

嘉实美国成长股票型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：2024 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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，并由代董事长签发。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 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..... | 13 |
| §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 净资产变动表..... | 15 |
| 6.4 报表附注..... | 17 |
| §7 投资组合报告 | 38 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 38 |
| 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布..... | 39 |
| 7.3 期末按行业分类的权益投资组合..... | 39 |
| 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..... | 79 |
| 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合..... | 80 |
| 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..... | 80 |
| 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..... | 80 |
| 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..... | 80 |
| 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..... | 80 |
| 7.11 投资组合报告附注..... | 82 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 82 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 82 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 83 |
| 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..... | 83 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 84 |
| §10 重大事件揭示..... | 84 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 84 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动..... | 84 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 84 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 84 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 85 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 85 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 85 |
| 10.8 其他重大事件..... | 88 |
| §11 备查文件目录..... | 89 |
| 11.1 备查文件目录..... | 89 |
| 11.2 存放地点..... | 89 |
| 11.3 查阅方式..... | 89 |

§ 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 | 837,250,162.27 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 | 832,749,191.89 份 | 4,500,970.38 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(2024 年 1 月 1 日-2024 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 | -5,775,036.11 | -120,729.20 |
| 本期利润 | 438,792,254.45 | 21,607,639.73 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.7547 | 4.8875 |
| 本期加权平均净值利润率 | 18.00% | 19.31% |

| | | |
|---------------|------------------|----------------|
| 本期基金份额净值增长率 | 21.79% | 21.04% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2024年6月30日) | |
| 期末可供分配利润 | 667,534,851.66 | 25,423,851.96 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.8016 | 5.6485 |
| 期末基金资产净值 | 3,770,921,141.51 | 124,373,571.37 |
| 期末基金份额净值 | 4.528 | 3.877 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2024年6月30日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | 352.80% | 287.70% |

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 |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 5.01% | 0.83% | 6.34% | 0.68% | -1.33% | 0.15% |
| 过去三个月 | 7.22% | 1.04% | 7.73% | 0.93% | -0.51% | 0.11% |
| 过去六个月 | 21.79% | 1.02% | 19.20% | 0.91% | 2.59% | 0.11% |
| 过去一年 | 29.89% | 0.98% | 30.71% | 0.88% | -0.82% | 0.10% |
| 过去三年 | 48.85% | 1.28% | 32.82% | 1.26% | 16.03% | 0.02% |

| | | | | | | |
|----------------|---------|-------|---------|-------|--------|-------|
| 自基金合同生效起 至今 | 352.80% | 1.18% | 360.77% | 1.15% | -7.97% | 0.03% |
|----------------|---------|-------|---------|-------|--------|-------|

嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|--------|
| 过去一个月 | 4.73% | 0.83% | 6.34% | 0.68% | -1.61% | 0.15% |
| 过去三个月 | 6.75% | 1.04% | 7.73% | 0.93% | -0.98% | 0.11% |
| 过去六个月 | 21.04% | 1.03% | 19.20% | 0.91% | 1.84% | 0.12% |
| 过去一年 | 31.69% | 0.98% | 30.71% | 0.88% | 0.98% | 0.10% |
| 过去三年 | 35.04% | 1.25% | 32.82% | 1.26% | 2.22% | -0.01% |
| 自基金合同生效起 至今 | 287.70% | 1.16% | 360.77% | 1.15% | -73.07% | 0.01% |

注：本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

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

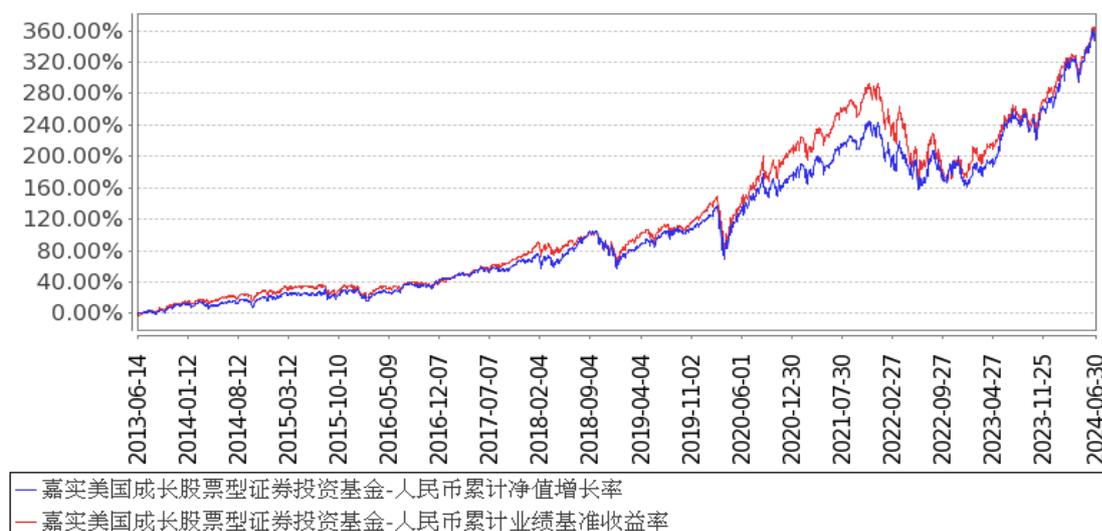
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

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

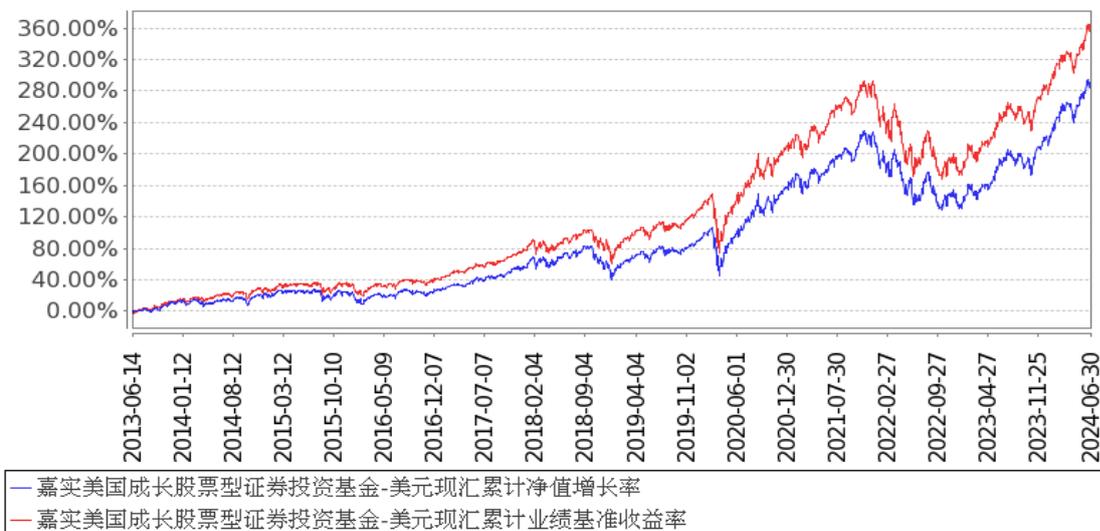
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2013年06月14日至2024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2024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 2024 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 351 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、嘉实全球 | 2013 年 6 月 14 日 | - | 28 年 | 曾任美国世纪投资管理公司（American Century Investments）资深副总经理，研 |

| | | | | | |
|--|------------------------|--|--|--|---|
| | 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 9 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

