2,925	1,795,457.75	0.13
93	Pioneer Natural Resources Co	Pioneer 自然资源公司	PXD UN	纽约证券交易所	美国	1,186	1,775,490.92	0.13
94	Lululemon Athletica Inc	Lululemon Athletica 股份有限公司	LULU UW	纳斯达克证券交易所	美国	642	1,755,847.72	0.13
95	Cintas Corp	CINTAS 公司	CTAS UW	纳斯达克证券交易所	美国	486	1,745,615.12	0.13
96	Palantir Technologies Inc	Palantir 科技股份有限公司	PLTR UN	纽约证券交易所	美国	15,758	1,745,537.52	0.13
97	Copart Inc	Copart 股份有限公司	CPRT UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,626	1,730,705.26	0.13
98	WEX Inc	WEX 股份有限公司	WEX UN	纽约证券交易所	美国	1,292	1,699,757.02	0.12
99	Molson Coors Beverage Co	莫尔森库尔斯饮料公司	TAP UN	纽约证券交易所	美国	3,450	1,641,326.02	0.12
100	Lattice Semiconductor Corp	莱迪斯半导体公司	LSCC UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,344	1,627,164.03	0.12
101	American International Group Inc	美国国际集团	AIG UN	纽约证券交易所	美国	3,824	1,589,914.16	0.12
102	Penske Automotive Group Inc	Penske 汽车集团股份有限公司	PAG UN	纽约证券交易所	美国	1,316	1,584,510.13	0.12

103	Amgen Inc	安进公司	AMGN UW	纳斯达克证券交易所	美国	956	1,533,684.14	0.11
104	Take-Two Interactive Software Inc	Take-Two 互动软件股份有限公司	TTWO UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,429	1,519,525.33	0.11
105	TransDigm Group Inc	TransDigm 集团公司	TDG UN	纽约证券交易所	美国	234	1,511,895.90	0.11
106	Eaton Corp PLC	伊顿	ETN UN	纽约证券交易所	美国	1,039	1,509,779.61	0.11
107	DaVita Inc	DaVita 股份有限公司	DVA UN	纽约证券交易所	美国	2,075	1,506,400.46	0.11
108	Blackstone Inc	黑石集团股份有限公司	BX UN	纽约证券交易所	美国	2,236	1,502,105.95	0.11
109	Arch Capital Group Ltd	阿契资本集团	ACGL UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,723	1,472,737.63	0.11
110	Haemonetics Corp	美商良卫股份有限公司	HAE UN	纽约证券交易所	美国	2,387	1,468,493.41	0.11
111	Principal Financial Group Inc	信安金融	PFG UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,674	1,465,364.49	0.11
112	Edwards Lifesciences Corp	爱德华生命科学公司	EW UN	纽约证券交易所	美国	2,146	1,462,734.45	0.11
113	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	1,461,811.86	0.11
114	Rambus Inc	Rambus 股份有限公司	RMBS UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,137	1,454,562.86	0.11
115	Fiserv Inc	Fiserv 公司	FI UN	纽约证券交易所	美国	1,577	1,437,490.17	0.10
11	Motorola	摩托罗拉	MSI UN	纽约证	美国	672	1,424,090.72	0.10

6	Solutions Inc	拉解决方案股份有限公司		券交易所				
117	Toll Brothers Inc	托尔兄弟公司	TOL UN	纽约证券交易所	美国	2,475	1,414,076.41	0.10
118	Hub Group Inc	中心集团	HUBG UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,410	1,398,706.78	0.10
119	Charles Schwab Corp/The	嘉信理财	SCHW UN	纽约证券交易所	美国	3,385	1,386,354.99	0.10
120	Delta Air Lines Inc	达美航空有限公司	DAL UN	纽约证券交易所	美国	3,996	1,372,684.07	0.10
121	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	294	1,351,151.47	0.10
122	SAP SE	SAP 公司	SAP UN	纽约证券交易所	美国	1,356	1,340,489.66	0.10
123	Equinix Inc	Equinix 有限公司	EQIX UW	纳斯达克证券交易所	美国	236	1,336,844.10	0.10
124	Texas Instruments Inc	德州仪器	TXN UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,014	1,318,999.56	0.10
125	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	191	1,318,436.09	0.10
126	Applied Industrial Technologies Inc	应用工业技术公司	AIT UN	纽约证券交易所	美国	1,249	1,307,094.25	0.10
127	Vertiv Holdings Co	维谛技术	VRT UN	纽约证券交易所	美国	7,136	1,277,223.16	0.09
128	Cigna Group/The	信诺集团	CI UN	纽约证券交易所	美国	628	1,273,307.35	0.09

129	TopBuild Corp	TopBuild 公司	BLD UN	纽约证券交易所	美国	662	1,272,501.24	0.09
130	Linde PLC	Linde PLC	LIN UN	纽约证券交易所	美国	459	1,263,906.01	0.09
131	Monster Beverage Corp	怪兽饮料公司	MNST UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,958	1,227,717.76	0.09
132	Splunk Inc	Splunk 公司	SPLK UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,597	1,224,236.44	0.09
133	Zions Bancorp NA	锡安银行	ZION UW	纳斯达克证券交易所	美国	6,227	1,208,567.22	0.09
134	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	360	1,200,988.66	0.09
135	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	2,426	1,194,479.95	0.09
136	DoorDash Inc	DoorDash 股份有限公司	DASH UN	纽约证券交易所	美国	2,136	1,179,489.88	0.09
137	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴巴	BABA UN	纽约证券交易所	美国	1,951	1,175,029.61	0.09
138	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	2,516	1,174,071.68	0.09
139	SPS Commerce Inc	SPS 商业股份有限公司	SPSC UW	纳斯达克证券交易所	美国	844	1,171,292.35	0.09
140	World Wrestling Entertainment	世界摔角娱乐公司	WWE UN	纽约证券交易所	美国	1,492	1,169,403.53	0.09

	ment Inc							
14 1	FedEx Corp	联邦快递	FDX UN	纽约证券交易所	美国	649	1,162,538.01	0.08
14 2	Skechers USA Inc	斯凯奇美国公司	SKX UN	纽约证券交易所	美国	3,053	1,161,698.95	0.08
14 3	PG&E Corp	太平洋煤气电力	PCG UN	纽约证券交易所	美国	9,231	1,152,599.50	0.08
14 4	Marathon Oil Corp	Marathon 石油公司	MRO UN	纽约证券交易所	美国	6,917	1,150,559.36	0.08
14 5	Datadog Inc	Datadog 股份有限公司	DDOG UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,618	1,150,194.46	0.08
14 6	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	1,078	1,133,748.97	0.08
14 7	Wynn Resorts Ltd	永利渡假村有限公司	WYNN UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,483	1,131,702.12	0.08
14 8	DraftKings Inc	DraftKings 股份有限公司	DKNG UW	纳斯达克证券交易所	美国	5,797	1,112,963.17	0.08
14 9	Marsh & McLennan Cos Inc	Marsh & McLennan 股份有限公司	MMC UN	纽约证券交易所	美国	808	1,098,095.00	0.08
15 0	DR Horton Inc	霍顿房屋公司	DHI UN	纽约证券交易所	美国	1,243	1,092,979.35	0.08
15 1	Veeva Systems Inc	Veeva Systems 股份有限公司	VEEV UN	纽约证券交易所	美国	758	1,082,998.13	0.08
15 2	Jabil Inc	捷普集团	JBL UN	纽约证券交易所	美国	1,377	1,073,895.58	0.08

