

嘉实美国成长股票型证券投资基金 2023 年年度报告

2023 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：2024 年 3 月 28 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 2024 年 03 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 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.....	9
3.3 其他指标.....	12
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	12
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
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.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	20
7.3 净资产变动表.....	22
7.4 报表附注.....	23

§8 投资组合报告	51
8.1 期末基金资产组合情况.....	51
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	51
8.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	51
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.....	52
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	87
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	89
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.....	89
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.....	89
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.....	89
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.....	89
8.11 投资组合报告附注.....	90
§9 基金份额持有人信息	91
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	91
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	92
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.....	92
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.....	92
§10 开放式基金份额变动	92
§11 重大事件揭示	93
11.1 基金份额持有人大会决议.....	93
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.....	93
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	93
11.4 基金投资策略的改变.....	93
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	94
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.....	94
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	94
11.8 其他重大事件.....	97
§12 备查文件目录	98
12.1 备查文件目录.....	98
12.2 存放地点.....	98
12.3 查阅方式.....	98

§ 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	378,180,492.23 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	373,719,810.71 份	4,460,681.52 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（2023年1月1日-2023年12月31日）		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）	
	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	63,793,999.43	5,053,609.48	-14,819,682.18	-1,033,428.96	73,231,158.63	5,835,543.80

现收益						
本期利润	400,833,454. 28	31,565,759 .64	-328,304,437 .27	-21,364,82 6.72	205,539,509. 02	17,389,003 .43
加权平均基金份额本期利润	1.0317	6.3451	-0.7421	-4.3011	0.5960	3.7959
本期加权平均净值利润率	32.02%	32.22%	-25.68%	-24.43%	19.49%	20.24%
本期基金份额净值增长率	38.83%	36.53%	-20.82%	-27.48%	22.45%	25.29%
3.1 .2 期末	2023 年末		2022 年末		2021 年末	

数据和指标						
期末可供分配利润	300,978,556. 95	25,302,250 .25	282,208,317. 53	23,808,345 .96	328,137,384. 25	23,805,681 .19
期末可供分配基金份额利润	0.8054	5.6723	0.6377	4.6482	0.6717	4.8555
期末基金资产净值	1,389,620,51 1.46	101,206,95 1.23	1,185,382,06 2.47	83,685,753 .71	1,652,264,60 9.89	101,112,99 8.99
期末基金份额净值	3.718	3.203	2.678	2.346	3.382	3.235
3.1 .3 累计	2023 年末		2022 年末		2021 年末	

期末指标						
基金份额累计净值增长率	271.80%	220.30%	167.80%	134.60%	238.20%	223.50%

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	10.95%	0.95%	13.21%	0.87%	-2.26%	0.08%
过去六个月	6.66%	0.93%	9.66%	0.86%	-3.00%	0.07%
过去一年	38.83%	1.02%	39.08%	0.95%	-0.25%	0.07%
过去三年	34.61%	1.31%	24.73%	1.29%	9.88%	0.02%
过去五年	121.71%	1.44%	124.24%	1.43%	-2.53%	0.01%
自基金合同生效起至今	271.80%	1.18%	286.56%	1.16%	-14.76%	0.02%

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	12.46%	0.94%	13.21%	0.87%	-0.75%	0.07%
过去六个月	8.80%	0.93%	9.66%	0.86%	-0.86%	0.07%
过去一年	36.53%	1.00%	39.08%	0.95%	-2.55%	0.05%
过去三年	24.05%	1.28%	24.73%	1.29%	-0.68%	-0.01%
过去五年	114.68%	1.41%	124.24%	1.43%	-9.56%	-0.02%
自基金合同生效 起至今	220.30%	1.16%	286.56%	1.16%	-66.26%	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：

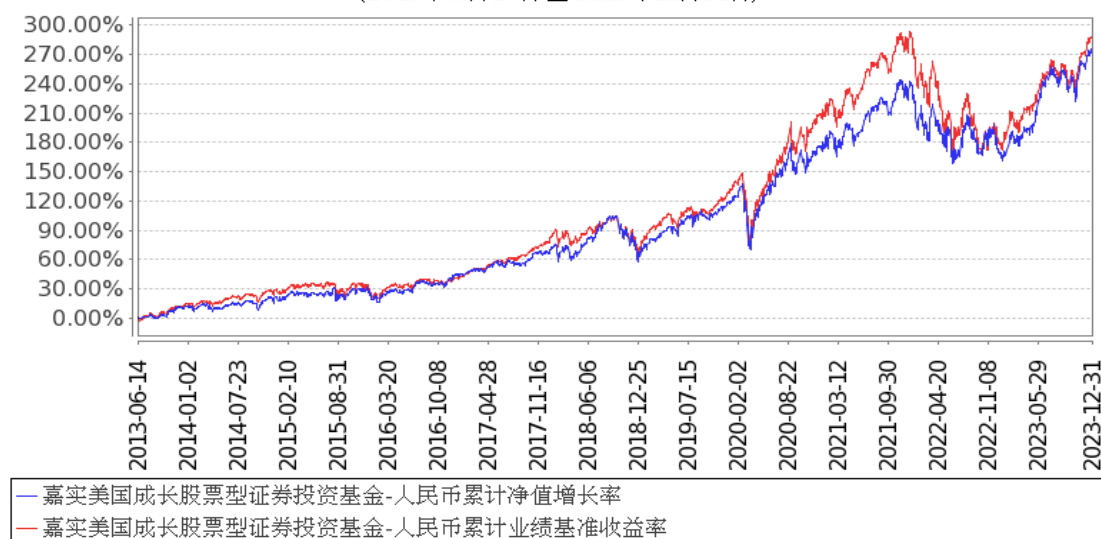
$$\text{Return}(t) = 95\% \times \text{罗素 1000 成长指数收益率}(t) + 5\% \times ((1 + \text{境内银行活期存款税后利率})^{1/365} - 1)$$

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

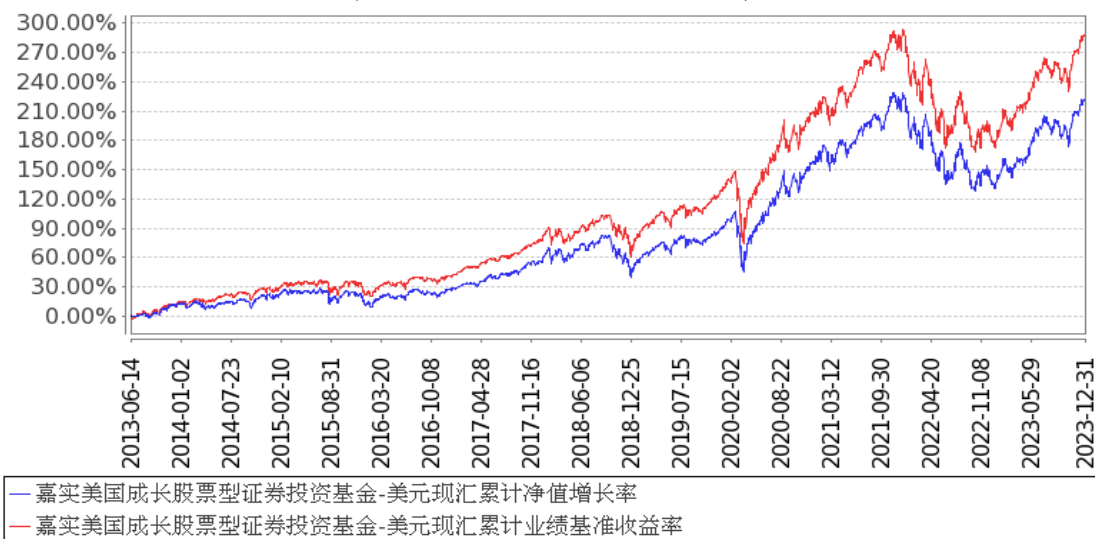
其中， $t = 1, 2, 3, \dots, T$ ， T 表示时间截至日。

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)



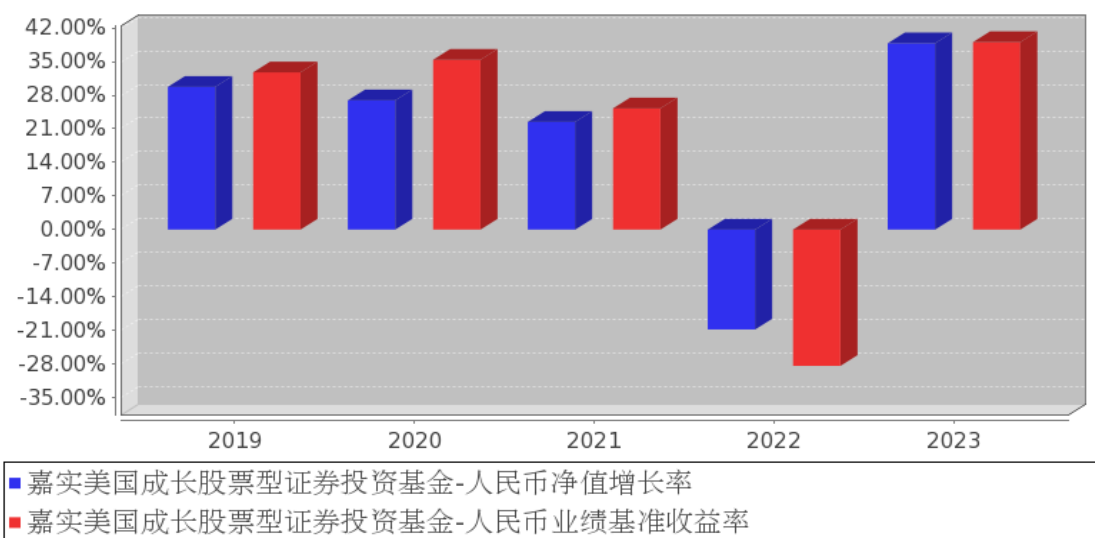
嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2013年06月14日至2023年12月31日)