2024 年上半年，美股市场持续上行，大盘权重股表现强劲并屡创新高。本基金基准内涉及指数罗素 1000 成长指数上涨 20.62%，纳斯达克 100 指数上涨 16.98%，标普 500 上涨 14.48%，不断刷新指数的历史新高。

美股在上半年表现出较为明显的结构性特征，大盘占优、成长占优。市值维度上，大盘指数罗素 1000 上涨 13.44%，大幅领先小盘指数罗素 2000 的 1.02%，大盘之内的风格维度上，罗素 1000 成长上涨 20.26%，也大幅领先罗素 1000 价值的 5.46%。美股市场内的结构性特征，受到诸多因素推动，包括最近几个季度持续强劲的企业盈利对成长板块估值的消化、AI 产业趋势继续对科技成长风格以及核心龙头股票的催化、较稳定的宏观经济指标对美联储货币政策施展空间以及投资者预期的推动。相比于美联储加息期间价值风格的走强而言，报告期内成长风格显著占优。

本基金以大盘成长股为投资方向，在组合构建过程严格依据基金合同明确的风格进行管理，以合同明确的基准指数为基础，建立分散化的投资组合。在行业上，主要配置于信息技术、生物医药、非必需消费品等行业，并以高科技行业内的龙头企业为主要配置。本组合不持有受俄乌冲突直接影响的上市公司资产，不持有潜在可能受中东局势影响及在全球各类风险事件中受影响的上市公司股票。

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，申赎的随机性和资金流程会影响仓位水平并影响投资业绩，报告期内实现了流动性的稳健管理。

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 4.528 元，本报告期基金份额净值增长率为 21.79%；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 3.877 美元，本报告期基金份额净值增长率为 21.04%；业绩比较基准收益率为 19.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美股的核心驱动力，是企业盈利能力的积极态势。美股在 2023 年 3 季度、4 季度以及 2024 年 1 季度的几次财务披露中，都保持了强劲的盈利水平和盈利成长态势，由此构成了更广泛的选股机会。今年以来的美股市场结构，如我们之前几次季报内的展望一致，逐步从龙头领衔上涨的状态，进入有更广泛企业盈利增长为基础的扩散性的上行阶段，有更大范围的 ALPHA 挖掘机会。也如之前的展望一致，RLG 对 NDX 继续领先。

除企业盈利外，美联储的政策也是全部资本市场的基础环境和核心催化。在大选年内，美联储一般都会保持平稳可预见的货币政策推出过程，不会有过于突然的政策转向。在当前持续多期的宏观指标下，美联储已有较为充足的条件转入降息政策，预估在 2024 年下半年或有 1-2 次降息，首次降息有较大概率在大选之前进行。在利率等金融条件进入更加宽松的环境时，企业融资约束

边际放松，相对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。市场将面临扩散性牛市的潜在时机，而降息预期加强以及政策推出等时刻会出现的市场快速结构性调整是潜在的波动和风险。

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

本基金管理人按照《企业会计准则》及中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于基金资产估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求，履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，研究、指导基金估值业务。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，具备投研、风险管理、基金估值运作、法律合规等方面的专业胜任能力。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制，与估值相关的机构包括基金投资市场的证券交易场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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 272,228,370.38 | 112,543,778.61 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 3,636,780,136.59 | 1,391,179,240.32 |
| 其中：股票投资 | | 3,620,256,165.87 | 1,339,895,575.80 |
| 基金投资 | | 16,523,970.72 | 51,283,664.52 |
| 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 | | - | - |
| 应收股利 | | 569,924.31 | 699,842.80 |
| 应收申购款 | | 96,282,838.97 | 10,678,975.43 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | - |
| 资产总计 | | 4,005,861,270.25 | 1,515,101,837.16 |

| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 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 | | 13,756,560.86 | 2,985,757.94 |
| 应付赎回款 | | 90,210,962.10 | 18,222,142.55 |
| 应付管理人报酬 | | 5,171,810.05 | 2,238,657.55 |
| 应付托管费 | | 1,005,629.74 | 435,294.54 |
| 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 | 6.4.7.9 | 421,594.62 | 269,398.49 |
| 负债合计 | | 110,566,557.37 | 24,274,374.47 |
| 净 资 产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 860,475,950.60 | 401,200,270.43 |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | 3,034,818,762.28 | 1,089,627,192.26 |
| 净资产合计 | | 3,895,294,712.88 | 1,490,827,462.69 |
| 负债和净资产总计 | | 4,005,861,270.25 | 1,515,101,837.16 |

注：报告截止日 2024 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 4.528 元，基金份额总额 832,749,191.89 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 3.877 美元，基金份额总额 4,500,970.38 份，基金份额总额合计为 837,250,162.27 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|----------------|----------|--|---|
| 一、营业总收入 | | 487,616,809.93 | 354,491,569.88 |
| 1. 利息收入 | | 146,757.30 | 71,382.33 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 146,757.30 | 71,382.33 |
| 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） | | 51,690,656.65 | 47,019,859.81 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | 43,862,349.02 | 42,408,682.78 |
| 基金投资收益 | 6.4.7.15 | -49,181.94 | -777,489.81 |
| 债券投资收益 | 6.4.7.16 | - | - |
| 资产支持证券投资 收益 | 6.4.7.17 | - | - |
| 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 | 7,877,489.57 | 5,388,666.84 |
| 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 | 466,295,659.49 | 304,201,092.96 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | -31,842,489.91 | 2,680,799.00 |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.22 | 1,326,226.40 | 518,435.78 |
| 减：二、营业总支出 | | 27,216,915.75 | 13,758,761.28 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 22,665,577.98 | 11,426,938.24 |
| 其中：暂估管理人报酬 | | - | - |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 4,407,195.74 | 2,221,904.63 |
| 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 | | 2,543.11 | - |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.24 | 141,598.92 | 109,918.41 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 460,399,894.18 | 340,732,808.60 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 460,399,894.18 | 340,732,808.60 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 460,399,894.18 | 340,732,808.60 |

6.3 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | | | |
|--|--|--------|------------------|-------------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 401,200,270.43 | - | 1,089,627,192.26 | 1,490,827,462.69 |
| 二、本期期初净资产 | 401,200,270.43 | - | 1,089,627,192.26 | 1,490,827,462.69 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 459,275,680.17 | - | 1,945,191,570.02 | 2,404,467,250.19 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 460,399,894.18 | 460,399,894.18 |
| （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） | 459,275,680.17 | - | 1,484,791,675.84 | 1,944,067,356.01 |
| 其中：1. 基金申购款 | 709,805,257.05 | - | 2,279,849,840.27 | 2,989,655,097.32 |
| 2. 基金赎回款 | -250,529,576.88 | - | -795,058,164.43 | -1,045,587,741.31 |
| （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 | 860,475,950.60 | - | 3,034,818,762.28 | 3,895,294,712.88 |
| 项目 | 上年度可比期间 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 | -80,245,317.53 | - | 183,222,160.98 | 102,976,843.45 |

| | | | | |
|--|-----------------|---|-----------------|------------------|
| 动额(减少以“-”号填列) | | | | |
| (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净资产变动数(净资产减少以“-”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净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 393,866,038.32 | - | 978,178,621.31 | 1,372,044,659.63 |

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

梁凯

李袁

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

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 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 272,228,370.38 |
| 等于：本金 | 272,220,521.35 |
| 加：应计利息 | 7,849.03 |
| 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 | 272,228,370.38 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2024年6月30日 | | | |
|---------------|-------|-------------------|------|------------------|----------------|
| | | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 2,695,441,583.26 | - | 3,620,256,165.87 | 924,814,582.61 |
| 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 | | 13,808,106.57 | - | 16,523,970.72 | 2,715,864.15 |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 2,709,249,689.83 | - | 3,636,780,136.59 | 927,530,446.76 |