				所				
153	Ameriprise Financial Inc	阿默普莱斯金融公司	AMP UN	纽约证券交易所	美国	444	1,065,654.05	0.08
154	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	1,742	1,061,113.07	0.08
155	Tapestry Inc	TPR-DR S-RS	TPR UN	纽约证券交易所	美国	3,404	1,052,735.47	0.08
156	Terex Corp	特雷克斯公司	TEX UN	纽约证券交易所	美国	2,432	1,051,401.30	0.08
157	Chevron Corp	雪佛龙	CVX UN	纽约证券交易所	美国	911	1,035,788.44	0.08
158	Western Union Co/The	西联汇款	WU UN	纽约证券交易所	美国	12,184	1,032,699.20	0.08
159	IVERIC bio Inc	IVERIC 生物公司	ISEE UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,590	1,020,504.07	0.07
160	NetApp Inc	美国网域存储技术有限公司	NTAP UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,841	1,016,326.11	0.07
161	NetEase Inc	网易	NTES UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,409	984,415.61	0.07
162	Progressive Corp/The	前进保险公司	PGR UN	纽约证券交易所	美国	1,029	984,217.04	0.07
163	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	819	969,001.89	0.07
164	Boston Scientific Corp	波士顿科学	BSX UN	纽约证券交易所	美国	2,397	936,851.92	0.07
165	S&P Global Inc	标普全球	SPGI UN	纽约证券交易所	美国	320	926,960.31	0.07

166	VMware Inc	VMware 股份有限公司	VMW UN	纽约证券交易所	美国	888	921,988.38	0.07
167	Cargurus Inc	Cargurus Inc	CARG UW	纳斯达克证券交易所	美国	5,638	921,924.94	0.07
168	API Group Corp	API 集团公司	APG UN	纽约证券交易所	美国	4,675	920,859.56	0.07
169	Paychex Inc	Paychex 公司	PAYX UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,127	911,010.73	0.07
170	Atkore Inc	Atkore 股份有限公司	ATKR UN	纽约证券交易所	美国	799	900,306.21	0.07
171	DoubleVerify Holdings Inc	DoubleVerify Holdings Inc	DV UN	纽约证券交易所	美国	3,187	896,274.07	0.07
172	Pentair PLC	Pentair 公共有限公司	PNR UN	纽约证券交易所	美国	1,919	895,763.64	0.07
173	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	1,586	884,950.37	0.06
174	Boyd Gaming Corp	Boyd 博彩公司	BYD UN	纽约证券交易所	美国	1,744	874,186.53	0.06
175	Match Group Inc	Match 集团股份有限公司	MTCH UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,887	873,028.02	0.06
176	Nucor Corp	纽柯公司	NUE UN	纽约证券交易所	美国	728	862,597.51	0.06
177	Inspire Medical Systems Inc	Inspire 医疗系统股份有限公司	INSP UN	纽约证券交易所	美国	366	858,556.84	0.06
178	Ingersoll Rand Inc	英格索兰股份	IR UN	纽约证券交易所	美国	1,779	840,183.07	0.06

		有限公司		所				
179	Expeditors International of Washington 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	834,123.88	0.06
180	Lennar Corp	Lennar 公司	LEN UN	纽约证券交易所	美国	919	832,122.33	0.06
181	Bentley Systems Inc	Bentley 系统公司	BSY UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,116	829,165.46	0.06
182	Snap-on Inc	实耐宝	SNA UN	纽约证券交易所	美国	396	824,631.71	0.06
183	United Rentals Inc	联合租赁公司	URI UN	纽约证券交易所	美国	256	823,847.56	0.06
184	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	450	813,422.76	0.06
185	Hess Corp	赫斯公司	HES UN	纽约证券交易所	美国	820	805,524.96	0.06
186	Morgan Stanley	摩根士丹利	MS UN	纽约证券交易所	美国	1,299	801,591.23	0.06
187	Jefferies Financial Group Inc	杰富瑞金融集团	JEF UN	纽约证券交易所	美国	3,344	801,489.20	0.06
188	Capital One Financial Corp	第一资本金融	COF UN	纽约证券交易所	美国	1,000	790,285.75	0.06
189	EOG Resources Inc	EOG 资源	EOG UN	纽约证券交易所	美国	951	786,401.44	0.06
190	Iron Mountain Inc	美国铁山公司	IRM UN	纽约证券交易所	美国	1,908	783,367.48	0.06
191	PACCAR	帕卡	PCAR UW	纳斯达克	美国	1,287	777,911.92	0.06

1	Inc			克证券 交易所				
19 2	Crane NXT Co	Crane NXT Co	CXT UN	纽约证 券交易 所	美国	1,903	776,089.36	0.06
19 3	Nordstrom Inc	诺德斯 特龙公 司	JWN UN	纽约证 券交易 所	美国	5,233	774,024.16	0.06
19 4	Zoom Video Communica tions Inc	Zoom 视 频通信 股份有 限公司	ZM UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,568	769,084.09	0.06
19 5	InterDigi tal Inc	InterD igital 股份有 限公司	IDCC UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,092	761,834.88	0.06
19 6	FleetCor Technolog ies Inc	FleetC or 技术 股份有 限公司	FLT UN	纽约证 券交易 所	美国	414	751,101.10	0.05
19 7	Citigroup Inc	花旗集 团	C UN	纽约证 券交易 所	美国	2,245	746,857.24	0.05
19 8	Cardinal Health Inc	嘉德诺 健康集 团	CAH UN	纽约证 券交易 所	美国	1,085	741,428.14	0.05
19 9	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	2,063	738,782.27	0.05
20 0	Altair Engineeri ng Inc	Altair Engine ering 股份有 限公司	ALTR UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,348	738,710.30	0.05
20 1	AECOM	AECOM 公司	ACM UN	纽约证 券交易 所	美国	1,206	738,015.32	0.05
20 2	Abbott Laborator ies	雅培制 药	ABT UN	纽约证 券交易 所	美国	933	734,977.02	0.05
20 3	Dow Inc	陶氏公 司	DOW UN	纽约证 券交易	美国	1,899	730,822.76	0.05