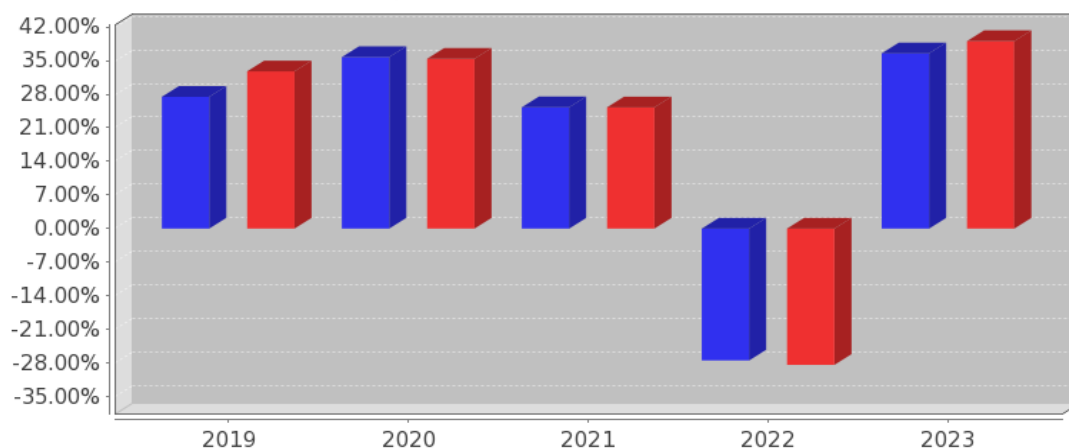
注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

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2023年12月31日，基金管理人共管理334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	本基金、	2013年6	-	27年	曾任美国世纪投资管理公司（American

力	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、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遵规守信情况的说明

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，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门集中交易。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 13 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，美股市场表现强劲并屡创新高，尤其是纳斯达克指数全年上涨 43%，标普 500 和道琼斯指数则上涨 24%和 14%，分别逼近和创下历史新高。全年表现上成长风格跑赢、科技龙头主导，盈利与风险溢价压降是全年表现的主要驱动力。

美股盈利呈现出非常明显的滚动式特征，纳斯达克盈利修复明显领先标普与道琼斯，也成为支撑市场表现的主要动力，叠加 AI 产业趋势助推业务收入增长以及降本举措持续见效，全年盈利结构性走强。3 月中小银行风险事件爆发后，美国政府对私人部门的持续兜底和美联储扩表对流动性提供支撑，使得美股在上半年加息预期升温带动无风险利率抬升背景下，不仅并未承压，利率敏感的成长风格反而领涨。而财政发力下三季度增长再加速，也助推了美股上市企业业绩，尤其是并不受益于 AI 趋势的传统企业，标普 500 非金融收入在此前连续四个季度持续回落后在三季度抬升并转正，盈利增速也是如此。因此，虽然美国国内面临高通胀、加息、银行危机、衰退预期等扰动，美股依然能够一路高歌猛进。

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 3.718 元，本报告期基金份额净值增长率为 38.83%；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 3.203 美元，本报告期基金份额净值增长率为 36.53%；业绩比较基准收益率为 39.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年，整体上，由于美股基本面有支撑，虽然波动可能难免，但我们整体比较乐观。由于美国增长压力不大、且滚动式放缓使得纳斯达克提前一年就提前释放了盈利下调压力，再加上美联储宽松的对冲，都使我们并不担心美股的深度调整压力。风格上，随着去通胀进入最后一公里，金融条件有望进入持续改善通道，企业融资约束边际放松，尤其利好对利率更为敏感的成长股和小盘股。从历史规律来看，加息停止后，对利率更为敏感的资产往往表现领先。小盘股占优将开启美股市场的扩散牛行情，被动指数将难以跑赢主动权益基金。行业上，我们看好成长股的投资机会：一方面，海外流动性转暖有利于长久期资产的价值重估；另一方面，新的产业变化也在酝酿，包括人工智能、生物医药、智能驾驶等泛科技创新领域都有投资机会。当下是各个公司盈利错位反转的时期，我们会更加注重对公司基本面稳健性的把控。

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、投资交易、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。全力支持新产品新业务新制度新客户新投资工具并进行合规性判断。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(2024)第 23407 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 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了嘉实美国成长股票(QDII)基金</p>

	2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 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，就可能对导致对嘉实美</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 柴瀚英
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2024 年 03 月 25 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: 2023 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产:			
货币资金	7.4.7.1	112,543,778.61	87,125,147.00
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	1,391,179,240.32	1,182,000,660.24
其中: 股票投资		1,339,895,575.80	1,170,442,138.35
基金投资		51,283,664.52	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	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		699,842.80	1,895,547.95
应收申购款		10,678,975.43	6,808,639.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		1,515,101,837.16	1,277,829,994.41
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		2,985,757.94	-
应付赎回款		18,222,142.55	6,156,234.96
应付管理人报酬		2,238,657.55	1,983,130.05
应付托管费		435,294.54	385,608.61
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		123,123.40	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	269,398.49	237,204.61
负债合计		24,274,374.47	8,762,178.23
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	401,200,270.43	474,111,355.85
未分配利润	7.4.7.12	1,089,627,192.26	794,956,460.33
净资产合计		1,490,827,462.69	1,269,067,816.18
负债和净资产总计		1,515,101,837.16	1,277,829,994.41

注：报告截止日 2023 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 3.718 元，基金份额总额 373,719,810.71 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 3.203 美元，基金份额总额 4,460,681.52 份，基金份额总额合计为 378,180,492.23 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022
-----	-----	----------------------------	---------------------------------

		年 12 月 31 日	年 12 月 31 日
一、营业总收入		461,592,493.00	-319,977,041.35
1. 利息收入		169,101.80	191,115.28
其中：存款利息收入	7.4.7.13	169,101.80	191,115.28
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		95,852,178.28	6,004,433.90
其中：股票投资收益	7.4.7.14	81,844,315.59	-8,917,711.44
基金投资收益	7.4.7.15	3,832,056.39	-645,015.23
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	10,175,806.30	15,567,160.57
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	363,551,605.01	-333,816,152.85
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		1,024,535.72	6,477,705.27
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.22	995,072.19	1,165,857.05
减：二、营业总支出		29,193,279.08	29,692,222.64
1. 管理人报酬		24,244,989.32	24,668,322.80
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费		4,714,303.47	4,796,618.23
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		13,191.79	-
8. 其他费用	7.4.7.24	220,794.50	227,281.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		432,399,213.92	-349,669,263.99
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		432,399,213.92	-349,669,263.99

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		432,399,213.92	-349,669,263.99

7.3 净资产变动表

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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	474,111,355.85	-	794,956,460.33	1,269,067,816.18
二、本期期初净资产	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）	-72,911,085.42	-	294,670,731.93	221,759,646.51
（一）、综合收益总额	-	-	432,399,213.92	432,399,213.92
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-72,911,085.42	-	-137,728,481.99	-210,639,567.41
其中：1. 基金申购款	254,410,168.57	-	584,527,306.10	838,937,474.67
2. 基金赎回款	-327,321,253.99	-	-722,255,788.09	-1,049,577,042.08
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	401,200,270.43	-	1,089,627,192.26	1,490,827,462.69
项目	上年度可比期间 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	518,693,260.29	-	1,234,684,348.59	1,753,377,608.88
二、本期期初净资产	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净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-44,581,904.44	-	-90,058,624.27	-134,640,528.71
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净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	474,111,355.85	-	794,956,460.33	1,269,067,816.18

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

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

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

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业务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。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产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。

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、资产支持证券投资和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。

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

值变动(不包括本基金的任何影响)。

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

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

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未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

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。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	112,543,778.61	87,125,147.00
等于：本金	112,535,574.15	87,118,276.25
加：应计利息	8,204.46	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	112,543,778.61	87,125,147.00

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	882,818,179.03	-	1,339,895,575.80	457,077,396.77
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	47,126,274.02	-	51,283,664.52	4,157,390.50
其他	-	-	-	-
合计	929,944,453.05	-	1,391,179,240.32	461,234,787.27

项目	上年度末 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

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

无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	50,398.49	16,204.61
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	219,000.00	221,000.00
合计	269,398.49	237,204.61

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	248,086,616.72	248,086,616.72
本期赎回（以“-”号填列）	-316,930,660.59	-316,930,660.59
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	373,719,810.71	373,719,810.71
-----	----------------	----------------

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12月31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	1,025,441.74	6,323,551.85
本期赎回（以“-”号填列）	-1,686,829.89	-10,390,593.40
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	4,460,681.52	27,480,459.72

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
上年度末	282,208,317.53	460,609,890.36	742,818,207.89
本期期初	282,208,317.53	460,609,890.36	742,818,207.89
本期利润	63,793,999.43	337,039,454.85	400,833,454.28
本期基金份额交易产生的变动数	-45,023,760.01	-82,727,201.41	-127,750,961.42
其中：基金申购款	178,300,851.11	393,107,504.00	571,408,355.11
基金赎回款	-223,324,611.12	-475,834,705.41	-699,159,316.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	300,978,556.95	714,922,143.80	1,015,900,700.75

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
本期期初	23,808,345.96	28,329,906.48	52,138,252.44
本期利润	5,053,609.48	26,512,150.16	31,565,759.64
本期基金份额交易产生的变动数	-3,559,705.19	-6,417,815.38	-9,977,520.57
其中：基金申购款	5,096,136.16	8,022,814.83	13,118,950.99
基金赎回款	-8,655,841.35	-14,440,630.21	-23,096,471.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,302,250.25	48,424,241.26	73,726,491.51

7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	168,340.63	190,109.54
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	761.17	1,005.74
合计	169,101.80	191,115.28

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	81,844,315.59	-8,917,711.44
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	81,844,315.59	-8,917,711.44

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	1,138,864,337.28	956,989,568.11
减：卖出股票成本总额	1,055,815,614.59	964,925,766.23
减：交易费用	1,204,407.10	981,513.32
买卖股票差价收入	81,844,315.59	-8,917,711.44

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	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出/赎回基金成交总额	41,980,214.43	3,868,797.92
减：卖出/赎回基金成本总额	37,967,666.91	4,502,446.83
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	116,870.30	-
减：交易费用	63,620.83	11,366.32
基金投资收益	3,832,056.39	-645,015.23

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 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
股票投资产生的股利收益	9,834,174.09	15,521,474.56
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	341,632.21	45,686.01
合计	10,175,806.30	15,567,160.57

7.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
1. 交易性金融资产	363,551,605.01	-333,816,152.85
股票投资	358,311,843.61	-332,801,847.58
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	5,239,761.40	-1,014,305.27
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	363,551,605.01	-333,816,152.85

7.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	995,072.19	1,165,857.05
合计	995,072.19	1,165,857.05

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	99,000.00	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	1,794.50	6,281.61
合计	220,794.50	227,281.61

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 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	24,244,989.32	24,668,322.80
其中：应支付销售机构的客户维护费	9,224,542.65	8,210,184.77
应支付基金管理人的净管理费	15,020,446.67	16,458,138.03

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 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,714,303.47	4,796,618.23

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固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	112,543,778.61	168,340.63	87,125,147.00	190,109.54

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(2023年1月1日至2023年12月31日),本基金未实施利润分配。