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 2024年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 312,693.10 |
| 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 | 108,901.52 |
| 合计 | 421,594.62 |

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 2024年1月1日至2024年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|-----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 373,719,810.71 | 373,719,810.71 |
| 本期申购 | 705,345,928.57 | 705,345,928.57 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -246,316,547.39 | -246,316,547.39 |
| 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 | 832,749,191.89 | 832,749,191.89 |

嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|---------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 4,460,681.52 | 27,480,459.72 |
| 本期申购 | 723,887.05 | 4,459,328.48 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -683,598.19 | -4,213,029.49 |
| 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 | 4,500,970.38 | 27,726,758.71 |

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 | 300,978,556.95 | 714,922,143.80 | 1,015,900,700.75 |
| 本期期初 | 300,978,556.95 | 714,922,143.80 | 1,015,900,700.75 |
| 本期利润 | -5,775,036.11 | 444,567,290.56 | 438,792,254.45 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 372,331,330.82 | 1,111,147,663.60 | 1,483,478,994.42 |
| 其中：基金申购款 | 571,871,595.92 | 1,694,015,604.38 | 2,265,887,200.30 |
| 基金赎回款 | -199,540,265.10 | -582,867,940.78 | -782,408,205.88 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 667,534,851.66 | 2,270,637,097.96 | 2,938,171,949.62 |

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 | 25,302,250.25 | 48,424,241.26 | 73,726,491.51 |
| 本期期初 | 25,302,250.25 | 48,424,241.26 | 73,726,491.51 |
| 本期利润 | -120,729.20 | 21,728,368.93 | 21,607,639.73 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 242,330.91 | 1,070,350.51 | 1,312,681.42 |
| 其中：基金申购款 | 4,136,211.33 | 9,826,428.64 | 13,962,639.97 |
| 基金赎回款 | -3,893,880.42 | -8,756,078.13 | -12,649,958.55 |

| | | | |
|---------|---------------|---------------|---------------|
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 25,423,851.96 | 71,222,960.70 | 96,646,812.66 |

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | | |
|-----------|----------------------|--|------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 | | |
| 活期存款利息收入 | | | 140,778.08 |
| 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 | | | 5,979.22 |
| 合计 | | | 146,757.30 |

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 | | |
|------------------|----------------------|--|---------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 | | |
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | | | 43,862,349.02 |
| 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 | | | 43,862,349.02 |

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 | | |
|------------|----------------------|--|----------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 | | |
| 卖出股票成交总额 | | | 979,361,054.95 |
| 减：卖出股票成本总额 | | | 934,386,336.81 |
| 减：交易费用 | | | 1,112,369.12 |
| 买卖股票差价收入 | | | 43,862,349.02 |

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 | | |
|----------------|----------------------|--|---------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 | | |
| 卖出/赎回基金成交总额 | | | 39,873,539.15 |
| 减：卖出/赎回基金成本总额 | | | 39,863,905.99 |
| 减：买卖基金差价收入应缴纳增 | | | 27,291.82 |

| | |
|--------|------------|
| 值税额 | |
| 减：交易费用 | 31,523.28 |
| 基金投资收益 | -49,181.94 |

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 |
|---------------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 7,748,741.32 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | - |
| 基金投资产生的股利收益 | 128,748.25 |
| 合计 | 7,877,489.57 |

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|------------------------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 1. 交易性金融资产 | 466,295,659.49 |
| 股票投资 | 467,737,185.84 |
| 债券投资 | - |
| 资产支持证券投资 | - |
| 基金投资 | -1,441,526.35 |
| 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 | 466,295,659.49 |

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 基金赎回费收入 | 1,326,226.40 |
| 合计 | 1,326,226.40 |

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用 | 49,229.18 |
| 信息披露费 | 59,672.34 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行划款手续费 | 32,697.40 |
| 合计 | 141,598.92 |

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 2024年1月1日至2024年6月30日 | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 22,665,577.98 | 11,426,938.24 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 8,333,201.46 | 4,372,419.95 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 14,332,376.52 | 7,054,518.29 |

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 2024年1月1日至2024年6月30日 | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 4,407,195.74 | 2,221,904.63 |

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 2024年1月1日至2024年6月30日 | | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023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 | 272,228,370.38 | 140,778.08 | 141,109,942.75 | 71,026.52 |

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（2024年1月1日至2024年6月30日），本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2024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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金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 2024年6月30日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|-------------------|----------------|------|------|------------------|------------------|
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 272,228,370.38 | - | - | - | 272,228,370.38 |
| 结算备付金 | - | - | - | - | - |
| 存出保证金 | - | - | - | - | - |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 3,636,780,136.59 | 3,636,780,136.59 |
| 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 | - | - | - | 569,924.31 | 569,924.31 |
| 应收申购款 | - | - | - | 96,282,838.97 | 96,282,838.97 |
| 递延所得税资产 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |

| | | | | | |
|--------------------------|----------------|-------|-------|------------------|------------------|
| 资产总计 | 272,228,370.38 | - | - | 3,733,632,899.87 | 4,005,861,270.25 |
| 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 | - | - | - | 13,756,560.86 | 13,756,560.86 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 90,210,962.10 | 90,210,962.10 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 5,171,810.05 | 5,171,810.05 |
| 应付托管费 | - | - | - | 1,005,629.74 | 1,005,629.74 |
| 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 | - | - | - | 421,594.62 | 421,594.62 |
| 负债总计 | - | - | - | 110,566,557.37 | 110,566,557.37 |
| 利率敏感度缺口 | 272,228,370.38 | - | - | 3,623,066,342.50 | 3,895,294,712.88 |
| 上年度末 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 |

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 | | |
|----|--------------------|-----------------------------|-------------------|
| 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（2024年6月30日） | 上年度末（2023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 | - | - |

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 2024年6月30日 | | | |
|----------|-------------------|---------|-----------|----|
| | 美元折合人民币 | 港币折合人民币 | 其他币种折合人民币 | 合计 |
| 以外币计价的资产 | | | | |

| | | | | |
|----------|------------------|---|---|------------------|
| 货币资金 | 134,084,938.15 | - | - | 134,084,938.15 |
| 结算备付金 | - | - | - | - |
| 存出保证金 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产 | 3,636,780,136.59 | - | - | 3,636,780,136.59 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - |
| 债权投资 | - | - | - | - |
| 应收股利 | 569,924.31 | - | - | 569,924.31 |
| 应收申购款 | 289,557.04 | - | - | 289,557.04 |
| 应收清算款 | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - |
| 资产合计 | 3,771,724,556.09 | - | - | 3,771,724,556.09 |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 应付清算款 | 13,756,560.86 | - | - | 13,756,560.86 |
| 衍生金融负债 | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | 812,958.71 | - | - | 812,958.71 |
| 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 | 2,492.53 | - | - | 2,492.53 |
| 负债合计 | 14,572,012.10 | - | - | 14,572,012.10 |

| | | | | |
|-----------------------|--------------------------|-------------|---------------|------------------|
| | 2.10 | | | |
| 资产负债表外 汇风险敞口净 额 | 3,757,152 ,543.99 | - | - | 3,757,152,543.99 |
| 项目 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 | | | |
| | 美元 折合人民 币 | 港币 折合人民币 | 其他币种 折合人民币 | 合计 |
| 以外币计价的 资产 | | | | |
| 货币资金 | 56,639,34 2.05 | - | - | 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 | 699,842.8 0 | - | - | 699,842.80 |
| 应收申购款 | 133,266.8 1 | - | - | 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 | 437,202.6 | - | - | 437,202.61 |

| | | | | |
|---------------|------------------|---|---|------------------|
| | 1 | | | |
| 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 |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | 1,445,228,072.95 | - | - | 1,445,228,072.95 |