				所				
204	ChampionX Corp	ChampionX 公司	CHX UN	纳斯达克证券交易所	美国	3,258	730,733.01	0.05
205	Celanese Corp	塞拉尼斯公司	CE UN	纽约证券交易所	美国	868	726,296.95	0.05
206	Tenet Healthcare Corp	Tenet 医疗保健公司	THC UN	纽约证券交易所	美国	1,233	725,047.90	0.05
207	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	西屋制动公司	WAB UN	纽约证券交易所	美国	913	723,510.03	0.05
208	Ecolab Inc	艺康集团	ECL UN	纽约证券交易所	美国	534	720,357.78	0.05
209	MercadoLibre Inc	MercadoLibre 股份有限公司	MELI UN	纳斯达克证券交易所	美国	84	719,013.35	0.05
210	Entegris Inc	Entegris 股份有限公司	ENTG UN	纳斯达克证券交易所	美国	897	718,284.55	0.05
211	Berkshire Hathaway Inc	伯克希尔哈撒韦公司	BRK/B UN	纽约证券交易所	美国	291	717,023.36	0.05
212	Science Applications International Corp	科学应用国际公司	SAIC UN	纽约证券交易所	美国	855	694,908.08	0.05
213	Euronet Worldwide Inc	Euronet 全球公司	EEFT UN	纳斯达克证券交易所	美国	818	693,739.38	0.05
214	Tyler Technologies Inc	Tyler 科技公司	TYL UN	纽约证券交易所	美国	230	692,145.65	0.05
215	Lincoln Electric Holdings Inc	林肯电气控股股份有限公司	LECO UN	纳斯达克证券交易所	美国	478	686,054.59	0.05

21 6	Playtika Holding Corp	Playtika Holding Corp	PLTK UW	纳斯达克证券交易所	美国	8,020	672,230.63	0.05
21 7	Simpson Manufacturing Co Inc	辛普森制造有限公司	SSD UN	纽约证券交易所	美国	669	669,517.34	0.05
21 8	Starbucks Corp	星巴克公司	SBUX UW	纳斯达克证券交易所	美国	935	669,261.54	0.05
21 9	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	1,484	666,118.18	0.05
22 0	Interactive Brokers Group Inc	盈透证券集团股份有限公司	IBKR UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,096	657,870.94	0.05
22 1	Cheniere Energy Inc	Cheniere 能源公司	LNG UA	纽约证券交易所	美国	590	649,544.50	0.05
22 2	Ball Corp	波尔	BALL UN	纽约证券交易所	美国	1,538	646,904.05	0.05
22 3	XPO Inc	XPO 股份有限公司	XPO UN	纽约证券交易所	美国	1,513	645,025.49	0.05
22 4	EMCOR Group Inc	埃姆科集团公司	EME UN	纽约证券交易所	美国	482	643,558.36	0.05
22 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	443	639,821.76	0.05
22 6	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	636	639,570.88	0.05
22 7	STAG Industrial Inc	STAG 实业公司	STAG UN	纽约证券交易所	美国	2,455	636,487.48	0.05
22 8	Aon PLC	怡安集团	AON UN	纽约证券交易所	美国	255	636,058.27	0.05

229	Littelfuse Inc	Littelfuse 股份有限公司	LFUS UW	纳斯达克证券交易所	美国	302	635,694.23	0.05
230	L3Harris Technologies Inc	L3Harris Technologies 股份有限公司	LHX UN	纽约证券交易所	美国	442	625,250.93	0.05
231	Analog Devices Inc	亚德诺半导体	ADI UW	纳斯达克证券交易所	美国	444	625,000.20	0.05
232	DuPont de Nemours Inc	杜邦公司	DD UN	纽约证券交易所	美国	1,209	624,099.28	0.05
233	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	472	617,416.86	0.04
234	Albemarle Corp	雅保公司	ALB UN	纽约证券交易所	美国	372	599,665.38	0.04
235	Wells Fargo & Co	富国银行	WFC UN	纽约证券交易所	美国	1,919	591,814.12	0.04
236	OneMain Holdings Inc	OneMain 控股股份有限公司	OMF UN	纽约证券交易所	美国	1,874	591,612.81	0.04
237	Altria Group Inc	高特利	MO UN	纽约证券交易所	美国	1,780	582,645.16	0.04
238	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	604	573,305.38	0.04
239	Exact Sciences Corp	Exact 科学公司	EXAS UR	纳斯达克证券交易所	美国	841	570,620.70	0.04
240	Builders FirstSource Inc	Builders FirstS	BLDR UN	纽约证券交易所	美国	578	568,005.69	0.04

		ource 股份有 限公司						
24 1	Wintrust Financial Corp	Wintru st 金融 公司	WTFC UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,081	567,241.34	0.04
24 2	Crane Co	Crane Co	CR UN	纽约证 券交易 所	美国	872	561,535.99	0.04
24 3	Axcelis Technolog ies Inc	Axceli s 技术 股份有 限公司	ACLS UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	420	556,376.48	0.04
24 4	Marathon Petroleum Corp	马拉松 石油公 司	MPC UN	纽约证 券交易 所	美国	645	543,430.74	0.04
24 5	Goldman Sachs Group Inc/The	高盛	GS UN	纽约证 券交易 所	美国	233	543,032.02	0.04
24 6	PTC Inc	PTC 公 司	PTC UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	528	542,906.15	0.04
24 7	Novanta Inc	Novant a 股份 有限公 司	NOVT UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	396	526,786.83	0.04
24 8	Apollo Global Managem ent 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	947	525,597.97	0.04
24 9	Stifel Financial Corp	斯迪富 融资公 司	SF UN	纽约证 券交易 所	美国	1,178	507,910.59	0.04
25 0	Carlisle Cos Inc	卡莱股 份有限 公司	CSL UN	纽约证 券交易 所	美国	271	502,334.94	0.04
25 1	Ingredion Inc	宜瑞安 公司	INGR UN	纽约证 券交易 所	美国	654	500,685.08	0.04
25 2	Gartner Inc	Gartne r 公司	IT UN	纽约证 券交易 所	美国	193	488,535.11	0.04