7.4.12 期末(2023年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

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 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

货币资金	112,543,778.61	-	-	-	112,543,778.61
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-1,391,179,240.32	1,391,179,240.32
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	-	-	-	699,842.80	699,842.80
应收申购款	-	-	-	10,678,975.43	10,678,975.43
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	112,543,778.61	-	-	-1,402,558,058.55	1,515,101,837.16
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	-	-	-	2,985,757.94	2,985,757.94
应付赎回款	-	-	-	18,222,142.55	18,222,142.55
应付管理人报酬	-	-	-	2,238,657.55	2,238,657.55
应付托管费	-	-	-	435,294.54	435,294.54
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	123,123.40	123,123.40
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	269,398.49	269,398.49
负债总计	-	-	-	24,274,374.47	24,274,374.47
利率敏感度缺口	112,543,778.61	-	-	-1,378,283,684.08	1,490,827,462.69
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					
货币资金	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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	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 2023 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民 币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
货币资金	56,639,342.05	-	-	56,639,342.05
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	1,391,179,240.32	-	-	1,391,179,240.32
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	699,842.80	-	-	699,842.80
应收申购款	133,266.81	-	-	133,266.81
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	1,448,651,691.98	-	-	1,448,651,691.98
以外币计价的负债				
应付清算款	2,985,757.94	-	-	2,985,757.94
衍生金融负债	-	-	-	-
应付赎回款	437,202.61	-	-	437,202.61
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	658.48	-	-	658.48
负债合计	3,423,619.03	-	-	3,423,619.03
资产负债表外 外汇风险敞口净额	1,445,228,072.95	-	-	1,445,228,072.95
	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
项目	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				
货币资金	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

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	所有外币相对人民币升值5%	72,261,403.65	60,935,444.84
	所有外币相对人民币贬值5%	-72,261,403.65	-60,935,444.84

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 2023年12月31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	1,339,895,575.80	89.88	1,170,442,138.35	92.23
交易性金融资产—基金投资	51,283,664.52	3.44	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	1,391,179,240.32	93.32	1,182,000,660.24	93.14

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		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	76,281,452.50	59,618,884.11
	业绩比较基准下降5%	-76,281,452.50	-59,618,884.11

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	1,391,179,240.32	1,182,000,660.24
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	1,391,179,240.32	1,182,000,660.24

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

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,339,895,575.80	88.44
	其中：普通股	1,322,037,693.65	87.26
	存托凭证	9,419,060.19	0.62
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	8,438,821.96	0.56
2	基金投资	51,283,664.52	3.38
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	112,543,778.61	7.43
8	其他各项资产	11,378,818.23	0.75
9	合计	1,515,101,837.16	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	1,339,895,575.80	89.88
合计	1,339,895,575.80	89.88

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	620,055,043.23	41.59
非必需消费品	225,778,858.09	15.14
通信服务	172,056,586.58	11.54
医疗保健	78,817,387.37	5.29
工业	81,204,685.76	5.45
金融	94,485,161.65	6.34
必需消费品	34,816,949.39	2.34
能源	7,679,182.80	0.52

原材料	8,320,323.68	0.56
公用事业	5,755,041.23	0.39
房地产	2,487,534.06	0.17
房地产信托数据中心类	1,311,032.42	0.09
房地产信托特殊类	945,695.14	0.06
房地产信托工业类	682,654.00	0.05
房地产信托零售类	729,419.51	0.05
房地产信托抵押类	767,022.41	0.05
房地产信托医疗保健类	735,721.41	0.05
房地产信托写字楼类	733,561.76	0.05
房地产信托通讯塔类	2,533,715.31	0.17
合计	1,339,895,575.80	89.88

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	Microsoft Corp	微软公司	MSFT UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	53,291	141,934,104.07	9.52
2	Apple Inc	苹果公司	AAPL UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	97,223	132,576,416.39	8.89
3	NVIDIA Corp	英伟达	NVDA UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	31,347	109,949,436.17	7.38
4	Alphabet Inc	Alphabet 公司	GOOGL UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	97,527	96,491,493.72	6.47
5	Amazon.com Inc	亚马逊公司	AMZN UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	84,976	91,446,534.74	6.13
6	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	20,256	50,781,639.92	3.41
7	Tesla Inc	特斯拉公司	TSLA UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	25,171	44,298,676.89	2.97
8	Eli Lilly	礼来	LLY UN	纽约证	美国	8,808	36,365,127.04	2.44

	& Co			券交易所				
9	Broadcom Inc	博通股份有限公司	AVGO UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,909	30,904,803.69	2.07
10	Visa Inc	维萨公司	V UN	纽约证券交易所	美国	10,567	19,485,346.65	1.31
11	Costco Wholesale Corp	开市客	COST UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,764	17,597,259.39	1.18
12	Adobe Inc	奥多比	ADBE UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,160	17,578,241.49	1.18
13	Home Depot Inc/The	家得宝	HD UN	纽约证券交易所	美国	6,169	15,141,870.25	1.02
14	Advanced Micro Devices Inc	AMD 公司	AMD UW	纳斯达克证券交易所	美国	14,373	15,006,285.98	1.01
15	Netflix Inc	奈飞公司	NFLX UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,105	14,155,784.53	0.95
16	Mastercard Inc	万事达股份有限公司	MA UN	纽约证券交易所	美国	3,753	11,337,221.44	0.76
17	Intuit Inc	Intuit 股份有限公司	INTU UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,495	11,045,115.45	0.74
18	ServiceNow Inc	ServiceNow 公司	NOW UN	纽约证券交易所	美国	2,087	10,443,048.98	0.70
19	Salesforce Inc	Salesforce 股份有限公司	CRM UN	纽约证券交易所	美国	5,500	10,250,579.23	0.69
20	Applied Materials Inc	应用材料	AMAT UW	纳斯达克证券交易所	美国	7,482	8,588,536.84	0.58
21	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	330	8,290,885.38	0.56

22	UnitedHealth Group Inc	联合健康集团	UNH UN	纽约证券交易所	美国	2,219	8,274,271.70	0.56
23	Lam Research Corp	泛林集团	LRCX UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,481	8,215,989.09	0.55
24	KLA Corp	KLA 公司	KLAC UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,827	7,522,076.00	0.50
25	Uber Technologies Inc	优步技术股份有限公司	UBER UN	纽约证券交易所	美国	16,739	7,299,573.90	0.49
26	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	3,561	6,869,578.51	0.46
27	Oracle Corp	甲骨文	ORCL UN	纽约证券交易所	美国	8,199	6,122,431.57	0.41
28	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM UW	纳斯达克证券交易所	美国	5,727	5,866,572.15	0.39
29	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	2,728	5,697,555.06	0.38
30	Zoetis Inc	硕腾股份有限公司	ZTS UN	纽约证券交易所	美国	3,343	4,673,221.48	0.31
31	Synopsys Inc	新思科技公司	SNPS UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,278	4,660,806.01	0.31
32	Blackstone Inc	黑石集团股份有限公司	BX UN	纽约证券交易所	美国	4,948	4,588,117.53	0.31
33	Vertiv Holdings Co	维谛技术	VRT UN	纽约证券交易所	美国	12,404	4,219,618.53	0.28
34	Marriott	万豪国	MAR UW	纳斯达克	美国	2,631	4,202,284.97	0.28

	International Inc/MD	际		克证券交易所				
35	Workday Inc	Workday 股份有限公司	WDAY UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,056	4,019,994.33	0.27
36	Arista Networks Inc	Arista 网络股份有限公司	ANET UN	纽约证券交易所	美国	2,368	3,949,934.53	0.26
37	Intel Corp	英特尔	INTC UW	纳斯达克证券交易所	美国	10,874	3,870,118.31	0.26
38	Chipotle Mexican Grill Inc	Chipotle Mexican Grill 股份有限公司	CMG UN	纽约证券交易所	美国	238	3,855,088.68	0.26
39	General Electric Co	通用电气	GE UN	纽约证券交易所	美国	4,249	3,840,947.29	0.26
40	Lululemon Athletica Inc	Lululemon Athletica 股份有限公司	LULU UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,059	3,834,971.19	0.26
41	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	4,171	3,825,386.03	0.26
42	CrowdStrike Holdings Inc	CrowdStrike 控股股份有限公司	CRWD UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,079	3,759,569.97	0.25
43	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	台积电	TSM UN	纽约证券交易所	美国	5,066	3,731,619.65	0.25

44	PulteGroup Inc	Pulte 集团公司	PHM UN	纽约证券交易所	美国	5,028	3,675,851.61	0.25
45	PepsiCo Inc	百事可乐	PEP UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,036	3,652,082.63	0.24
46	Novo Nordisk A/S	诺和诺德公司	NVO UN	纽约证券交易所	美国	4,876	3,572,671.12	0.24
47	Intuitive Surgical Inc	直觉外科手术公司	ISRG UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,425	3,404,923.03	0.23
48	JPMorgan Chase & Co	摩根大通	JPM UN	纽约证券交易所	美国	2,767	3,333,591.04	0.22
49	Cintas Corp	CINTAS 公司	CTAS UW	纳斯达克证券交易所	美国	777	3,316,593.41	0.22
50	Airbnb Inc	爱彼迎股份有限公司	ABNB UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,371	3,250,448.92	0.22
51	Amgen Inc	安进公司	AMGN UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,562	3,186,416.35	0.21
52	Zions Bancorp NA	锡安银行	ZION UW	纳斯达克证券交易所	美国	10,095	3,136,698.70	0.21
53	American International Group Inc	美国国际集团	AIG UN	纽约证券交易所	美国	6,445	3,092,652.10	0.21
54	Vertex Pharmaceuticals Inc	福泰制药	VRTX UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,050	3,025,973.79	0.20
55	Toll Brothers Inc	托尔兄弟公司	TOL UN	纽约证券交易所	美国	4,142	3,015,503.30	0.20
56	Palantir Technologies Inc	Palantir 科技股份有限公司	PLTR UN	纽约证券交易所	美国	24,550	2,985,524.49	0.20
57	DraftKings Inc	DraftKings 股	DKNG UW	纳斯达克证券	美国	11,924	2,977,007.55	0.20