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 | | |
|---------------|------------------|-----------------------------|-------------------|
| 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（2024年6月30日） | 上年度末（2023年12月31日） |
| | 所有外币相对人民币升值5% | 187,857,627.20 | 72,261,403.65 |
| 所有外币相对人民币贬值5% | -187,857,627.20 | -72,261,403.65 | |

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 2024年6月30日 | | 上年度末 2023年12月31日 | |
|---------------|-------------------|------------------|---------------------|------------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值 比例（%） | 公允价值 | 占基金资产净值 比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资 | 3,620,256,165.87 | 92.94 | 1,339,895,575.80 | 89.88 |
| 交易性金融资产—基金投资 | 16,523,970.72 | 0.42 | 51,283,664.52 | 3.44 |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 3,636,780,136.59 | 93.36 | 1,391,179,240.32 | 93.32 |

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 | | |
|----|--------------------|-----------------------------|-------------------|
| 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（2024年6月30日） | 上年度末（2023年12月31日） |
| | 业绩比较基准上升5% | 214,128,181.08 | 76,281,452.50 |
| | 业绩比较基准下降5% | -214,128,181.08 | -76,281,452.50 |

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 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次 | 3,636,780,136.59 | 1,391,179,240.32 |
| 第二层次 | - | - |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 3,636,780,136.59 | 1,391,179,240.32 |

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 | 3,620,256,165.87 | 90.37 |
| | 其中：普通股 | 3,509,401,102.14 | 87.61 |
| | 存托凭证 | 98,780,764.03 | 2.47 |
| | 优先股 | - | - |
| | 房地产信托凭证 | 12,074,299.70 | 0.30 |
| 2 | 基金投资 | 16,523,970.72 | 0.41 |

| | | | |
|---|-------------------|------------------|--------|
| 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 | 272,228,370.38 | 6.80 |
| 8 | 其他各项资产 | 96,852,763.28 | 2.42 |
| 9 | 合计 | 4,005,861,270.25 | 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 | 3,620,256,165.87 | 92.94 |
| 合计 | 3,620,256,165.87 | 92.94 |

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 | 1,646,884,003.25 | 42.28 |
| 非必需消费品 | 458,911,114.44 | 11.78 |
| 通信服务 | 498,842,296.15 | 12.81 |
| 医疗保健 | 314,885,525.76 | 8.08 |
| 工业 | 247,972,644.77 | 6.37 |
| 金融 | 205,726,568.69 | 5.28 |
| 必需消费品 | 108,620,404.89 | 2.79 |
| 能源 | 47,601,176.04 | 1.22 |
| 原材料 | 27,458,450.91 | 0.70 |
| 公用事业 | 51,279,681.27 | 1.32 |
| 房地产 | - | - |
| 房地产信托数据中心类 | 978,517.84 | 0.03 |
| 房地产信托特殊类 | 4,807,454.00 | 0.12 |
| 房地产信托工业类 | 4,882.86 | 0.00 |
| 房地产信托零售类 | 3,395,921.63 | 0.09 |
| 房地产信托医疗保健类 | 2,887,523.37 | 0.07 |
| 合计 | 3,620,256,165.87 | 92.94 |

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 | NVIDIA Corp | 英伟达 | NVDA UW | 纳斯达克 证券 交易所 | 美国 | 389,335 | 342,788,004.24 | 8.80 |
| 2 | Microsoft Corp | 微软 | MSFT UW | 纳斯达克 证券 交易所 | 美国 | 99,037 | 315,464,859.70 | 8.10 |
| 3 | Apple Inc | 苹果公 司 | AAPL UW | 纳斯达克 证券 交易所 | 美国 | 190,693 | 286,239,082.34 | 7.35 |
| 4 | Alphabet Inc | Alphab et 公司 | GOOGL UW | 纳斯达克 证券 交易所 | 美国 | 178,150 | 231,264,820.35 | 5.94 |
| 4 | Alphabet Inc | Alphab et 公司 | GOOG UW | 纳斯达克 证券 交易所 | 美国 | 31,193 | 40,775,416.48 | 1.05 |
| 5 | Amazon.com Inc | 亚马逊 公司 | AMZN UW | 纳斯达克 证券 交易所 | 美国 | 168,672 | 232,304,203.56 | 5.96 |
| 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 | 42,519 | 152,790,967.61 | 3.92 |
| 7 | Eli Lilly & Co | 礼来 | LLY UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 17,120 | 110,466,152.59 | 2.84 |
| 8 | Broadcom Inc | 博通股 份有限 公司 | AVGO UW | 纳斯达克 证券 交易所 | 美国 | 8,779 | 100,451,874.48 | 2.58 |
| 9 | Tesla Inc | 特斯拉 公司 | TSLA UW | 纳斯达克 证券 交易所 | 美国 | 40,792 | 57,526,966.30 | 1.48 |
| 10 | Costco Wholesale Corp | 开市客 | COST UW | 纳斯达克 证券 交易所 | 美国 | 9,251 | 56,039,863.48 | 1.44 |
| 11 | Taiwan Semiconductor | 台湾集 成电路 制造股 | TSM UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 36,624 | 45,366,482.37 | 1.16 |

| | | | | | | | | |
|----|--------------------------|-----------------------------|---------|-----------|----|--------|---------------|------|
| | Manufacturing Co Ltd | 份有限公司 | | | | | | |
| 12 | Netflix Inc | 奈飞公司 | NFLX UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 9,410 | 45,259,604.32 | 1.16 |
| 13 | QUALCOMM Inc | 高通公司 | QCOM UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 28,522 | 40,487,436.04 | 1.04 |
| 14 | Vertiv Holdings Co | 维谛技术 | VRT UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 59,445 | 36,675,607.83 | 0.94 |
| 15 | Applied Materials Inc | 应用材料 | AMAT UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 18,271 | 30,729,145.88 | 0.79 |
| 16 | Dell Technologies Inc | 戴尔科技公司 | DELL UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 28,602 | 28,111,675.57 | 0.72 |
| 17 | AbbVie Inc | 艾伯维公司 | ABBV UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 19,254 | 23,535,872.72 | 0.60 |
| 18 | Lam Research Corp | 泛林集团 | LRCX UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 3,074 | 23,328,502.94 | 0.60 |
| 19 | Adobe Inc | 奥多比 | ADBE UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 5,446 | 21,561,925.58 | 0.55 |
| 20 | Intuitive Surgical Inc | 直觉外科手术公司 | ISRG UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 6,553 | 20,775,349.29 | 0.53 |
| 21 | KLA Corp | KLA 公司 | KLAC UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 3,525 | 20,713,315.48 | 0.53 |
| 22 | 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 | 3,508 | 20,484,417.28 | 0.53 |
| 23 | Novo Nordisk A/S | 诺和诺德公司 | NVO UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 19,716 | 20,056,681.28 | 0.51 |
| 24 | Progressive | 前进保险公司 | PGR UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 13,450 | 19,910,137.60 | 0.51 |