25 3	Airbnb Inc	爱彼迎 股份有 限公司	ABNB UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	527	488,032.84	0.04
25 4	CSX Corp	CSX 公 司	CSX UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,974	486,393.17	0.04
25 5	Amerisour ceBergen Corp	美源伯 根	ABC UN	纽约证 券交易 所	美国	341	474,147.10	0.03
25 6	PNC Financial Services Group Inc/The	PNC 财 务服务	PNC UN	纽约证 券交易 所	美国	515	468,696.10	0.03
25 7	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	969	467,230.13	0.03
25 8	Confluent Inc	Conflu ent 股 份有限 公司	CFLT UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,827	466,146.26	0.03
25 9	Advanced Drainage Systems Inc	先进排 水系统 公司	WMS UN	纽约证 券交易 所	美国	556	457,116.25	0.03
26 0	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	1,755	454,497.04	0.03
26 1	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	1,249	453,597.72	0.03
26 2	Bright Horizons Family Solutions Inc	光明地 平线家 庭解决 方案股 份有限 公司	BFAM UN	纽约证 券交易 所	美国	678	452,921.09	0.03
26 3	Artisan Partners Asset Managemen	阿尔笛 生合伙 人资产 管理股	APAM UN	纽约证 券交易 所	美国	1,590	451,633.45	0.03

	t Inc	份有限 公司						
26 4	Newmont Corp	纽蒙黄 金公司	NEM UN	纽约证 券交易 所	美国	1,457	449,124.08	0.03
26 5	Ryder System Inc	莱德系 统股份 有限公 司	R UN	纽约证 券交易 所	美国	717	439,288.39	0.03
26 6	Franklin Resources Inc	富兰克 林资源	BEN UN	纽约证 券交易 所	美国	2,274	438,884.54	0.03
26 7	Trip.com Group Ltd	携程集 团	TCOM UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,729	437,269.29	0.03
26 8	GXO Logistics Inc	GXO Logist ics股 份有限 公司	GXO UN	纽约证 券交易 所	美国	959	435,313.84	0.03
26 9	Halliburt on Co	哈利伯 顿	HAL UN	纽约证 券交易 所	美国	1,817	433,134.90	0.03
27 0	Cboe Global Markets Inc	Cboe 环 球市场 公司	CBOE UF	芝加 哥期 权交 易所	美国	434	432,798.97	0.03
27 1	CDW Corp/DE	特拉华 CDW 公 司	CDW UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	324	429,602.71	0.03
27 2	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	606	427,461.85	0.03
27 3	NCR Corp	NCR 公 司	NCR UN	纽约证 券交易 所	美国	2,346	427,183.52	0.03
27 4	Maximus Inc	MAXIMU S股份 有限公 司	MMS UN	纽约证 券交易 所	美国	694	423,792.74	0.03
27 5	Bristol-M yers Squibb Co	百时美 施贵宝 公司	BMY UN	纽约证 券交易 所	美国	908	419,577.64	0.03

276	Broadridge Financial Solutions Inc	布罗德里奇金融解决方案股份有限公司	BR UN	纽约证券交易所	美国	349	417,686.43	0.03
277	Phillips 66	Phillips 66	PSX UN	纽约证券交易所	美国	605	416,964.07	0.03
278	Parker-Hannifin Corp	派克汉尼汾公司	PH UN	纽约证券交易所	美国	147	414,297.60	0.03
279	Akamai Technologies Inc	阿卡迈技术公司	AKAM UW	纳斯达克证券交易所	美国	633	411,059.21	0.03
280	Best Buy Co Inc	百思买	BBY UN	纽约证券交易所	美国	693	410,362.94	0.03
281	News Corp	新闻集团	NWS UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,868	408,669.28	0.03
282	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股	TCEHY UV	纽约证券交易所	美国	1,330	408,342.24	0.03
283	Avient Corp	Avient 公司	AVNT UN	纽约证券交易所	美国	1,364	403,110.04	0.03
284	Ralph Lauren Corp	拉夫劳伦	RL UN	纽约证券交易所	美国	450	400,923.51	0.03
285	Rollins Inc	Rollins 公司	ROL UN	纽约证券交易所	美国	1,279	395,826.22	0.03
286	Marvell Technology Inc	美满电子科技公司	MRVL UW	纳斯达克证券交易所	美国	916	395,673.82	0.03
287	Upbound Group Inc	Upbound 集团股份有限公司	UPBD UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,758	395,443.03	0.03
288	IQVIA Holdings Inc	艾昆纬	IQV UN	纽约证券交易所	美国	238	386,546.05	0.03
28	Primerica	Primer	PRI UN	纽约证	美国	267	381,536.11	0.03

9	Inc	ica 股份有限公司		券交易所				
290	Autodesk Inc	欧特克	ADSK UW	纳斯达克证券交易所	美国	258	381,445.50	0.03
291	ONEOK Inc	Oneok 股份有限公司	OKE UN	纽约证券交易所	美国	850	379,079.92	0.03
292	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	148	378,189.12	0.03
293	Travelers Cos Inc/The	旅行家集团	TRV UN	纽约证券交易所	美国	301	377,704.56	0.03
294	SiteOne Landscape Supply Inc	SiteOne Landscape Supply 股份有限公司	SITE UN	纽约证券交易所	美国	303	366,420.90	0.03
295	Opendoor Technologies Inc	Opendoor Technologies Inc	OPEN UW	纳斯达克证券交易所	美国	12,608	366,233.60	0.03
296	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	462	365,178.78	0.03
297	Axon Enterprise Inc	Axon Enterprise 股份有限公司	AXON UW	纳斯达克证券交易所	美国	259	365,163.61	0.03
298	Commercial Metals Co	美国商业金属公司	CMC UN	纽约证券交易所	美国	928	353,113.86	0.03
299	DXC Technology Co	DXC 技术公司	DXC UN	纽约证券交易所	美国	1,823	351,972.76	0.03
300	Union Pacific	联合太平洋	UNP UN	纽约证券交易所	美国	229	338,586.39	0.02

	Corp			所				
301	Vulcan Materials Co	Vulcan 材料	VMC UN	纽约证 券交易 所	美国	206	335,570.78	0.02
302	Kinsale Capital Group Inc	Kinsale 资本 集团股份 有限公司	KNSL UN	纽约证 券交易 所	美国	121	327,171.22	0.02
303	Vontier Corp	Vontier Corp	VNT UN	纽约证 券交易 所	美国	1,384	322,116.34	0.02
304	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	297	321,673.32	0.02
305	Caesars Entertainment Inc	凯撒娱乐集团	CZR UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	860	316,737.16	0.02
306	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	61	316,713.61	0.02
307	Bunge Ltd	邦吉有 限公司	BG UN	纽约证 券交易 所	美国	461	314,288.70	0.02
308	Eagle Materials Inc	鹰牌材 料有限公 司	EXP UN	纽约证 券交易 所	美国	233	313,858.84	0.02
309	BILL Holdings Inc	Bill 控 股股份 有限公司	BILL UN	纽约证 券交易 所	美国	363	306,493.51	0.02
310	Dover Corp	都福	DOV UN	纽约证 券交易 所	美国	287	306,197.25	0.02
311	Raytheon Technologies Corp	雷神技 术公司	RTX UN	纽约证 券交易 所	美国	430	304,370.93	0.02
312	Ovintiv Inc	Ovintiv 股份 有限公 司	OVV UN	纽约证 券交易 所	美国	1,105	303,970.26	0.02