		份有限公司		交易所				
58	HubSpot Inc	HubSpot 公司	HUBS UN	纽约证券交易所	美国	679	2,791,905.86	0.19
59	Comfort Systems USA Inc	美国舒适系统公司	FIX UN	纽约证券交易所	美国	1,869	2,722,570.26	0.18
60	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	1,340	2,697,859.92	0.18
61	Eaton Corp PLC	伊顿	ETN UN	纽约证券交易所	美国	1,521	2,594,302.49	0.17
62	Copart Inc	Copart 股份有限公司	CPRT UW	纳斯达克证券交易所	美国	7,340	2,547,363.88	0.17
63	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	643	2,527,795.44	0.17
64	NIKE Inc	耐克公司	NKE UN	纽约证券交易所	美国	3,186	2,449,934.40	0.16
65	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	3,705	2,445,436.39	0.16
66	Accenture PLC	埃森哲公司	ACN UN	纽约证券交易所	美国	980	2,435,682.45	0.16
67	NXP Semiconductors NV	恩智浦半导体公司	NXPI UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,486	2,417,357.24	0.16
68	Rambus Inc	Rambus 股份有限公司	RMBS UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,740	2,291,288.86	0.15
69	Splunk Inc	Splunk 公司	SPLK UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,115	2,282,189.36	0.15
70	Applied	应用工	AIT UN	纽约证	美国	1,854	2,267,648.65	0.15

	Industrial Technologies Inc	业技术公司		券交易所				
71	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	344	2,261,999.07	0.15
72	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	1,748	2,254,376.10	0.15
73	Caterpillar Inc	卡特彼勒	CAT UN	纽约证券交易所	美国	1,069	2,238,637.70	0.15
74	Broadridge Financial Solutions Inc	布罗德德里奇金融解决方案股份有限公司	BR UN	纽约证券交易所	美国	1,534	2,235,445.32	0.15
75	McDonald's Corp	麦当劳	MCD UN	纽约证券交易所	美国	1,055	2,215,596.40	0.15
76	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	5,075	2,207,364.18	0.15
77	Monolithic Power Systems Inc	芯源系统有限公司	MPWR UW	纳斯达克证券交易所	美国	490	2,189,136.50	0.15
78	WW Grainger Inc	固安捷股份有限公司	GWV UN	纽约证券交易所	美国	372	2,183,402.91	0.15
79	DR Horton Inc	霍顿房屋公司	DHI UN	纽约证券交易所	美国	2,022	2,176,538.92	0.15
80	elf Beauty Inc	elf Beauty 股份有限公司	ELF UN	纽约证券交易所	美国	2,086	2,132,553.09	0.14
81	MongoDB Inc	MongoDB 股份	MDB UQ	纳斯达克证券交易所	美国	733	2,122,593.47	0.14

		有限公司		交易所				
82	Coca-Cola Co/The	可口可乐	KO UN	纽约证券交易所	美国	4,935	2,059,787.63	0.14
83	Vistra Corp	Vistra 公司	VST UN	纽约证券交易所	美国	7,535	2,055,740.93	0.14
84	Amphenol Corp	安费诺公司	APH UN	纽约证券交易所	美国	2,925	2,053,666.05	0.14
85	Moody's Corp	穆迪	MCO UN	纽约证券交易所	美国	742	2,052,534.73	0.14
86	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	571	2,017,702.65	0.14
87	Cloudflare Inc	Cloudflare 股份有限公司	NET UN	纽约证券交易所	美国	3,389	1,998,512.29	0.13
88	Marathon Petroleum Corp	马拉松石油公司	MPC UN	纽约证券交易所	美国	1,877	1,972,331.65	0.13
89	Fiserv Inc	Fiserv 公司	FI UN	纽约证券交易所	美国	2,066	1,943,828.88	0.13
90	XPO Inc	XPO 股份有限公司	XPO UN	纽约证券交易所	美国	3,091	1,917,575.09	0.13
91	Trane Technologies PLC	特灵科技公共有限公司	TT UN	纽约证券交易所	美国	1,104	1,907,127.47	0.13
92	New York Times Co/The	纽约时报	NYT UN	纽约证券交易所	美国	5,454	1,892,436.95	0.13
93	Fifth Third Bancorp	五三银行	FITB UW	纳斯达克证券交易所	美国	7,689	1,878,286.78	0.13
94	Onto	Onto 创	ONTO UN	纽约证	美国	1,734	1,877,826.34	0.13

	Innovation Inc	新股份有限公司		券交易所				
95	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	2,970	1,854,500.17	0.12
96	Redfin Corp	Redfin Corp	RDFN UW	纳斯达克证券交易所	美国	25,259	1,846,267.81	0.12
97	Block Inc	Block 股份有限公司	SQ UN	纽约证券交易所	美国	3,310	1,813,373.06	0.12
98	Lowe's Cos Inc	劳氏	LOW UN	纽约证券交易所	美国	1,144	1,803,235.59	0.12
99	Verisk Analytics Inc	Verisk 分析公司	VRSK UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,060	1,793,280.15	0.12
100	TopBuild Corp	TopBuild 公司	BLD UN	纽约证券交易所	美国	662	1,754,810.60	0.12
101	TransDigm Group Inc	TransDigm 集团公司	TDG UN	纽约证券交易所	美国	234	1,676,577.08	0.11
102	United Rentals Inc	联合租赁公司	URI UN	纽约证券交易所	美国	411	1,669,219.71	0.11
103	PACCAR Inc	帕卡	PCAR UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,409	1,666,126.20	0.11
104	Lennar Corp	Lennar 公司	LEN UN	纽约证券交易所	美国	1,564	1,650,967.17	0.11
105	Fair Isaac Corp	费埃哲公司	FICO UN	纽约证券交易所	美国	200	1,648,866.73	0.11
106	Lockheed Martin Corp	洛克希德马丁	LMT UN	纽约证券交易所	美国	513	1,646,813.59	0.11
107	AbbVie Inc	艾伯维公司	ABBV UN	纽约证券交易所	美国	1,480	1,624,456.91	0.11
108	API Group	API 集	APG UN	纽约证	美国	6,612	1,620,346.11	0.11

8	Corp	团公司		券交易 所				
10 9	American Tower Corp	美国发 射塔公 司	AMT UN	纽约证 券交易 所	美国	1,049	1,603,934.93	0.11
11 0	Micron Technolog y Inc	美光科 技股份 有限公司	MU UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,641	1,596,319.75	0.11
11 1	Global Payments Inc	环汇有 限公司	GPN UN	纽约证 券交易 所	美国	1,763	1,585,823.61	0.11
11 2	Comcast Corp	康卡斯 特公司	CMCSA UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,977	1,545,738.72	0.10
11 3	TJX Cos Inc/The	TJX 公 司	TJX UN	纽约证 券交易 所	美国	2,326	1,545,459.73	0.10
11 4	General Motors Co	通用汽 车公司	GM UN	纽约证 券交易 所	美国	6,059	1,541,473.73	0.10
11 5	Microchip Technolog y Inc	微芯科 技股份 有限公司	MCHP UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,402	1,534,200.36	0.10
11 6	US Bancorp	美国合 众银行	USB UN	纽约证 券交易 所	美国	4,898	1,501,429.28	0.10
11 7	Manhattan Associate s Inc	曼哈顿 联合软 件公司	MANH UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	983	1,499,121.17	0.10
11 8	Constella tion Energy Corp	美国联 合能源 公司	CEG UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,794	1,485,246.86	0.10
11 9	DoorDash Inc	DoorDa sh 股份 有限公司	DASH UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,117	1,482,764.17	0.10
12 0	Union Pacific Corp	联合太 平洋	UNP UN	纽约证 券交易 所	美国	849	1,476,965.21	0.10
12 1	Spotify Technolog	Spotify 科技	SPOT UN	纽约证 券交易	美国	1,104	1,469,324.81	0.10

	y SA	股份有 限公司		所				
12 2	InterDigi tal Inc	InterD igital 股份有 限公司	IDCC UN	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,890	1,452,949.33	0.10
12 3	Wells Fargo & Co	富国银 行	WFC UN	纽约证 券交易 所	美国	4,106	1,431,394.69	0.10
12 4	PNC Financial Services Group Inc/The	PNC 财 务服务	PNC UN	纽约证 券交易 所	美国	1,301	1,426,879.68	0.10
12 5	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	703	1,407,154.22	0.09
12 6	EMCOR Group Inc	埃姆科 集团公 司	EME UN	纽约证 券交易 所	美国	917	1,399,182.50	0.09
12 7	Zscaler Inc	Zscale r 股份 有限公 司	ZS UN	纳斯达 克证券 交易所	美国	891	1,398,195.52	0.09
12 8	Coursera Inc	Course ra Inc	COUR UN	纽约证 券交易 所	美国	10,154	1,393,046.54	0.09
12 9	Marsh & McLennan Cos Inc	Marsh & McLenn an 股份 有限公 司	MMC UN	纽约证 券交易 所	美国	1,012	1,358,062.68	0.09
13 0	Linde PLC	Linde PLC	LIN UN	纳斯达 克证券 交易所	美国	459	1,335,201.49	0.09
13 1	Advanced Drainage Systems Inc	先进排 水系统 公司	WMS UN	纽约证 券交易 所	美国	1,334	1,328,811.98	0.09
13 2	SkyWest Inc	SkyWes t 股份 有限公 司	SKYW UN	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,545	1,310,646.55	0.09

133	Charles Schwab Corp/The	嘉信理财	SCHW UN	纽约证券交易所	美国	2,689	1,310,322.16	0.09
134	Akamai Technologies Inc	阿卡迈技术公司	AKAM UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,537	1,288,371.11	0.09
135	Progressive Corp/The	前进保险公司	PGR UN	纽约证券交易所	美国	1,129	1,273,661.54	0.09
136	Qualys Inc	科力斯公司	QLYS UW	纳斯达克证券交易所	美国	909	1,263,684.85	0.08
137	Axon Enterprise Inc	Axon Enterprise 股份有限公司	AXON UW	纳斯达克证券交易所	美国	687	1,256,985.96	0.08
138	Cencora Inc	Cencora 股份有限公司	COR UN	纽约证券交易所	美国	836	1,216,083.16	0.08
139	Pioneer Natural Resources Co	Pioneer 自然资源公司	PXD UN	纽约证券交易所	美国	762	1,213,681.27	0.08
140	Alkami Technology Inc	Alkami Technology Inc	ALKT UW	纳斯达克证券交易所	美国	7,009	1,203,834.12	0.08
141	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	193	1,200,588.26	0.08
142	Ameriprise Financial Inc	阿默普莱斯金融公司	AMP UN	纽约证券交易所	美国	444	1,194,458.54	0.08
143	Carrier Global Corp	开利全球公司	CARR UN	纽约证券交易所	美国	2,934	1,193,847.87	0.08
144	ROBLOX Corp	Roblox 公司	RBLX UN	纽约证券交易所	美国	3,663	1,186,156.48	0.08
14	NRG	NRG 能	NRG UN	纽约证	美国	3,236	1,184,944.21	0.08