| | Corp/The | | | 所 | | | | |
|----|----------------------------|-------------------------------|---------|-----------|----|--------|---------------|------|
| 25 | Arista Networks Inc | Arista 网络股份有限公司 | ANET UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 7,826 | 19,547,789.56 | 0.50 |
| 26 | General Electric Co | 通用电气 | GE UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 16,066 | 18,201,932.86 | 0.47 |
| 27 | NRG Energy Inc | NRG 能源股份有限公司 | NRG UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 32,741 | 18,167,740.19 | 0.47 |
| 28 | 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 | 619 | 17,476,114.47 | 0.45 |
| 29 | Constellation Energy Corp | 美国联合能源公司 | CEG UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 11,956 | 17,064,610.33 | 0.44 |
| 30 | ASML Holding NV | 阿斯麦控股公司 | ASML UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 2,330 | 16,982,885.74 | 0.44 |
| 31 | Visa Inc | 维萨公司 | V UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 8,827 | 16,511,531.95 | 0.42 |
| 32 | Micron Technology Inc | 美光科技股份有限公司 | MU UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 17,542 | 16,443,660.37 | 0.42 |
| 33 | Chipotle Mexican Grill Inc | Chipotle Mexican Grill 股份有限公司 | CMG UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 36,450 | 16,274,707.03 | 0.42 |
| 34 | 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 | 17,584 | 16,140,913.47 | 0.41 |
| 35 | Oracle Corp | 甲骨文 | ORCL UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 15,505 | 15,602,746.00 | 0.40 |
| 36 | TJX Cos | TJX 公 | TJX UN | 纽约证 | 美国 | 19,639 | 15,409,951.09 | 0.40 |

| | Inc/The | 司 | | 券交易 所 | | | | |
|----|--------------------------------------|-------------------------------|---------|-------------------|----|--------|---------------|------|
| 37 | Uber Technolog ies Inc | 优步技 术股份 有限公 司 | UBER UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 29,709 | 15,388,543.76 | 0.40 |
| 38 | Mastercar d Inc | 万事达 股份有 限公司 | MA UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 4,709 | 14,805,374.25 | 0.38 |
| 39 | Vistra Corp | Vistra 公司 | VST UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 22,800 | 13,970,979.62 | 0.36 |
| 40 | Vertex Pharmaceu ticals Inc | 福泰制 药 | VRTX UW | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 4,155 | 13,879,668.21 | 0.36 |
| 41 | Salesforc e Inc | Salesf orce 股 份有限 公司 | CRM UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 7,388 | 13,537,034.47 | 0.35 |
| 42 | EMCOR Group Inc | 埃姆科 集团公 司 | EME UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 5,090 | 13,243,427.41 | 0.34 |
| 43 | Home Depot Inc/The | 家得宝 | HD UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 5,203 | 12,764,674.08 | 0.33 |
| 44 | ServiceNo w Inc | Servic eNow 公 司 | NOW UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 2,219 | 12,440,689.82 | 0.32 |
| 45 | Autodesk Inc | 欧特克 | ADSK UW | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 6,803 | 11,997,271.87 | 0.31 |
| 46 | Synopsys Inc | 新思科 技公司 | SNPS UW | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 2,819 | 11,955,022.70 | 0.31 |
| 47 | Eaton Corp PLC | 伊顿 | ETN UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 5,325 | 11,899,288.35 | 0.31 |
| 48 | Walmart Inc | 沃尔玛 股份有 限公司 | WMT UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 23,615 | 11,395,551.16 | 0.29 |
| 49 | Hewlett Packard Enterpris | 慧与 | HPE UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 75,120 | 11,333,681.62 | 0.29 |

| | | | | | | | | |
|----|----------------------------|---------------------------|---------|-----------|----|--------|---------------|------|
| | e Co | | | | | | | |
| 50 | 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 | 4,423 | 10,686,217.76 | 0.27 |
| 51 | 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 | 3,891 | 10,626,003.85 | 0.27 |
| 52 | Cirrus Logic Inc | Cirrus Logic 股份有限公司 | CRUS UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 11,679 | 10,625,639.32 | 0.27 |
| 53 | Amphenol Corp | 安费诺公司 | APH UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 22,102 | 10,611,888.87 | 0.27 |
| 54 | UnitedHealth Group Inc | 联合健康集团 | UNH UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 2,764 | 10,031,645.48 | 0.26 |
| 55 | Caterpillar Inc | 卡特彼勒 | CAT UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 4,097 | 9,726,020.22 | 0.25 |
| 56 | Merck & Co Inc | 默克 | MRK UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 10,896 | 9,613,517.26 | 0.25 |
| 57 | DaVita Inc | DaVita 股份有限公司 | DVA UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 9,701 | 9,580,326.12 | 0.25 |
| 58 | GoDaddy Inc | GoDaddy 股份有限公司 | GDDY UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 9,264 | 9,224,027.95 | 0.24 |
| 59 | JPMorgan Chase & Co | 摩根大通 | JPM UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 6,326 | 9,118,717.51 | 0.23 |
| 60 | Advanced Micro Devices Inc | AMD 公司 | AMD UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 7,799 | 9,015,942.14 | 0.23 |
| 61 | Spotify Technology | Spotify 科技 | SPOT UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 4,025 | 9,001,182.25 | 0.23 |

| | | | | | | | | |
|----|--|--------------------------------------|---------|-------------------|----|--------|--------------|------|
| | y SA | 股份有 限公司 | | 所 | | | | |
| 62 | 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 | 3,635 | 8,521,233.61 | 0.22 |
| 63 | Celestica Inc | 天弘股 份有限 公司 | CLS UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 20,821 | 8,507,032.60 | 0.22 |
| 64 | Goldman Sachs Group Inc/The | 高盛 | GS UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 2,617 | 8,436,145.96 | 0.22 |
| 65 | Cadence Design Systems Inc | Cadenc e 设计 系统股 份有限 公司 | CDNS UW | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 3,742 | 8,207,226.44 | 0.21 |
| 66 | Universal Health Services Inc | Univer sal 保 健服务 股份有 限公司 | UHS UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 6,055 | 7,980,242.50 | 0.20 |
| 67 | Monolithi c Power Systems Inc | 芯源系 统有限 公司 | MPWR UW | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 1,362 | 7,975,802.57 | 0.20 |
| 68 | 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 | 2,892 | 7,956,762.90 | 0.20 |
| 69 | SkyWest Inc | SkyWes t 股份 有限公 司 | SKYW UW | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 13,451 | 7,867,442.50 | 0.20 |
| 70 | 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 | 9,279 | 7,807,919.18 | 0.20 |
| 71 | AppLovin Corp | AppLov in 公司 | APP UW | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 13,130 | 7,787,301.85 | 0.20 |
| 72 | McKesson | McKess | MCK UN | 纽约证 | 美国 | 1,859 | 7,737,783.13 | 0.20 |

| | | | | | | | | |
|----|--------------------------------|--|-------------|-------------------|----|--------|--------------|------|
| | Corp | on 公司 | | 券交易 所 | | | | |
| 73 | American Express Co | 美国运通 | AXP UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 4,560 | 7,524,960.06 | 0.19 |
| 74 | Berkshire Hathaway Inc | 伯克希 尔哈撒 韦公司 | BRK/B UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 2,591 | 7,511,781.18 | 0.19 |
| 75 | GE Vernova Inc | 通用电 气 Vernov a 股份 有限公 司 | GEV UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 6,139 | 7,503,806.94 | 0.19 |
| 76 | Boston Scientific Corp | 波士顿 科学 | BSX UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 13,526 | 7,423,540.42 | 0.19 |
| 77 | Wingstop Inc | Wingst op 股份 有限公 司 | WING UW | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 2,431 | 7,322,690.50 | 0.19 |
| 78 | 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 | 12,795 | 7,078,878.33 | 0.18 |
| 79 | Ecolab Inc | 艺康集 团 | ECL UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 4,155 | 7,047,621.25 | 0.18 |
| 80 | SAP SE | SAP 公 司 | SAP UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 4,713 | 6,775,158.20 | 0.17 |
| 81 | 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 | 7,670 | 6,693,429.98 | 0.17 |
| 82 | Wells Fargo & Co | 富国银 行 | WFC UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 15,675 | 6,634,610.72 | 0.17 |
| 83 | NU Holdings Ltd/Cayman Islands | NU 控股 有限公 司/开 曼群岛 | NU UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 72,103 | 6,623,702.58 | 0.17 |
| 84 | Diamondba | Diamon | FANG UW | 纳斯达 | 美国 | 4,640 | 6,619,953.39 | 0.17 |