		司						
313	Procore Technologies Inc	Procore Technologies Inc	PCOR UN	纽约证券交易所	美国	642	301,857.36	0.02
314	MGM Resorts International	美高梅国际酒店集团	MGM UN	纽约证券交易所	美国	941	298,633.06	0.02
315	Coty Inc	科蒂集团	COTY UN	纽约证券交易所	美国	3,347	297,230.61	0.02
316	Rockwell Automation Inc	洛克韦尔自动化	ROK UN	纽约证券交易所	美国	123	292,806.40	0.02
317	AMETEK Inc	阿美特克股份有限公司	AME UN	纽约证券交易所	美国	250	292,428.13	0.02
318	Watsco Inc	Watsco 公司	WSO UN	纽约证券交易所	美国	106	292,181.15	0.02
319	Lincoln National Corp	林肯国民	LNC UN	纽约证券交易所	美国	1,539	286,464.24	0.02
320	Dell Technologies Inc	戴尔科技公司	DELL UN	纽约证券交易所	美国	730	285,421.27	0.02
321	10X Genomics Inc	10X Genomics 股份有限公司	TXG UW	纳斯达克证券交易所	美国	700	282,442.07	0.02
322	McCormick & Co Inc/MD	味好美股份有限公司/马里兰州	MKC UN	纽约证券交易所	美国	447	281,747.02	0.02
323	A O Smith Corp	AO 史密斯公司	AOS UN	纽约证券交易所	美国	528	277,671.89	0.02
324	Walmart Inc	沃尔玛股份有	WMT UN	纽约证	美国	243	275,987.55	0.02

		限公司		所				
32 5	Dynatrace Inc	Dynatrace 股份有限 公司	DT UN	纽约证 券交易 所	美国	742	275,958.65	0.02
32 6	Teledyne Technolog ies Inc	Teledyne 科技股 份有限 公司	TDY UN	纽约证 券交易 所	美国	92	273,295.07	0.02
32 7	Moog Inc	穆格公 司	MOG/A UN	纽约证 券交易 所	美国	346	271,088.75	0.02
32 8	New York Times Co/The	纽约时 报	NYT UN	纽约证 券交易 所	美国	939	267,194.33	0.02
32 9	Bath & Body Works Inc	Bath & Body Works 股份有 限公司	BBWI UN	纽约证 券交易 所	美国	969	262,567.51	0.02
33 0	Gilead Sciences Inc	吉利德 科学	GILD UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	471	262,296.32	0.02
33 1	Lancaster Colony Corp	Lancaster Colony 公司	LANC UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	178	258,640.43	0.02
33 2	Otis Worldwide Corp	奥的斯 电梯公 司	OTIS UN	纽约证 券交易 所	美国	393	252,765.20	0.02
33 3	Sherwin-W illiams Co/The	宣伟公 司	SHW UN	纽约证 券交易 所	美国	129	247,498.68	0.02
33 4	Trane Technolog ies PLC	特灵科 技公共 有限公司	TT UN	纽约证 券交易 所	美国	175	241,851.14	0.02
33 5	Exxon Mobil Corp	埃克森 美孚石 油公司	XOM UN	纽约证 券交易 所	美国	306	237,139.92	0.02
33 6	Sprouts Farmers Market Inc	Sprouts Farmers	SFM UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	862	228,777.93	0.02

		Market 股份有 限公司						
33 7	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	235	224,466.95	0.02
33 8	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	221,998.25	0.02
33 9	GE HealthCar e Technolog ies Inc	GE Health Care Techno logies Inc	GEHC UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	365	214,263.76	0.02
34 0	Westlake Corp	Westla ke 公司	WLK UN	纽约证 券交易 所	美国	248	214,090.05	0.02
34 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	626	209,702.54	0.02
34 2	Korn Ferry	光辉国 际	KFY UN	纽约证 券交易 所	美国	581	207,978.32	0.02
34 3	Vistra Corp	Vistra 公司	VST UN	纽约证 券交易 所	美国	1,075	203,903.04	0.01
34 4	Targa Resources Corp	Targa 资源公 司	TRGP UN	纽约证 券交易 所	美国	367	201,807.20	0.01
34 5	Allegro MicroSyst ems Inc	Allegr o MicroS ystems 股份有 限公司	ALGM UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	612	199,617.64	0.01
34 6	Honeywell Internati onal Inc	霍尼韦 尔	HON UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	130	194,915.96	0.01
34 7	Element Solutions Inc	Elemen t 解决 方案股	ESI UN	纽约证 券交易 所	美国	1,404	194,784.45	0.01

		份有限公司						
348	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	397	190,535.24	0.01
349	eBay Inc	eBay 公司	EBAY UW	纳斯达克证券交易所	美国	586	189,231.71	0.01
350	Intel Corp	英特尔	INTC UW	纳斯达克证券交易所	美国	777	187,747.09	0.01
351	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	111	183,407.93	0.01
352	United States Steel Corp	美国钢铁	X UN	纽约证券交易所	美国	1,001	180,897.98	0.01
353	Darden Restaurants Inc	达登餐饮公司	DRI UN	纽约证券交易所	美国	148	178,678.43	0.01
354	Verizon Communications Inc	Verizon 通信股份有限公司	VZ UN	纽约证券交易所	美国	655	176,016.51	0.01
355	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	367	173,060.94	0.01
356	Valero Energy Corp	Valero 能源	VLO UN	纽约证券交易所	美国	203	172,060.03	0.01
357	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	169,685.92	0.01
358	Magnolia Oil & Gas Corp	Magnolia Oil & Gas Corp	MGY UN	纽约证券交易所	美国	1,110	167,631.33	0.01