5	Energy Inc	源股份有限公司		券交易所				
146	Bank of America Corp	美国银行公司	BAC UN	纽约证券交易所	美国	4,966	1,184,264.41	0.08
147	Deckers Outdoor Corp	德克斯户外用品公司	DECK UN	纽约证券交易所	美国	249	1,178,838.00	0.08
148	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	1,029	1,173,019.42	0.08
149	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	1,057	1,136,362.77	0.08
150	Primerica Inc	Primerica 股份有限公司	PRI UN	纽约证券交易所	美国	741	1,079,886.24	0.07
151	MercadoLibre Inc	MercadoLibre 股份有限公司	MELI UW	纳斯达克证券交易所	美国	97	1,079,682.40	0.07
152	Shopify Inc	Shopify 股份有限公司	SHOP UN	纽约证券交易所	美国	1,946	1,073,690.57	0.07
153	GXO Logistics Inc	GXO Logistics 股份有限公司	GXO UN	纽约证券交易所	美国	2,475	1,072,115.38	0.07
154	AES Corp/The	爱伊斯公司	AES UN	纽约证券交易所	美国	7,548	1,029,109.23	0.07
155	Boeing Co/The	波音	BA UN	纽约证券交易所	美国	557	1,028,320.36	0.07
156	H&R Block Inc	H&R Block 股份有限公司	HRB UN	纽约证券交易所	美国	2,984	1,022,289.15	0.07

157	WEX Inc	WEX 股份有限公司	WEX UN	纽约证券交易所	美国	733	1,010,029.50	0.07
158	CDW Corp/DE	特拉华 CDW 公司	CDW UW	纳斯达克证券交易所	美国	622	1,001,444.48	0.07
159	Westlake Corp	Westlake 公司	WLK UN	纽约证券交易所	美国	1,008	999,225.05	0.07
160	Avnet Inc	安富利股份有限公司	AVT UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,783	993,442.17	0.07
161	FedEx Corp	联邦快递	FDX UN	纽约证券交易所	美国	549	983,649.13	0.07
162	Trex Co Inc	Trex 公司	TREX UN	纽约证券交易所	美国	1,675	982,181.03	0.07
163	Freshpet Inc	Freshpet 公司	FRPT UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,595	980,119.61	0.07
164	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	974,493.54	0.07
165	Cboe Global Markets Inc	Cboe 环球市场公司	CBOE UF	芝加哥期权交易所	美国	769	972,544.24	0.07
166	AppLovin Corp	AppLovin 公司	APP UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,407	961,610.74	0.06
167	ASML Holding NV	阿斯麦控股公司	ASML UW	纳斯达克证券交易所	美国	179	959,625.67	0.06
168	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	1,250	956,961.30	0.06
169	Illumina Inc	Illumina 公司	ILMN UW	纳斯达克证券交易所	美国	966	952,664.51	0.06
170	Iron Mountain	美国铁山公司	IRM UN	纽约证券交易所	美国	1,908	945,695.14	0.06

	Inc			所				
17 1	A O Smith Corp	AO 史密斯公司	AOS UN	纽约证券交易所	美国	1,593	930,149.18	0.06
17 2	KB Home	KB 家居	KBH UN	纽约证券交易所	美国	2,083	921,488.88	0.06
17 3	Teradyne Inc	泰瑞达	TER UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,197	920,031.68	0.06
17 4	KKR & Co Inc	KKR & Co Inc	KKR UN	纽约证券交易所	美国	1,567	919,518.26	0.06
17 5	Ralph Lauren Corp	拉夫劳伦	RL UN	纽约证券交易所	美国	890	908,979.55	0.06
17 6	Tradeweb Markets Inc	Tradeweb Markets 股份有限公司	TW UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,406	905,008.14	0.06
17 7	UWM Holdings Corp	UWM 控股公司	UWMC UN	纽约证券交易所	美国	17,854	904,149.86	0.06
17 8	NVR Inc	NVR 股份有限公司	NVR UN	纽约证券交易所	美国	18	892,477.57	0.06
17 9	Allstate Corp/The	好事达保险公司	ALL UN	纽约证券交易所	美国	899	891,301.28	0.06
18 0	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	721	888,144.52	0.06
18 1	Booz Allen Hamilton Holding Corp	博思艾伦咨询控股公司	BAH UN	纽约证券交易所	美国	964	873,334.02	0.06
18 2	Merck & Co Inc	默克	MRK UN	纽约证券交易所	美国	1,128	870,991.92	0.06
18	Wintrust	Wintru	WTFC UW	纳斯达克	美国	1,302	855,310.39	0.06

3	Financial Corp	st 金融公司		克证券交易所				
184	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	381	844,876.09	0.06
185	Textron Inc	德事隆	TXT UN	纽约证券交易所	美国	1,483	844,703.06	0.06
186	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	733	833,306.78	0.06
187	Gap Inc/The	Gap 股份有限公司	GPS UN	纽约证券交易所	美国	5,604	829,948.24	0.06
188	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	西屋制动公司	WAB UN	纽约证券交易所	美国	913	820,599.50	0.06
189	Stryker Corp	史赛克	SYK UN	纽约证券交易所	美国	384	814,458.37	0.05
190	BellRing Brands Inc	BellRing Brands Inc	BRBR UN	纽约证券交易所	美国	2,061	809,136.36	0.05
191	3M Co	3M 公司	MMM UN	纽约证券交易所	美国	1,044	808,349.12	0.05
192	Morningstar Inc	晨星公司	MORN UW	纳斯达克证券交易所	美国	396	802,831.41	0.05
193	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	爱立信	ERIC UW	纳斯达克证券交易所	美国	17,910	799,162.29	0.05
194	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	790,780.34	0.05

19 5	AECOM	AECOM 公司	ACM UN	纽约证 券交易 所	美国	1,206	789,512.68	0.05
19 6	Stellanti s NV	Stella ntis 集 团	STLA UN	纽约证 券交易 所	美国	4,775	788,679.89	0.05
19 7	Dollar Tree Inc	美元树 公司	DLTR UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	782	786,768.27	0.05
19 8	Vontier Corp	Vontie r Corp	VNT UN	纽约证 券交易 所	美国	3,212	785,999.80	0.05
19 9	West Pharmaceu tical Services Inc	西氏医 药服务 公司	WST UN	纽约证 券交易 所	美国	314	783,103.54	0.05
20 0	ON Semicondu ctor Corp	安森美 半导体 公司	ON UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,319	780,344.05	0.05
20 1	Hershey Co/The	好时公 司	HSY UN	纽约证 券交易 所	美国	586	773,812.17	0.05
20 2	Rithm Capital Corp	Rithm 资本公 司	RITM UN	纽约证 券交易 所	美国	10,140	767,022.41	0.05
20 3	Spirit AeroSyste ms Holdings Inc	势必锐 航空系 统控股 有限公司	SPR UN	纽约证 券交易 所	美国	3,382	761,248.31	0.05
20 4	S&P Global Inc	标普全 球	SPGI UN	纽约证 券交易 所	美国	243	758,177.25	0.05
20 5	Snap Inc	Snap 股 份有限 公司	SNAP UN	纽约证 券交易 所	美国	6,314	757,112.44	0.05
20 6	Texas Instrumen ts Inc	德州仪 器	TXN UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	624	753,365.83	0.05
20 7	Cars.com Inc	Cars.c om 股 份有限 公司	CARS UN	纽约证 券交易 所	美国	5,605	753,081.18	0.05

208	Science Applications International Corp	科学应用国际公司	SAIC UN	纽约证券交易所	美国	855	752,845.68	0.05
209	Comerica Inc	Comerica 公司	CMA UN	纽约证券交易所	美国	1,894	748,670.71	0.05
210	Abercrombie & Fitch Co	阿贝克隆比&费奇公司	ANF UN	纽约证券交易所	美国	1,194	746,053.94	0.05
211	Gartner Inc	Gartner 公司	IT UN	纽约证券交易所	美国	232	741,257.82	0.05
212	Cigna Group/The	信诺集团	CI UN	纽约证券交易所	美国	349	740,199.17	0.05
213	Dow Inc	陶氏公司	DOW UN	纽约证券交易所	美国	1,899	737,600.59	0.05
214	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	736,217.48	0.05
215	Welltower Inc	Welltower Inc	WELL UN	纽约证券交易所	美国	1,152	735,721.41	0.05
216	Western Digital Corp	西部数据公司	WDC UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,983	735,536.34	0.05
217	KeyCorp	KeyCorp 公司	KEY UN	纽约证券交易所	美国	7,198	734,130.35	0.05
218	Herc Holdings Inc	Herc 控股公司	HRI UN	纽约证券交易所	美国	696	733,962.07	0.05
219	Boston Properties Inc	波士顿地产公司	BXP UN	纽约证券交易所	美国	1,476	733,561.76	0.05
220	Simon Property Group Inc	西蒙房地产集团公司	SPG UN	纽约证券交易所	美国	722	729,419.51	0.05
22	Digital	数字房	DLR UN	纽约证	美国	765	729,190.17	0.05

1	Realty Trust Inc	地产信托有限公司		券交易所				
22 2	AT&T Inc	美国电话电报公司	T UN	纽约证券交易所	美国	6,085	723,188.29	0.05
22 3	HP Inc	惠普	HPQ UN	纽约证券交易所	美国	3,350	713,946.78	0.05
22 4	Stanley Black & Decker Inc	史丹利百得公司	SWK UN	纽约证券交易所	美国	1,022	710,098.75	0.05
22 5	M&T Bank Corp	M&T 银行	MTB UN	纽约证券交易所	美国	723	701,958.18	0.05
22 6	Bancorp Inc/The	Bancorp 股份有限公司	TBBK UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,560	699,158.81	0.05
22 7	Elevance Health Inc	Elevance 健康股份有限公司	ELV UN	纽约证券交易所	美国	209	698,042.86	0.05
22 8	Extreme Networks Inc	Extreme Networks 股份有限公司	EXTR UW	纳斯达克证券交易所	美国	5,584	697,658.42	0.05
22 9	STAG Industrial Inc	STAG 实业公司	STAG UN	纽约证券交易所	美国	2,455	682,654.00	0.05
23 0	Encompass Health Corp	南方保健公司	EHC UN	纽约证券交易所	美国	1,440	680,483.15	0.05
23 1	Crane Co	Crane Co	CR UN	纽约证券交易所	美国	807	675,257.39	0.05
23 2	iRobot Corp	iRobot 公司	IRBT UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,446	670,449.80	0.04
23 3	Diamondback Energy	Diamondback	FANG UW	纳斯达克证	美国	604	663,424.61	0.04