| | | | | | | | | |
|----|-----------------------------|-------------------------------|---------|-----------|----|--------|--------------|------|
| | ock Energy Inc | dback 能源股份有限公司 | | 克证券交易所 | | | | |
| 85 | KKR & Co Inc | KKR & Co 有限公司 | KKR UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 8,775 | 6,581,464.39 | 0.17 |
| 86 | Pure Storage Inc | Pure 储存股份有限公司 | PSTG UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 14,265 | 6,527,832.73 | 0.17 |
| 87 | Palantir Technologies Inc | Palantir 科技股份有限公司 | PLTR UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 35,992 | 6,497,342.21 | 0.17 |
| 88 | LPL Financial Holdings Inc | LPL 金融控股公司 | LPLA UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 3,203 | 6,375,620.31 | 0.16 |
| 89 | Crocs Inc | 卡骆驰股份有限公司 | CROX UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 6,120 | 6,365,321.38 | 0.16 |
| 90 | 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 | 8,933 | 6,218,034.01 | 0.16 |
| 91 | 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 | 5,469 | 6,214,018.48 | 0.16 |
| 92 | 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 | 10,416 | 6,210,311.76 | 0.16 |
| 93 | Amgen Inc | 安进公司 | AMGN UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 2,677 | 5,961,059.70 | 0.15 |
| 94 | Arch Capital Group Ltd | 阿契资本集团 | ACGL UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 8,290 | 5,960,699.44 | 0.15 |
| 95 | ARM | ARM | ARM UW | 纳斯达克 | 美国 | 5,082 | 5,926,054.22 | 0.15 |

| | | | | | | | | |
|-----|---------------------------------|-----------------------------|---------|-----------|----|--------|--------------|------|
| | Holdings PLC | Holdings PLC | | 克证券交易所 | | | | |
| 96 | Verisk Analytics Inc | Verisk 分析公司 | VRSK UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 3,011 | 5,784,218.14 | 0.15 |
| 97 | Intuit Inc | Intuit 股份有限公司 | INTU UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,205 | 5,643,984.09 | 0.14 |
| 98 | DuPont de Nemours Inc | 杜邦公司 | DD UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 9,828 | 5,637,695.91 | 0.14 |
| 99 | 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 | 3,617 | 5,624,680.09 | 0.14 |
| 100 | NXP Semiconductors NV | 恩智浦半导体公司 | NXPI UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 2,915 | 5,590,243.03 | 0.14 |
| 101 | Targa Resources Corp | Targa 资源公司 | TRGP UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 6,058 | 5,559,967.60 | 0.14 |
| 102 | Seagate Technology Holdings PLC | Seagate Technology 控股公共有限公司 | STX UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 7,508 | 5,525,772.65 | 0.14 |
| 103 | Leidos Holdings Inc | Leidos 控股公司 | LDOS UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 5,177 | 5,382,307.31 | 0.14 |
| 104 | Amkor Technology Inc | 安靠技术公司 | AMKR UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 18,792 | 5,359,751.56 | 0.14 |
| 105 | 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 | 3,494 | 5,349,988.27 | 0.14 |
| 106 | FTAI Aviation Ltd | FTAI Aviation Ltd | FTAI UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 7,268 | 5,347,064.43 | 0.14 |
| 107 | Murphy USA Inc | Murphy 美国股 | MUSA UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,561 | 5,222,711.89 | 0.13 |

| | | | | | | | | |
|-----|----------------------------------|--------------------------|---------|-----------|----|--------|--------------|------|
| | | 份有限公司 | | 所 | | | | |
| 108 | Western Digital Corp | 西部数据公司 | WDC UN | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 9,406 | 5,079,217.76 | 0.13 |
| 109 | 3M Co | 3M 公司 | MMM UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 6,904 | 5,028,098.23 | 0.13 |
| 110 | Corebridge Financial Inc | Corebridge Financial Inc | CRBG UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 24,202 | 5,022,699.53 | 0.13 |
| 111 | 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 | 4,537 | 4,976,247.48 | 0.13 |
| 112 | Onto Innovation Inc | Onto 创新股份有限公司 | ONTO UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 3,147 | 4,924,300.37 | 0.13 |
| 113 | Domino's Pizza Inc | 达美乐披萨公司 | DPZ UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,333 | 4,905,147.60 | 0.13 |
| 114 | Tenet Healthcare Corp | Tenet 医疗保健公司 | THC UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 5,133 | 4,866,485.42 | 0.12 |
| 115 | Freshpet Inc | Freshpet 公司 | FRPT UQ | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 5,258 | 4,848,594.52 | 0.12 |
| 116 | Teradyne Inc | 泰瑞达 | TER UN | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 4,454 | 4,707,134.95 | 0.12 |
| 117 | Valero Energy Corp | Valero 能源 | VLO UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 4,179 | 4,668,766.97 | 0.12 |
| 118 | BJ's Wholesale Club Holdings Inc | BJ's 批发俱乐部控股有限公司 | BJ UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 7,391 | 4,626,899.87 | 0.12 |
| 119 | Cintas Corp | Cintas 公司 | CTAS UN | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 925 | 4,616,317.00 | 0.12 |

| | | | | | | | | |
|-----|---------------------------------|--------------------|----------|-----------|----|--------|--------------|------|
| 120 | Blackstone Inc | 黑石集团股份有限公司 | BX UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 5,165 | 4,557,068.34 | 0.12 |
| 121 | Southern Copper Corp | 南方铜业公司 | SCCO UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 5,927 | 4,550,996.17 | 0.12 |
| 122 | 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 | 586 | 4,531,290.71 | 0.12 |
| 123 | Deckers Outdoor Corp | 德克斯户外用品公司 | DECK UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 652 | 4,497,747.71 | 0.12 |
| 124 | Fair Isaac Corp | 费埃哲公司 | FICO UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 401 | 4,254,362.22 | 0.11 |
| 125 | Kimberly-Clark Corp | 金佰利 | KMB UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 4,263 | 4,198,729.99 | 0.11 |
| 126 | T-Mobile US Inc | T-Mobile US 股份有限公司 | TMUS UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 3,285 | 4,124,644.76 | 0.11 |
| 127 | CommVault Systems Inc | CommVault 系统公司 | CVLT UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 4,616 | 3,999,325.83 | 0.10 |
| 128 | Medpace Holdings Inc | Medpace 控股股份有限公司 | MEDP UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,350 | 3,962,482.98 | 0.10 |
| 129 | Copart Inc | Copart 股份有限公司 | CPRT UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 10,156 | 3,920,088.93 | 0.10 |
| 130 | Charles Schwab Corp/The | 嘉信理财 | SCHW UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 7,414 | 3,893,639.24 | 0.10 |
| 131 | HEICO Corp | 海科航空公司 | HEI/A UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 3,049 | 3,857,440.94 | 0.10 |
| 132 | International Business Machines | 国际商业机器 | IBM UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 3,043 | 3,750,741.12 | 0.10 |