359	Chesapeake Energy Corp	切萨皮克能源公司	CHK UW	纳斯达克证券交易所	美国	277	167,489.42	0.01
360	Cisco Systems Inc	思科系统股份有限公司	CSCO UW	纳斯达克证券交易所	美国	446	166,742.85	0.01
361	Humana Inc	Humana 股份有限公司	HUM UN	纽约证券交易所	美国	51	164,774.47	0.01
362	Generac Holdings Inc	Generac 控股公司	GNRC UN	纽约证券交易所	美国	148	159,482.37	0.01
363	Sanmina Corp	Sanmina 公司	SANM UW	纳斯达克证券交易所	美国	365	158,957.12	0.01
364	Trex Co Inc	Trex 公司	TREX UN	纽约证券交易所	美国	304	144,011.93	0.01
365	Omnice ll Inc	Omnice ll 股份有限公司	OMCL UW	纳斯达克证券交易所	美国	269	143,195.34	0.01
366	Toro Co/The	托罗公司	TTC UN	纽约证券交易所	美国	191	140,289.99	0.01
367	IDEX Corp	艺达思集团	IEX UN	纽约证券交易所	美国	89	138,432.89	0.01
368	LKQ Corp	LKQ 公司	LKQ UW	纳斯达克证券交易所	美国	327	137,682.49	0.01
369	Ulta Beauty Inc	Ulta 美容产品公司	ULTA UW	纳斯达克证券交易所	美国	40	136,017.01	0.01
370	ZTO Express Cayman Inc	中通快递	ZTO UN	纽约证券交易所	美国	745	135,011.18	0.01
371	RenaissanceRe Holdings Ltd	复兴再保险控股公司	RNR UN	纽约证券交易所	美国	100	134,775.62	0.01
37	CF	CF 工业	CF UN	纽约证	美国	268	134,432.83	0.01

2	Industrie s Holdings Inc	控股股 份有限 公司		券交易 所				
37 3	Alcon Inc	爱尔康 公司	ALC UN	纽约证 券交易 所	美国	224	132,901.54	0.01
37 4	Textron Inc	德事隆	TXT UN	纽约证 券交易 所	美国	261	127,545.70	0.01
37 5	Brightsp here Investmen t Group Inc	Bright sphere 投资集 团有限 公司	BSIG UN	纽约证 券交易 所	美国	810	122,618.21	0.01
37 6	Tradeweb Markets Inc	Tradew eb Market s 股份 有限公 司	TW UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	237	117,273.00	0.01
37 7	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	105	109,352.73	0.01
37 8	Schlumber ger NV	斯伦贝 谢公众 有限公 司	SLB UN	纽约证 券交易 所	美国	308	109,318.84	0.01
37 9	ROBLOX Corp	Roblox 公司	RBLX UN	纽约证 券交易 所	美国	375	109,199.90	0.01
38 0	ResMed Inc	瑞思迈 股份有 限公司	RMD UN	纽约证 券交易 所	美国	69	108,939.77	0.01
38 1	JD.com Inc	京东集 团	JD UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	434	107,031.58	0.01
38 2	Crowdstri ke Holdings Inc	CrowdS trike 控股股 份有限 公司	CRWD UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	100	106,125.32	0.01
38 3	Brink's Co/The	Brink's 公司	BCO UN	纽约证 券交易 所	美国	208	101,946.21	0.01

384	Kroger Co/The	克罗格公司	KR UN	纽约证券交易所	美国	298	101,204.55	0.01
385	BOK Financial Corp	BOK 金融公司	BOKF UW	纳斯达克证券交易所	美国	172	100,396.42	0.01
386	Automatic Data Processing Inc	ADP 公司	ADP UW	纳斯达克证券交易所	美国	63	100,053.99	0.01
387	AppLovin Corp	AppLovin 公司	APP UW	纳斯达克证券交易所	美国	537	99,838.95	0.01
388	Insulet Corp	Insulet 股份有限公司	PODD UW	纳斯达克证券交易所	美国	47	97,923.90	0.01
389	Constellation Energy Corp	美国联合能源公司	CEG UW	纳斯达克证券交易所	美国	148	97,905.25	0.01
390	Archer-Daniels-Midland Co	Archer-Daniels-Midland 公司	ADM UN	纽约证券交易所	美国	179	97,730.68	0.01
391	Molina Healthcare Inc	Molina Healthcare 股份有限公司	MOH UN	纽约证券交易所	美国	43	93,598.10	0.01
392	Intercontinental Exchange Inc	洲际交易所 (ICE)	ICE UN	纽约证券交易所	美国	111	90,697.37	0.01
393	CVS Health Corp	CVS 健康公司	CVS UN	纽约证券交易所	美国	180	89,913.52	0.01
394	Vitesse Energy Inc	Vitesse Energy Inc	VTS UN	纽约证券交易所	美国	531	85,946.56	0.01
395	Omnicom Group Inc	Omnicom 集团	OMC UN	纽约证券交易所	美国	124	85,254.32	0.01

396	Arista Networks Inc	Arista 网络股份有限公司	ANET UN	纽约证券交易所	美国	69	80,799.91	0.01
397	Arcosa Inc	Arcosa Inc	ACA UN	纽约证券交易所	美国	146	79,934.83	0.01
398	Veritiv Corp	Veritiv 有限公司	VRTV UN	纽约证券交易所	美国	83	75,333.52	0.01
399	Kraft Heinz Co/The	卡夫亨氏公司	KHC UW	纳斯达克证券交易所	美国	291	74,646.13	0.01
400	Simon Property Group Inc	西蒙房地产集团公司	SPG UN	纽约证券交易所	美国	87	72,595.88	0.01
401	AAR Corp	AAR 公司	AIR UN	纽约证券交易所	美国	171	71,368.94	0.01
402	Paycom Software Inc	Paycom 软件股份有限公司	PAYC UN	纽约证券交易所	美国	28	64,994.05	0.00
403	US Bancorp	美国合众银行	USB UN	纽约证券交易所	美国	272	64,937.40	0.00
404	FNB Corp/PA	FNB/宾州	FNB UN	纽约证券交易所	美国	778	64,311.93	0.00
405	Six Flags Entertainment Corp	六旗娱乐公司	SIX UN	纽约证券交易所	美国	337	63,263.76	0.00
406	Manulife Financial Corp	宏利金融	MFC UN	纽约证券交易所	美国	457	62,444.42	0.00
407	Westrock Co	WestRock 公司	WRK UN	纽约证券交易所	美国	268	56,294.47	0.00
408	Tractor Supply Co	拖拉机供应公司	TSCO UW	纳斯达克证券交易所	美国	33	52,721.60	0.00
409	LPL Financial Holdings	LPL 金融控股公司	LPLA UW	纳斯达克证券交易所	美国	33	51,846.49	0.00