	Inc	能源股份有限公司		交易所				
234	ATI Inc	冶联科技股份有限公司	ATI UN	纽约证券交易所	美国	2,052	660,847.36	0.04
235	Boston Scientific Corp	波士顿科学	BSX UN	纽约证券交易所	美国	1,609	658,806.48	0.04
236	Antero Midstream Corp	Antero 中游公司	AM UN	纽约证券交易所	美国	7,404	657,077.09	0.04
237	Logitech International SA	罗技国际股份有限公司	LOGI UW	纳斯达克证券交易所	美国	975	656,449.43	0.04
238	PTC Inc	PTC 公司	PTC UW	纳斯达克证券交易所	美国	528	654,291.89	0.04
239	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	653,030.61	0.04
240	Goldman Sachs Group Inc/The	高盛	GS UN	纽约证券交易所	美国	233	636,624.31	0.04
241	Pathward Financial Inc	Pathward 金融股份有限公司	CASH UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,696	635,808.88	0.04
242	Bentley Systems Inc	Bentley 系统公司	BSY UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,698	627,538.84	0.04
243	Analog Devices Inc	亚德诺半导体	ADI UW	纳斯达克证券交易所	美国	444	624,415.36	0.04
244	Elastic NV	Elastic 公共有限责任公司	ESTC UN	纽约证券交易所	美国	772	616,226.06	0.04
245	McKesson Corp	McKesson 公	MCK UN	纽约证券交易所	美国	185	606,642.46	0.04

		司		所				
24 6	Carlisle Cos Inc	卡莱股 份有限 公司	CSL UN	纽约证 券交易 所	美国	271	599,681.80	0.04
24 7	Procter & Gamble Co/The	宝洁	PG UN	纽约证 券交易 所	美国	573	594,716.05	0.04
24 8	Lincoln National Corp	林肯国 民	LNC UN	纽约证 券交易 所	美国	3,051	582,803.30	0.04
24 9	Equinix Inc	Equini x 有限 公司	EQIX UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	102	581,842.25	0.04
25 0	Duolingo Inc	多邻国	DUOL UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	362	581,629.20	0.04
25 1	Clorox Co/The	高乐氏 公司	CLX UN	纽约证 券交易 所	美国	575	580,705.26	0.04
25 2	Stifel Financial Corp	斯迪富 融资公 司	SF UN	纽约证 券交易 所	美国	1,178	576,947.53	0.04
25 3	Shift4 Payments Inc	Shift4 Paymen ts 股份 有限公司	FOUR UN	纽约证 券交易 所	美国	1,087	572,335.85	0.04
25 4	Phillips 66	Philli ps 66	PSX UN	纽约证 券交易 所	美国	605	570,509.36	0.04
25 5	Jabil Inc	捷普集 团	JBL UN	纽约证 券交易 所	美国	629	567,569.33	0.04
25 6	Hess Corp	赫斯公 司	HES UN	纽约证 券交易 所	美国	547	558,509.99	0.04
25 7	Occidenta l Petroleum Corp	西方石 油	OXY UN	纽约证 券交易 所	美国	1,313	555,278.23	0.04
25 8	Ryder System Inc	莱德系 统股份 有限公司	R UN	纽约证 券交易 所	美国	673	548,451.57	0.04

259	Upstart Holdings Inc	Upstart Holdings Inc	UPST UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,859	537,992.97	0.04
260	AAR Corp	AAR 公司	AIR UN	纽约证券交易所	美国	1,184	523,281.21	0.04
261	Altair Engineering Inc	Altair Engineering 股份有限公司	ALTR UW	纳斯达克证券交易所	美国	876	522,104.06	0.04
262	Evercore Inc	Evercore 股份有限公司	EVR UN	纽约证券交易所	美国	430	520,943.21	0.03
263	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	497,532.76	0.03
264	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	436	485,535.23	0.03
265	SBA Communications Corp	SBA 通信公司	SBAC UW	纳斯达克证券交易所	美国	270	485,138.74	0.03
266	Parker-Hannifin Corp	派克汉尼汾公司	PH UN	纽约证券交易所	美国	147	479,660.98	0.03
267	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	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	726	477,952.64	0.03
268	Quanta Services Inc	Quanta 服务股份有限公司	PWR UN	纽约证券交易所	美国	306	467,704.68	0.03
269	10X Genomics	10X Genomi	TXG UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,178	466,897.82	0.03

	Inc	cs 股份 有限公司		交易所				
27 0	Dynatrace Inc	Dynatrace 股份 有限公司	DT UN	纽约证 券交易 所	美国	1,202	465,598.14	0.03
27 1	Skechers USA Inc	斯凯奇 美国公 司	SKX UN	纽约证 券交易 所	美国	1,042	460,080.01	0.03
27 2	Monster Beverage Corp	怪兽饮 料公司	MNST UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,121	457,406.50	0.03
27 3	Gitlab Inc	Gitlab 股份 有限公司	GTLB UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,023	456,183.11	0.03
27 4	Equitable Holdings Inc	Equitable 控 股股份 有限公司	EQH UN	纽约证 券交易 所	美国	1,925	454,018.78	0.03
27 5	Macy's Inc	梅西百 货股份 有限公司	M UN	纽约证 券交易 所	美国	3,183	453,589.99	0.03
27 6	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	595	452,015.79	0.03
27 7	Fabrinet	Fabrinet 公 司	FN UN	纽约证 券交易 所	美国	333	448,900.75	0.03
27 8	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	1,912	448,785.94	0.03
27 9	Carvana Co	Carvana 公 司	CVNA UN	纽约证 券交易 所	美国	1,193	447,325.06	0.03
28 0	Simpson Manufactu ring Co Inc	辛普森 制造有 限公司	SSD UN	纽约证 券交易 所	美国	319	447,312.31	0.03
28	BWX	BWX 科	BWXT UN	纽约证	美国	823	447,263.93	0.03

1	Technologies Inc	技公司		券交易所				
282	Masimo Corp	Masimo 公司	MASI UN	纳斯达克证券交易所	美国	538	446,627.84	0.03
283	DigitalBridge Group Inc	DigitalBridge 集团股份有限公司	DBRG UN	纽约证券交易所	美国	3,595	446,608.86	0.03
284	Crown Castle Inc	冠城股份有限公司	CCI UN	纽约证券交易所	美国	545	444,641.64	0.03
285	Albemarle Corp	雅保公司	ALB UN	纽约证券交易所	美国	430	440,022.65	0.03
286	Berkshire Hathaway Inc	伯克希尔哈撒韦公司	BRK/B UN	纽约证券交易所	美国	170	429,439.68	0.03
287	Leidos Holdings Inc	Leidos 控股公司	LDOS UN	纽约证券交易所	美国	559	428,546.98	0.03
288	Jefferies Financial Group Inc	杰富瑞金融集团	JEF UN	纽约证券交易所	美国	1,494	427,600.59	0.03
289	Regions Financial Corp	地区金融公司	RF UN	纽约证券交易所	美国	3,057	419,612.15	0.03
290	Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc	Ollie's 折扣商店控股股份有限公司	OLLI UN	纳斯达克证券交易所	美国	772	414,954.71	0.03
291	Celanese Corp	塞拉尼斯公司	CE UN	纽约证券交易所	美国	369	406,062.03	0.03
292	Snowflake Inc	Snowflake 股份有限公司	SNOW UN	纽约证券交易所	美国	288	405,923.70	0.03
293	Victoria's Secret & Co	维多利亚的秘密	VSCO UN	纽约证券交易所	美国	2,158	405,649.74	0.03

29 4	Pure Storage Inc	Pure 储存股份有限公司	PSTG UN	纽约证券交易所	美国	1,599	403,857.96	0.03
29 5	Crocs Inc	卡骆驰股份有限公司	CROX UW	纳斯达克证券交易所	美国	599	396,295.41	0.03
29 6	DaVita Inc	DaVita 股份有限公司	DVA UN	纽约证券交易所	美国	530	393,251.34	0.03
29 7	IQVIA Holdings Inc	艾昆纬	IQV UN	纽约证券交易所	美国	238	390,033.24	0.03
29 8	Paramount Global	派拉蒙全球	PARA UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,723	389,995.91	0.03
29 9	Marathon Digital Holdings Inc	Marathon 数字控股股份有限公司	MARA UR	纳斯达克证券交易所	美国	2,328	387,315.47	0.03
30 0	Builders FirstSource Inc	Builders FirstSource 股份有限公司	BLDR UN	纽约证券交易所	美国	326	385,457.82	0.03
30 1	TPG Inc	TPG Inc	TPG UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,182	361,408.51	0.02
30 2	Phoenix Motor Inc	Phoenix Motor Inc	PEV UR	纳斯达克证券交易所	美国	49,030	361,155.37	0.02
30 3	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股	TCEHY UV	纽约证券交易所	美国	1,330	355,981.46	0.02
30 4	XP Inc	XP 股份有限公司	XP UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,891	349,165.57	0.02
30 5	Principal Financial Group Inc	信安金融	PFG UW	纳斯达克证券交易所	美国	624	347,690.31	0.02
30 6	SPS Commerce	SPS 商业股份	SPSC UW	纳斯达克证券交易所	美国	252	345,973.46	0.02

	Inc	有限公司		交易所				
307	Cardinal Health Inc	嘉德诺健康集团	CAH UN	纽约证券交易所	美国	479	341,975.42	0.02
308	Williams-Sonoma Inc	Williams-Sonoma 股份有限公司	WSM UN	纽约证券交易所	美国	235	335,849.59	0.02
309	JELD-WEN Holding Inc	JELD-WEN 控股公司	JELD UN	纽约证券交易所	美国	2,505	334,972.05	0.02
310	Eagle Materials Inc	鹰牌材料有限公司	EXP UN	纽约证券交易所	美国	233	334,740.58	0.02
311	International Business Machines Corp	国际商业机器	IBM UN	纽约证券交易所	美国	287	332,453.79	0.02
312	Vulcan Materials Co	Vulcan 材料	VMC UN	纽约证券交易所	美国	206	331,215.81	0.02
313	Watsco Inc	Watsco 公司	WSO UN	纽约证券交易所	美国	106	321,680.79	0.02
314	Capital One Financial Corp	第一资本金融	COF UN	纽约证券交易所	美国	343	318,538.48	0.02
315	TechnipFMC PLC	TechnipFMC 公共有限公司	FTI UN	纽约证券交易所	美国	2,229	317,956.99	0.02
316	Itron Inc	爱拓利公司	ITRI UW	纳斯达克证券交易所	美国	588	314,471.03	0.02
317	Etsy Inc	Etsy 股份有限公司	ETSY UW	纳斯达克证券交易所	美国	546	313,432.85	0.02
318	Datadog Inc	Datadog 股份有限公司	DDOG UW	纳斯达克证券交易所	美国	353	303,473.44	0.02