| | Corp | | | | | | | |
|-----|-------------------------------|------------------|---------|-----------|----|--------|--------------|------|
| 133 | Comfort Systems USA Inc | 美国舒适系统公司 | FIX UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,727 | 3,743,103.97 | 0.10 |
| 134 | Pinterest Inc | Pinterest 股份有限公司 | PINS UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 11,903 | 3,738,471.34 | 0.10 |
| 135 | WW Grainger Inc | 固安捷股份有限公司 | GWW UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 581 | 3,735,878.82 | 0.10 |
| 136 | HCA Healthcare Inc | HCA 医疗保健有限公司 | HCA UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,630 | 3,732,208.24 | 0.10 |
| 137 | Gilead Sciences Inc | 吉利德科学 | GILD UN | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 7,602 | 3,717,148.02 | 0.10 |
| 138 | Iron Mountain Inc | 美国铁山公司 | IRM UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 5,709 | 3,646,360.09 | 0.09 |
| 139 | Marriott International Inc/MD | 万豪国际 | MAR UN | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 2,043 | 3,520,183.87 | 0.09 |
| 140 | HubSpot Inc | HubSpot 公司 | HUBS UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 820 | 3,446,718.61 | 0.09 |
| 141 | Simon Property Group Inc | 西蒙房地产集团公司 | SPG UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 3,139 | 3,395,921.63 | 0.09 |
| 142 | Dycom Industries Inc | 戴康工业公司 | DY UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 2,809 | 3,378,437.02 | 0.09 |
| 143 | Waste Management Inc | 废品管理 | WM UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 2,213 | 3,364,714.94 | 0.09 |
| 144 | Fabrinet | Fabrinet 公司 | FN UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,910 | 3,332,127.50 | 0.09 |
| 145 | Manhattan Associates Inc | 曼哈顿联合软件公司 | MANH UN | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,876 | 3,298,081.21 | 0.08 |
| 14 | Corning | 康宁公 | GLW UN | 纽约证 | 美国 | 11,815 | 3,271,292.07 | 0.08 |

| | | | | | | | | |
|-----|-------------------------|------------------------|----------|-----------|----|--------|--------------|------|
| 6 | Inc | 司 | | 券交易所 | | | | |
| 147 | Ralph Lauren Corp | 拉夫劳伦 | RL UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 2,602 | 3,246,301.02 | 0.08 |
| 148 | Manulife Financial Corp | 宏利金融 | MFC UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 16,608 | 3,150,793.63 | 0.08 |
| 149 | Texas Roadhouse Inc | Texas Roadhouse 股份有限公司 | TXRH UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 2,572 | 3,147,466.55 | 0.08 |
| 150 | Natera Inc | Natera 股份有限公司 | NTRA UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 4,054 | 3,128,719.79 | 0.08 |
| 151 | Lowe's Cos Inc | 劳氏 | LOW UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,991 | 3,128,208.09 | 0.08 |
| 152 | Allstate Corp/The | 好事达保险公司 | ALL UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 2,737 | 3,114,336.20 | 0.08 |
| 153 | Brink's Co/The | Brink's 公司 | BCO UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 4,263 | 3,111,070.56 | 0.08 |
| 154 | Hims & Hers Health Inc | Hims & Hers Health Inc | HIMS UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 21,539 | 3,099,248.69 | 0.08 |
| 155 | Tencent Holdings Ltd | 腾讯控股有限公司 | TCEHY UV | 纽约证券交易所 | 美国 | 9,144 | 3,086,330.87 | 0.08 |
| 156 | Pennant Group Inc/The | Pennant Group Inc/The | PNTG UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 18,449 | 3,049,075.31 | 0.08 |
| 157 | MasTec Inc | MasTec 股份有限公司 | MTZ UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 3,894 | 2,969,160.72 | 0.08 |
| 158 | Pilgrim's Pride Corp | Pilgrim's Pride 公司 | PPC UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 10,793 | 2,960,633.57 | 0.08 |
| 15 | elf | elf | ELF UN | 纽约证 | 美国 | 1,963 | 2,947,953.50 | 0.08 |

| | | | | | | | | |
|-----|----------------------|----------------------|---------|-----------|----|--------|--------------|------|
| 9 | Beauty Inc | Beauty 股份有限公司 | | 券交易所 | | | | |
| 160 | Ross Stores Inc | 罗斯百货股份有限公司 | ROST UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 2,829 | 2,929,900.74 | 0.08 |
| 161 | Wix.com Ltd | Wix.com 有限公司 | WIX UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 2,568 | 2,911,239.08 | 0.07 |
| 162 | Blue Owl Capital Inc | 蓝猫头鹰资本公司 | OWL UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 22,899 | 2,896,739.53 | 0.07 |
| 163 | Chubb Ltd | 邱博保险集团 | CB UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,561 | 2,837,748.37 | 0.07 |
| 164 | Toll Brothers Inc | 托尔兄弟公司 | TOL UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 3,456 | 2,836,908.83 | 0.07 |
| 165 | TransDigm Group Inc | TransDigm 集团公司 | TDG UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 310 | 2,822,633.99 | 0.07 |
| 166 | Brown & Brown Inc | Brown & Brown 股份有限公司 | BRO UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 4,411 | 2,810,720.91 | 0.07 |
| 167 | Toast Inc | Toast 股份有限公司 | TOST UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 15,241 | 2,799,126.03 | 0.07 |
| 168 | Synchrony Financial | 同步金融公司 | SYF UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 8,138 | 2,736,920.83 | 0.07 |
| 169 | Quanta Services Inc | Quanta 服务股份有限公司 | PWR UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,509 | 2,732,570.56 | 0.07 |
| 170 | Tetra Tech Inc | Tetra 科技股份有限公司 | TTEK UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,873 | 2,729,500.54 | 0.07 |
| 171 | Tractor Supply Co | 拖拉机供应公司 | TSCO UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,410 | 2,713,172.76 | 0.07 |
| 17 | Bank of | 美国银 | BAC UN | 纽约证 | 美国 | 9,527 | 2,700,264.63 | 0.07 |

| | | | | | | | | |
|-----|-------------------------------|--------------------|---------|-----------|----|-------|--------------|------|
| 2 | America Corp | 行公司 | | 券交易所 | | | | |
| 173 | United Therapeutics Corp | 联合治疗公司 | UTHR UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,180 | 2,678,885.73 | 0.07 |
| 174 | RadNet Inc | RadNet 股份有限公司 | RDNT UQ | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 6,367 | 2,673,573.69 | 0.07 |
| 175 | Schlumberger NV | 斯伦贝谢公众有限公司 | SLB UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 7,944 | 2,671,109.82 | 0.07 |
| 176 | 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 | 348 | 2,619,162.29 | 0.07 |
| 177 | Skechers USA Inc | 斯凯奇美国公司 | SKX UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 5,235 | 2,578,784.12 | 0.07 |
| 178 | Coca-Cola Co/The | 可口可乐 | KO UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 5,638 | 2,557,514.18 | 0.07 |
| 179 | Welltower Inc | Welltower Inc | WELL UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 3,440 | 2,555,813.02 | 0.07 |
| 180 | Advanced Drainage Systems Inc | 先进排水系统公司 | WMS UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 2,228 | 2,546,754.28 | 0.07 |
| 181 | AutoZone Inc | AutoZone 股份有限公司 | AZO UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 118 | 2,492,696.65 | 0.06 |
| 182 | Citigroup Inc | 花旗集团 | C UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 5,428 | 2,454,903.80 | 0.06 |
| 183 | HealthEquity Inc | Health equity 有限公司 | HQY UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 3,988 | 2,449,948.68 | 0.06 |
| 184 | KB Home | KB 家居 | KBH UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 4,873 | 2,437,273.95 | 0.06 |
| 18 | Prudential | 保德信 | PRU UN | 纽约证 | 美国 | 2,918 | 2,437,083.52 | 0.06 |