	Inc							
410	Kinder Morgan Inc	特拉华州金德摩根公司	KMI UN	纽约证券交易所	美国	415	51,637.73	0.00
411	Webster Financial Corp	韦伯斯特金融公司	WBS UN	纽约证券交易所	美国	176	48,008.22	0.00
412	UWM Holdings Corp	UWM 控股公司	UWMC UN	纽约证券交易所	美国	1,128	45,643.93	0.00
413	American Express Co	美国运通	AXP UN	纽约证券交易所	美国	36	45,314.44	0.00
414	Chemed Corp	Chemed 公司	CHE UN	纽约证券交易所	美国	11	43,053.99	0.00
415	Organon & Co	Organon & Co	OGN UN	纽约证券交易所	美国	269	40,449.23	0.00
416	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	117	40,402.55	0.00
417	Teradyne Inc	泰瑞达	TER UW	纳斯达克证券交易所	美国	45	36,200.17	0.00
418	Plug Power Inc	普拉格动力公司	PLUG UR	纳斯达克证券交易所	美国	471	35,360.83	0.00
419	Biogen Inc	渤健公司	BIIB UW	纳斯达克证券交易所	美国	17	34,990.58	0.00
420	MicroStrategy Inc	微策略公司	MSTR UW	纳斯达克证券交易所	美国	13	32,165.36	0.00
421	Moderna Inc	莫德纳公司	MRNA UW	纳斯达克证券交易所	美国	36	31,605.65	0.00
422	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	23	31,566.77	0.00

423	AZEK Co Inc/The	AZEK 股份有限公司	AZEK UN	纽约证券交易所	美国	143	31,298.34	0.00
424	Performance Food Group Co	Performance 食品集团公司	PFGC UN	纽约证券交易所	美国	70	30,469.75	0.00
425	Everest Re Group Ltd	安富来集团有限公司	RE UN	纽约证券交易所	美国	12	29,642.54	0.00
426	Exelon Corp	Exelon 公司	EXC UW	纳斯达克证券交易所	美国	99	29,143.53	0.00
427	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	53	27,401.32	0.00
428	LendingClub Corp	LendingClub 公司	LC UN	纽约证券交易所	美国	350	24,658.04	0.00
429	MSCI Inc	MSCI 明晟	MSCI UN	纽约证券交易所	美国	7	23,736.97	0.00
430	Teladoc Health Inc	Teladoc 健康股份有限公司	TDOC UN	纽约证券交易所	美国	128	23,418.53	0.00
431	Masimo Corp	Masimo 公司	MASI UW	纳斯达克证券交易所	美国	18	21,402.10	0.00
432	QIAGEN NV	德国 QIAGEN 公共有限公司	QGEN UN	纽约证券交易所	美国	64	20,824.18	0.00
433	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	61	20,619.40	0.00
434	Macy's Inc	梅西百货股份有限公司	M UN	纽约证券交易所	美国	161	18,671.83	0.00
43	SkyWest	SkyWes	SKYW UW	纳斯达克	美国	63	18,536.78	0.00

5	Inc	t 股份 有限公司		克证券 交易所				
43 6	AMC Networks Inc	AMC 网 络公司	AMCX UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	210	18,133.15	0.00
43 7	Snap Inc	Snap 股 份有限 公司	SNAP UN	纽约证 券交易 所	美国	205	17,538.46	0.00
43 8	Crown Holdings Inc	Crown 控 股股份 有限公 司	CCK UN	纽约证 券交易 所	美国	27	16,948.04	0.00
43 9	Carvana Co	Carvan a 公司	CVNA UN	纽约证 券交易 所	美国	90	16,856.35	0.00
44 0	AutoNatio n Inc	AutoNa tion 股 份有限 公司	AN UN	纽约证 券交易 所	美国	14	16,652.15	0.00
44 1	RingCentr al Inc	RingCe ntral 股 份有限 公司	RNG UN	纽约证 券交易 所	美国	68	16,082.03	0.00
44 2	Stanley Black & Decker Inc	史丹利 百得公 司	SWK UN	纽约证 券交易 所	美国	21	14,219.72	0.00
44 3	Agilent Technolog ies Inc	安捷伦	A UN	纽约证 券交易 所	美国	14	12,164.63	0.00
44 4	SiTime Corp	SiTime Corp	SITM UQ	纳斯达 克证券 交易所	美国	11	9,376.70	0.00
44 5	Wayfair Inc	Wayfai r 股份 有限公 司	W UN	纽约证 券交易 所	美国	19	8,925.24	0.00
44 6	Eastman Chemical Co	伊士曼 化工	EMN UN	纽约证 券交易 所	美国	10	6,049.44	0.00
44 7	iHeartMed ia Inc	iHeart Media 股 份有	IHRT UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	156	4,103.10	0.00

		限公司						
448	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	3,254.36	0.00
449	MarketAxess Holdings Inc	MarketAxess 控股公司	MKTX UW	纳斯达克证券交易所	美国	1	1,888.97	0.00
450	Brunswick Corp/DE	宾士域集团（特拉华州）	BC UN	纽约证券交易所	美国	3	1,878.13	0.00
451	Peloton Interactive Inc	派乐腾	PTON UW	纳斯达克证券交易所	美国	25	1,389.16	0.00

注：1. 本表所使用的证券代码为彭博代码。

2. 报告期末本基金持有的“Apple Inc”、“Microsoft Corp”市值占净值比例被动超过10%，已于合同约定的期限内调整至10%以下。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Alphabet Inc	GOOGL UW	21,178,524.48	1.67
2	Microsoft Corp	MSFT UW	16,176,351.40	1.27
3	Amazon.com Inc	AMZN UW	13,869,776.77	1.09
4	Meta Platforms Inc	META UW	10,746,123.58	0.85
5	NVIDIA Corp	NVDA UW	10,694,212.13	0.84
6	Tesla Inc	TSLA UW	9,658,052.09	0.76
7	Advanced Micro Devices Inc	AMD UW	6,633,583.90	0.52
8	Adobe Inc	ADBE UW	6,101,128.86	0.48
9	Apple Inc	AAPL UW	6,057,404.28	0.48
10	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	TSM UN	5,023,126.45	0.40
11	Zoetis Inc	ZTS UN	4,963,865.40	0.39
12	ServiceNow Inc	NOW UN	4,905,850.82	0.39
13	General Electric Co	GE UN	4,836,337.92	0.38

14	Uber Technologies Inc	UBER UN	4,805,940.77	0.38
15	Intuitive Surgical Inc	ISRG UW	4,506,339.52	0.36
16	Salesforce Inc	CRM UN	4,114,424.70	0.32
17	QUALCOMM Inc	QCOM UW	3,973,742.31	0.31
18	Fortinet Inc	FTNT UW	3,744,594.27	0.30
19	HubSpot Inc	HUBS UN	3,412,809.13	0.27
20	Chipotle Mexican Grill Inc	CMG UN	3,289,209.67	0.26