		司						
319	Nutanix Inc	Nutanix 股份有限公司	NTNX UW	纳斯达克证券交易所	美国	896	302,645.47	0.02
320	Pinterest Inc	Pinterest 股份有限公司	PINS UN	纽约证券交易所	美国	1,153	302,481.72	0.02
321	Brunswick Corp/DE	宾士域集团（特拉华州）	BC UN	纽约证券交易所	美国	440	301,510.54	0.02
322	Citigroup Inc	花旗集团	C UN	纽约证券交易所	美国	822	299,482.62	0.02
323	Domino's Pizza Inc	达美乐披萨公司	DPZ UN	纽约证券交易所	美国	102	297,809.54	0.02
324	Aptiv PLC	Aptiv 公共有限公司	APTIV UN	纽约证券交易所	美国	467	296,759.75	0.02
325	AvePoint Inc	AvePoint Inc	AVPT UW	纳斯达克证券交易所	美国	5,092	296,094.54	0.02
326	Zebra Technologies Corp	斑马技术公司	ZBRA UW	纳斯达克证券交易所	美国	152	294,258.99	0.02
327	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	862	293,725.38	0.02
328	AMETEK Inc	阿美特克股份有限公司	AME UN	纽约证券交易所	美国	250	291,966.60	0.02
329	Sherwin-Williams Co/The	宣伟公司	SHW UN	纽约证券交易所	美国	129	284,973.14	0.02
330	Pegasystems Inc	Pegasystems	PEGA UW	纳斯达克证券	美国	816	282,385.55	0.02

		股份有 限公司		交易所				
33 1	Equitrans Midstream Corp	Equitrans Midstream 公司	ETRN UN	纽约证 券交易 所	美国	3,846	277,303.85	0.02
33 2	Casey's General Stores Inc	凯西杂 货公司	CASY UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	140	272,426.14	0.02
33 3	Thermo Fisher Scientific Inc	Thermo Fisher Scientific 公司	TMO UN	纽约证 券交易 所	美国	72	270,678.70	0.02
33 4	Goosehead Insurance Inc	Goosehead Insurance Inc	GSHD UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	500	268,434.33	0.02
33 5	First Citizens BancShares Inc/NC	第一公 民银行 (北 卡)	FCNCA UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	26	261,303.61	0.02
33 6	Las Vegas Sands Corp	拉斯维 加斯金 沙集团	LVS UN	纽约证 券交易 所	美国	733	255,479.58	0.02
33 7	Qurate Retail Inc	Qurate 零售股 份有限 公司	QRTEA UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	41,067	254,652.53	0.02
33 8	Otis Worldwide Corp	奥的斯 电梯公 司	OTIS UN	纽约证 券交易 所	美国	393	249,039.84	0.02
33 9	Marathon Oil Corp	Marathon 石油 公司	MRO UN	纽约证 券交易 所	美国	1,452	248,463.38	0.02
34 0	Dell Technologies Inc	戴尔科 技公司	DELL UN	纽约证 券交易 所	美国	456	247,072.91	0.02
34 1	Korn Ferry	光辉国 际	KFY UN	纽约证 券交易 所	美国	581	244,228.14	0.02
34	RTX Corp	RTX 公	RTX UN	纽约证	美国	398	237,183.47	0.02

2		司		券交易所				
343	MicroStrategy Inc	微策略公司	MSTR UW	纳斯达克证券交易所	美国	53	237,099.47	0.02
344	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	127	235,615.79	0.02
345	Paychex Inc	Paychex 公司	PAYX UW	纳斯达克证券交易所	美国	276	232,839.23	0.02
346	Element Solutions Inc	Element 解决方案股份有限公司	ESI UN	纽约证券交易所	美国	1,404	230,106.72	0.02
347	Assurant Inc	安信龙集团	AIZ UN	纽约证券交易所	美国	188	224,352.46	0.02
348	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	186	219,910.61	0.01
349	Ball Corp	波尔	BALL UN	纽约证券交易所	美国	526	214,290.77	0.01
350	Tyler Technologies Inc	Tyler 科技公司	TYL UN	纽约证券交易所	美国	70	207,299.30	0.01
351	Halliburton Co	哈利伯顿	HAL UN	纽约证券交易所	美国	765	195,870.30	0.01
352	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	475	194,657.39	0.01
353	Ingredion Inc	宜瑞安公司	INGR UN	纽约证券交易所	美国	253	194,477.41	0.01
354	Automatic Data Processing Inc	ADP 公司	ADP UW	纳斯达克证券交易所	美国	117	193,056.62	0.01

355	Unity Software Inc	Unity 软件股份有限公司	U UN	纽约证券交易所	美国	666	192,881.33	0.01
356	Valero Energy Corp	Valero 能源	VLO UN	纽约证券交易所	美国	203	186,912.45	0.01
357	Cymbay Therapeutics Inc	Cymbay 医疗股份有限公司	CBAY UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,076	180,007.67	0.01
358	Exxon Mobil Corp	埃克森美孚石油公司	XOM UN	纽约证券交易所	美国	254	179,864.60	0.01
359	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	174,423.24	0.01
360	Pentair PLC	Pentair 公共有限公司	PNR UN	纽约证券交易所	美国	337	173,549.31	0.01
361	Darden Restaurants Inc	达登餐饮公司	DRI UN	纽约证券交易所	美国	148	172,225.77	0.01
362	Photronics Inc	Photronics 股份有限公司	PLAB UW	纳斯达克证券交易所	美国	766	170,193.17	0.01
363	NCR Voyix Corp	NCR Voyix 公司	VYX UN	纽约证券交易所	美国	1,420	170,071.21	0.01
364	Delta Air Lines Inc	达美航空有限公司	DAL UN	纽约证券交易所	美国	593	168,967.65	0.01
365	Ecolab Inc	艺康集团	ECL UN	纽约证券交易所	美国	119	167,177.57	0.01
366	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	542	167,027.21	0.01

367	MSCI Inc	MSCI 明晟	MSCI UN	纽约证券交易所	美国	40	160,253.17	0.01
368	Incyte Corp	因赛特公司	INCY UW	纳斯达克证券交易所	美国	357	158,766.02	0.01
369	Tapestry Inc	TPR-DR S-RS	TPR UN	纽约证券交易所	美国	591	154,082.08	0.01
370	Hewlett Packard Enterprise Co	慧与	HPE UN	纽约证券交易所	美国	1,224	147,203.44	0.01
371	Cognizant Technology Solutions Corp	高知特科技公司	CTSH UW	纳斯达克证券交易所	美国	273	146,043.08	0.01
372	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	60	142,324.02	0.01
373	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	142,236.91	0.01
374	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	139,358.21	0.01
375	Franklin Resources Inc	富兰克林资源	BEN UN	纽约证券交易所	美国	630	132,925.99	0.01
376	Brink's Co/The	Brink's 公司	BCO UN	纽约证券交易所	美国	208	129,568.08	0.01
377	Campbell Soup Co	金宝汤	CPB UN	纽约证券交易所	美国	399	122,167.86	0.01
378	Starbucks Corp	星巴克公司	SBUX UW	纳斯达克证券交易所	美国	171	116,281.71	0.01
37	Intercont	洲际交	ICE UN	纽约证	美国	111	100,969.06	0.01

9	imental Exchange Inc	易所 (ICE)		券交易所				
380	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	261	100,784.84	0.01
381	Expeditors International of Washington Inc	华盛顿康捷国际物流公司	EXPD UN	纽约证券交易所	美国	104	93,695.62	0.01
382	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	146	90,926.14	0.01
383	Inter Parfums Inc	Inter Parfums 股份有限公司	IPAR UW	纳斯达克证券交易所	美国	78	79,558.41	0.01
384	Westrock Co	WestRock 公司	WRK UN	纽约证券交易所	美国	268	78,811.75	0.01
385	Kraft Heinz Co/The	卡夫亨氏公司	KHC UW	纳斯达克证券交易所	美国	291	76,218.21	0.01
386	FNB Corp/PA	FNB/宾州	FNB UN	纽约证券交易所	美国	778	75,877.39	0.01
387	Zoom Video Communications 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	144	73,341.64	0.00
388	Manulife Financial Corp	宏利金融	MFC UN	纽约证券交易所	美国	457	71,533.15	0.00
389	Webster Financial Corp	韦伯斯特金融公司	WBS UN	纽约证券交易所	美国	176	63,275.14	0.00
390	Entegris Inc	Entegris 股份有限公司	ENTG UW	纳斯达克证券交易所	美国	72	61,102.74	0.00

		司						
39 1	Six Flags Entertain ment Corp	六旗娱 乐公司	SIX UN	纽约证 券交易 所	美国	337	59,862.70	0.00
39 2	Snap-on Inc	实耐宝	SNA UN	纽约证 券交易 所	美国	29	59,327.24	0.00
39 3	Edwards Lifescien ces Corp	爱德华 生命科 学公司	EW UN	纽约证 券交易 所	美国	108	58,326.03	0.00
39 4	Crane NXT Co	Crane NXT Co	CXT UN	纽约证 券交易 所	美国	138	55,585.45	0.00
39 5	DuPont de Nemours Inc	杜邦公 司	DD UN	纽约证 券交易 所	美国	101	55,032.08	0.00
39 6	Humana Inc	Humana 股份有 限公司	HUM UN	纽约证 券交易 所	美国	16	51,880.49	0.00
39 7	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	51,849.61	0.00
39 8	Tractor Supply Co	拖拉机 供应公 司	TSCO UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	33	50,258.77	0.00
39 9	American Express Co	美国运 通	AXP UN	纽约证 券交易 所	美国	36	47,767.43	0.00
40 0	Chemed Corp	Chemed 公司	CHE UN	纽约证 券交易 所	美国	11	45,557.70	0.00
40 1	Paycom Software Inc	Paycom 软件股 份有限 公司	PAYC UN	纽约证 券交易 所	美国	28	40,995.80	0.00
40 2	AZEK Co Inc/The	AZEK 股 份有限 公司	AZEK UN	纽约证 券交易 所	美国	143	38,740.60	0.00
40 3	WillScot Mobile Mini Holdings Corp	WillSc ot Mobile Mini 控 股公司	WSC UR	纳斯达 克证券 交易所	美国	117	36,876.08	0.00