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

金额单位：人民币元

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	Microsoft Corp	MSFT UW	38,268,813.47	3.02
2	Apple Inc	AAPL UW	32,480,552.93	2.56
3	AbbVie Inc	ABBV UN	12,028,848.51	0.95
4	UnitedHealth Group Inc	UNH UN	11,084,763.46	0.87
5	Mastercard Inc	MA UN	8,328,202.51	0.66
6	Visa Inc	V UN	7,948,700.25	0.63
7	CVS Health Corp	CVS UN	7,684,270.56	0.61
8	Alphabet Inc	GOOGL UW	7,236,246.07	0.57
9	Lockheed Martin Corp	LMT UN	7,213,062.04	0.57
10	Home Depot Inc/The	HD UN	7,039,512.55	0.55
11	McKesson Corp	MCK UN	6,603,485.42	0.52
12	Berkshire Hathaway Inc	BRK/B UN	6,436,121.84	0.51
13	Amgen Inc	AMGN UW	6,309,760.71	0.50
14	Exxon Mobil Corp	XOM UN	5,901,846.42	0.47
15	NIKE Inc	NKE UN	5,889,178.17	0.46
16	Starbucks Corp	SBUX UW	5,882,350.38	0.46
17	Chevron Corp	CVX UN	5,727,112.57	0.45
18	Netflix Inc	NFLX UW	5,468,954.77	0.43
19	Lowe's Cos Inc	LOW UN	5,071,899.63	0.40
20	Costco Wholesale Corp	COST UW	5,064,451.90	0.40

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本 (成交) 总额	438,082,294.82
卖出收入 (成交) 总额	702,104,342.69

注：7.5.1 项“买入金额”、7.5.2 项“卖出金额”及 7.5.3 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。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

无。

7.8 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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

无。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

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	Technology Select Sector SPDR Fund	ETF	交易型开放式	State Street Global Advisors Inc	26,962,229.59	1.97
2	ARK Innovation ETF	ETF	交易型开放式	ARK Investment Management LLC	2,326,398.05	0.17
3	Invesco KBW Bank ETF	ETF	交易型开放式	Invesco Capital Management LLC	2,000,992.38	0.15
4	VanEck Gold Miners ETF/USA	ETF	交易型开放式	Van Eck Associates Corp	1,844,331.04	0.13
5	Invesco QQQ Trust Series 1	ETF	交易型开放式	Invesco Capital Management LLC	1,492,169.47	0.11
6	Global X Artificial Intelligence &	ETF	交易型开放式	Global X Management Co LLC	1,483,733.05	0.11

	Technology ETF					
7	iShares 20+ Year Treasury Bond ETF	ETF	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	1,407,314.73	0.10
8	SPDR Gold Shares	ETF	交易型开放式	State Street Global Advisors Inc	1,125,837.30	0.08
9	Global X Robotics & Artificial Intelligence ETF	ETF	交易型开放式	Global X Management Co LLC	1,123,491.95	0.08
10	iMGP DBi Managed Futures Strategy ETF	ETF	交易型开放式	iM Global Partner Fund Management LLC	206,836.21	0.02

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	4,027,410.33
3	应收股利	286,614.33
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,854,697.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,168,721.78

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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	166,277	2,183.13	19,908,675.94	5.48	343,095,621.47	94.52
嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇	590	8,491.36	-	-	5,009,902.70	100.00
合计	166,792	2,206.43	19,908,675.94	5.41	348,105,524.17	94.59

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。

8.2 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	51,412.96	0.01
	嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇	-	-
	合计	51,412.96	0.01

8.3 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	0~10
	嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇	0
	合计	0~10
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	0~10
	嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇	0
	合计	0~10

§9 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	442,563,854.58	5,122,069.67
本报告期基金总申购份额	102,412,650.99	660,947.42
减：本报告期基金总赎回份额	181,972,208.16	773,114.39
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	363,004,297.41	5,009,902.70

§10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

（1）基金管理人的重大人事变动情况

2023 年 4 月 29 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》，张峰先生任公司副总经理。

2023 年 4 月 29 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》，程剑先生任公司副总经理。

2023 年 4 月 29 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》，李明先生任公司财务总监。

2023 年 6 月 20 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》，姚志鹏先生任公司副总经理。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 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，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	

野村证券 NOMURA	-	1,043,243,47 1.49	91.70	730,270.54	95.47	-
瑞士信贷 (香港)有 限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	50,017,569.5 5	4.40	20,734.92	2.71	-
瑞银集团 Union Bank of Switzer land	-	38,333,644.4 1	3.37	12,131.69	1.59	-
花旗环球 金融亚洲 有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited	-	6,067,712.59	0.53	1,820.25	0.24	-
麦格理银 行有限公 司香港分 行 Macquaire Bank Limited Hong Kong Branch.	-	-	-	-	-	-
Wolfe Research Securitie s	-	-	-	-	-	-
德意志银 行	-	-	-	-	-	-
金贝塔证 券有限公 司 iGoldenbe ta Securitie s 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	-	-	-	-	-	-
中信证券 国际有限 公司 CITIC Securities Internati onal Company 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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交	成交金额	占当期债券回购	成交金额	占当期权证成交	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)

		总 额 的 比 例 (%)		成 交 总 额 的 比 例 (%)		总 额 的 比 例 (%)		
野村证券 NOMURA	-	-	-	-	-	-	41,673,901.43	96.02
瑞士信贷（香港）有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	365,467.68	0.84
瑞银集团 Union Bank of Switzerland	-	-	-	-	-	-	682,182.77	1.57
花旗环球金融亚洲有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited	-	-	-	-	-	-	680,191.58	1.57
麦格理银行有限公司香港分行 Macquarie Bank Limited Hong Kong Branch.	-	-	-	-	-	-	-	-
Wolfe Research Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
德意志银行	-	-	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券国际有限公司 CITIC Securities International Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于嘉实美国成长股票（QDII）2023 年 1 月 16 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	2023 年 1 月 12 日
2	关于嘉实美国成长股票（QDII）2023 年 2 月 20 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	2023 年 2 月 16 日
3	嘉实基金管理有限公司关于防范不法分子诈骗活动的提示性公告	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	2023 年 3 月 21 日
4	关于嘉实美国成长股票（QDII）2023 年 4 月 7 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	2023 年 4 月 4 日

5	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	2023 年 4 月 29 日
6	关于嘉实美国成长股票（QDII）2023 年 5 月 29 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	2023 年 5 月 25 日
7	嘉实基金管理有限公司关于修订旗下部分基金托管协议的公告	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	2023 年 6 月 14 日
8	关于嘉实美国成长股票（QDII）2023 年 6 月 19 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	2023 年 6 月 15 日
9	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	2023 年 6 月 20 日
10	关于嘉实美国成长股票（QDII）2023 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	2023 年 6 月 30 日

§ 11 备查文件目录

11.1 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。

11.2 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

11.3 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 8 月 29 日