404	Performance Food Group Co	Performance 食品集团公司	PFGC UN	纽约证券交易所	美国	70	34,283.81	0.00
405	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	5	33,645.66	0.00
406	Arcosa Inc	Arcosa Inc	ACA UN	纽约证券交易所	美国	57	33,362.92	0.00
407	Alnylam Pharmaceuticals Inc	艾拉伦制药股份有限公司	ALNY UW	纳斯达克证券交易所	美国	23	31,181.09	0.00
408	Biogen Inc	渤健公司	BIIB UW	纳斯达克证券交易所	美国	17	31,157.43	0.00
409	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	43	28,701.37	0.00
410	AMC Networks Inc	AMC 网络公司	AMCX UW	纳斯达克证券交易所	美国	210	27,947.63	0.00
411	Charter Communications Inc	Charter 通信公司	CHTR UW	纳斯达克证券交易所	美国	10	27,529.04	0.00
412	BILL Holdings Inc	Bill 控股股份有限公司	BILL UN	纽约证券交易所	美国	47	27,160.24	0.00
413	Moderna Inc	莫德纳公司	MRNA UW	纳斯达克证券交易所	美国	36	25,357.48	0.00
414	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	23,040.94	0.00
415	Deere & Co	迪尔	DE UN	纽约证券交易所	美国	8	22,657.27	0.00

416	QIAGEN NV	德国 QIAGEN 公共有限公司	QGEN UN	纽约证券交易所	美国	64	19,686.51	0.00
417	Teladoc Health Inc	Teladoc 健康股份有限公司	TDOC UN	纽约证券交易所	美国	128	19,536.92	0.00
418	Crown Holdings Inc	Crown 控股股份有限公司	CCK UN	纽约证券交易所	美国	27	17,610.64	0.00
419	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	25	17,322.51	0.00
420	L3Harris Technologies Inc	L3Harris Technologies 股份有限公司	LHX UN	纽约证券交易所	美国	11	16,409.34	0.00
421	Plug Power Inc	普拉格动力公司	PLUG UR	纳斯达克证券交易所	美国	471	15,011.78	0.00
422	ChampionX Corp	ChampionX 公司	CHX UW	纳斯达克证券交易所	美国	62	12,826.91	0.00
423	News Corp	新闻集团	NWS UW	纳斯达克证券交易所	美国	69	12,569.53	0.00
424	QuantumScape Corp	QuantumScape 公司	QS UN	纽约证券交易所	美国	232	11,420.15	0.00
425	Veeva Systems Inc	Veeva Systems 股份有限公司	VEEV UN	纽约证券交易所	美国	7	9,544.93	0.00
426	SiTime Corp	SiTime Corp	SITM UQ	纳斯达克证券交易所	美国	11	9,511.22	0.00
427	Wayfair Inc	Wayfair 股份有限公司	W UN	纽约证券交易所	美国	19	8,303.05	0.00

		司						
428	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	16	8,154.74	0.00
429	Atlassian Corp	Atlassian Corp	TEAM UW	纳斯达克证券交易所	美国	4	6,738.76	0.00
430	Eastman Chemical Co	伊士曼化工	EMN UN	纽约证券交易所	美国	10	6,361.68	0.00
431	Everest Group Ltd	Everest 集团有限公司	EG UN	纽约证券交易所	美国	2	5,008.60	0.00
432	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	3,341.12	0.00
433	iHeartMedia Inc	iHeart Media 股份有限公司	IHRT UW	纳斯达克证券交易所	美国	156	2,950.09	0.00
434	MarketAxess Holdings Inc	MarketAxess 控股公司	MKTX UW	纳斯达克证券交易所	美国	1	2,074.17	0.00
435	Peloton Interactive Inc	派乐腾	PTON UW	纳斯达克证券交易所	美国	25	1,078.34	0.00
436	New York Community Bancorp Inc	纽约社区银行有限公司	NYCB UN	纽约证券交易所	美国	8	579.65	0.00
437	Under Armour Inc	安德玛股份有限公司	UAA UN	纽约证券交易所	美国	8	498.06	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	Meta Platforms Inc	META UW	33,953,716.88	2.68
2	Alphabet Inc	GOOGL UW	24,796,969.78	1.95
3	Amazon.com Inc	AMZN UW	19,033,491.67	1.50
4	Microsoft Corp	MSFT UW	17,640,608.26	1.39
5	NVIDIA Corp	NVDA UW	14,909,326.18	1.17
6	Salesforce Inc	CRM UN	10,887,381.03	0.86
7	Tesla Inc	TSLA UW	9,658,052.09	0.76
8	Home Depot Inc/The	HD UN	9,288,965.54	0.73
9	Uber Technologies Inc	UBER UN	8,476,789.31	0.67
10	Eli Lilly & Co	LLY UN	8,340,394.86	0.66
11	Netflix Inc	NFLX UW	8,155,971.19	0.64
12	Adobe Inc	ADBE UW	8,144,184.61	0.64
13	Advanced Micro Devices Inc	AMD UW	8,130,241.58	0.64
14	Apple Inc	AAPL UW	7,512,848.00	0.59
15	QUALCOMM Inc	QCOM UW	7,377,663.35	0.58
16	Zoetis Inc	ZTS UN	7,126,267.46	0.56
17	Airbnb Inc	ABNB UW	7,029,189.55	0.55
18	Intuitive Surgical Inc	ISRG UW	6,887,032.31	0.54
19	Arista Networks Inc	ANET UN	6,791,436.07	0.54
20	Palo Alto Networks Inc	PANW UW	6,748,280.05	0.53

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	Microsoft Corp	MSFT UW	46,713,937.42	3.68
2	Apple Inc	AAPL UW	40,031,326.99	3.15
3	UnitedHealth Group Inc	UNH UN	19,278,593.96	1.52
4	AbbVie Inc	ABBV UN	18,103,691.50	1.43
5	Alphabet Inc	GOOGL UW	13,481,151.18	1.06
6	Amgen Inc	AMGN UW	10,772,831.72	0.85
7	Coca-Cola Co/The	KO UN	10,637,048.13	0.84
8	Merck & Co Inc	MRK UN	10,273,285.35	0.81
9	NIKE Inc	NKE UN	10,060,863.19	0.79
10	McKesson Corp	MCK UN	9,969,527.48	0.79
11	Lockheed Martin Corp	LMT UN	9,645,489.25	0.76
12	QUALCOMM Inc	QCOM UW	9,119,825.15	0.72

13	CVS Health Corp	CVS UN	9,054,520.42	0.71
14	Mastercard Inc	MA UN	8,995,944.81	0.71
15	Visa Inc	V UN	8,637,615.78	0.68
16	Advanced Micro Devices Inc	AMD UW	8,587,921.33	0.68
17	PepsiCo Inc	PEP UW	8,246,019.37	0.65
18	Caterpillar Inc	CAT UN	8,242,504.12	0.65
19	Berkshire Hathaway Inc	BRK/B UN	8,117,550.09	0.64
20	Home Depot Inc/The	HD UN	8,109,967.67	0.64

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	866,957,208.43
卖出收入（成交）总额	1,138,864,337.28

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	ARK Innovation ETF	ETF	交易型开放式	ARK Investment Management LLC	16,750,050.47	1.12
2	Technology Select Sector SPDR Fund	ETF	交易型开放式	State Street Global Advisors Inc	10,379,999.42	0.70

3	SPDR S&P Bank ETF	ETF	交易型开放式	SSgA Funds Management Inc	3,876,148.10	0.26
4	ARK Genomic Revolution ETF	ETF	交易型开放式	ARK Investment Management LLC	3,008,667.71	0.20
5	iShares Russell 1000 Value ETF	ETF	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	2,951,789.59	0.20
6	iShares Russell 2000 Growth ETF	ETF	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	2,949,344.08	0.20
7	iShares 20+ Year Treasury Bond ETF	ETF	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	2,526,116.92	0.17
8	Global X Artificial Intelligence & Technology ETF	ETF	交易型开放式	Global X Management Co LLC	1,621,838.58	0.11
9	Invesco QQQ Trust Series 1	ETF	交易型开放式	Invesco Capital Management LLC	1,621,383.58	0.11
10	Invesco KBW Bank ETF	ETF	交易型开放式	Invesco Capital Management LLC	1,467,104.03	0.10

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	699,842.80
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,678,975.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,378,818.23

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	163,511	2,285.59	23,715,950.72	6.35	350,003,859.99	93.65
嘉实美国 成长股票 型证券投 资基金- 美元现汇	547	8,154.81	-	-	4,460,681.52	100.00
合计	163,975	2,306.33	23,715,950.72	6.27	354,464,541.51	93.73

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	93,777.75	0.03
	嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇	130.06	0.00
	合计	93,907.81	0.02

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	0~10
	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

9.4 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	430,245,997.74	7,592,329.66

（2013 年 6 月 14 日） 基金份额总额		
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	248,086,616.72	1,025,441.74
减：本报告期基金总赎回份额	316,930,660.59	1,686,829.89
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	373,719,810.71	4,460,681.52

§ 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

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。

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 99,000.00 元, 该审计机构已连续 11 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

本报告期, 基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内, 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	-	1,406,456,501.95	70.56	977,912.36	82.03	-
瑞银集团 Union Bank of Switzerland	-	398,559,910.91	20.00	152,052.24	12.75	-
花旗环球金融亚洲有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited	-	138,112,592.09	6.93	41,433.92	3.48	-
瑞士信贷(香港)有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	50,017,569.55	2.51	20,734.92	1.74	-
麦格理银行有限公司	-	-	-	-	-	-

司香港分行 Macquaire Bank Limited Hong K ong Bran ch.						
Wolfe Research Securit ies	-	-	-	-	-	-
德意志银 行	-	-	-	-	-	-
金贝塔证 券有限公 司 iGoldenbe ta Secur ities Company Limited	-	-	-	-	-	-
麦格理资 本证券股 份有限公 司 Macquarie Secur ities Gr oup	-	-	-	-	-	-
中信证券 国际有限 公司 CITIC Securitie s Intern ational 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。

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	-	-	-	-	-	-	72,571,895.39	63.42
瑞银集团 Union Bank of Switzerland	-	-	-	-	-	-	39,948,920.48	34.91
花旗环球金融亚洲有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited	-	-	-	-	-	-	1,546,979.00	1.35
瑞士信贷（香港）有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	365,467.68	0.32
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	-	-	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-	-	-
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）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	关于嘉实美国成长股票（QDII）2023年9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8月31日
12	关于嘉实美国成长股票（QDII）2023年11月23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11月21日
13	关于嘉实美国成长股票（QDII）2023	证券日报、基金管理人	2023年12月21日

	年 12 月 25 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	
--	----------------------------	------------------	--

§ 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

2024 年 3 月 28 日