| | | | | | | | | |
|---------|--|---|---------|-------------------|----|--------|--------------|------|
| 5 | 1 Financial Inc | 金融集 团 | | 券交易 所 | | | | |
| 18 6 | Emerson Electric Co | 艾默生 电气 | EMR UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 3,049 | 2,393,734.19 | 0.06 |
| 18 7 | Freeport- McMoRan Inc | 自由港 迈克墨 伦股份 有限公司 | FCX UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 6,834 | 2,367,041.19 | 0.06 |
| 18 8 | Zeta Global Holdings Corp | Zeta Global Holdin gs Corp | ZETA UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 18,399 | 2,314,373.78 | 0.06 |
| 18 9 | Encompass Health Corp | 南方保 健公司 | EHC UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 3,761 | 2,299,506.13 | 0.06 |
| 19 0 | Guidewire Software Inc | Guidew ire 软 件公司 | GWRE UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 2,303 | 2,263,191.38 | 0.06 |
| 19 1 | RTX Corp | RTX 公 司 | RTX UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 3,156 | 2,257,990.03 | 0.06 |
| 19 2 | Sterling Infrastru cture Inc | Sterli ng 基础 设施股 份有限 公司 | STRL UW | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 2,667 | 2,249,309.16 | 0.06 |
| 19 3 | Thermo Fisher Scientifi c Inc | Thermo Fisher Scienti fic 公 司 | TMO UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 568 | 2,238,556.39 | 0.06 |
| 19 4 | MicroStra tegy Inc | 微策略 公司 | MSTR UW | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 226 | 2,218,647.53 | 0.06 |
| 19 5 | Accenture PLC | 埃森哲 公司 | ACN UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 1,020 | 2,205,589.24 | 0.06 |
| 19 6 | Carlisle Cos Inc | 卡莱股 份有限 公司 | CSL UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 761 | 2,197,654.33 | 0.06 |
| 19 | Fiserv | Fiserv | FI UN | 纽约证 | 美国 | 2,066 | 2,194,460.31 | 0.06 |

| | | | | | | | | |
|-----|--|------------------------|---------|-----------|----|--------|--------------|------|
| 7 | Inc | 公司 | | 券交易所 | | | | |
| 198 | Marathon Oil Corp | Marathon 石油公司 | MRO UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 10,704 | 2,187,098.61 | 0.06 |
| 199 | Hartford Financial Services Group Inc/The | 哈特福德金融服务 | HIG UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 3,046 | 2,182,545.73 | 0.06 |
| 200 | Williams-Sonoma Inc | Williams-Sonoma 股份有限公司 | WSM UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,083 | 2,179,423.26 | 0.06 |
| 201 | Flex Ltd | 伟创力国际有限公司 | FLEX UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 10,341 | 2,173,361.06 | 0.06 |
| 202 | PulteGroup Inc | Pulte 集团公司 | PHM UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 2,756 | 2,162,524.83 | 0.06 |
| 203 | Fidelity National Information Services Inc | 繁德信息技术有限公司 | FIS UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 3,978 | 2,136,486.93 | 0.05 |
| 204 | Crane Co | Crane Co | CR UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 2,048 | 2,116,082.61 | 0.05 |
| 205 | Kroger Co/The | 克罗格公司 | KR UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 5,946 | 2,115,831.32 | 0.05 |
| 206 | Pfizer Inc | 辉瑞制药 | PFE UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 10,445 | 2,082,815.14 | 0.05 |
| 207 | Edwards Lifesciences Corp | 爱德华生命科学公司 | EW UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 3,154 | 2,076,286.14 | 0.05 |
| 208 | Equitable Holdings Inc | Equitable 控股股份有限公司 | EQH UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 6,894 | 2,007,540.02 | 0.05 |

| | | | | | | | | |
|-----|--|-------------------|---------|-----------|----|--------|--------------|------|
| 209 | NVR Inc | NVR 股份有限公司 | NVR UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 36 | 1,946,957.38 | 0.05 |
| 210 | Allison Transmission Holdings Inc | 艾里逊变速箱控股公司 | ALSN UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 3,571 | 1,931,640.03 | 0.05 |
| 211 | Zscaler Inc | Zscaler 股份有限公司 | ZS UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,410 | 1,931,276.57 | 0.05 |
| 212 | Nova Ltd | Nova 有限公司 | NVMI UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,154 | 1,928,851.46 | 0.05 |
| 213 | Williams Cos Inc/The | 威廉姆斯公司 | WMB UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 6,140 | 1,859,738.46 | 0.05 |
| 214 | Westinghouse Air Brake Technologies Corp | 西屋制动公司 | WAB UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,648 | 1,856,291.94 | 0.05 |
| 215 | Smartsheet Inc | Smartsheet 股份有限公司 | SMAR UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 5,825 | 1,829,919.93 | 0.05 |
| 216 | Cigna Group/The | 信诺集团 | CI UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 775 | 1,825,827.36 | 0.05 |
| 217 | Packaging Corp of America | 美国包装公司 | PKG UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,401 | 1,822,797.12 | 0.05 |
| 218 | General Motors Co | 通用汽车公司 | GM UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 5,475 | 1,812,833.43 | 0.05 |
| 219 | Procter & Gamble Co/The | 宝洁 | PG UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,521 | 1,787,710.17 | 0.05 |
| 220 | ResMed Inc | 瑞思迈股份有限公司 | RMD UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,306 | 1,781,660.95 | 0.05 |
| 221 | Organon & Co | Organon & Co | OGN UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 11,897 | 1,755,102.07 | 0.05 |

| | | | | | | | | |
|---------|---|---------------------------------|---------|-------------------|----|--------|--------------|------|
| | | | | 所 | | | | |
| 22 2 | nVent Electric PLC | nVent Electr ic PLC | NVT UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 3,174 | 1,732,953.69 | 0.04 |
| 22 3 | Ovintiv Inc | Ovinti v 股份 有限公 司 | OVV UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 5,004 | 1,671,501.71 | 0.04 |
| 22 4 | Stifel Financial Corp | 斯迪富 融资公 司 | SF UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 2,767 | 1,659,425.85 | 0.04 |
| 22 5 | BGC Group Inc | BGC Group Inc | BGC UW | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 27,655 | 1,635,860.73 | 0.04 |
| 22 6 | Catalent Inc | 康泰伦 特股份 有限公 司 | CTLT UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 4,061 | 1,627,404.99 | 0.04 |
| 22 7 | Banco Latinoame ricano de Comercio Exterior SA | 拉美出 口银行 | BLX UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 7,687 | 1,625,432.72 | 0.04 |
| 22 8 | Western Union Co/The | 西联汇 款 | WU UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 18,589 | 1,618,906.64 | 0.04 |
| 22 9 | ONEOK Inc | Oneok 股份有 限公司 | OKE UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 2,763 | 1,605,829.46 | 0.04 |
| 23 0 | Mettler-T oledo Internati onal Inc | 梅特勒 -托利 多国际 股份有 限公司 | MTD UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 159 | 1,583,694.76 | 0.04 |
| 23 1 | HP Inc | 惠普 | HPQ UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 6,324 | 1,578,347.31 | 0.04 |
| 23 2 | H&R Block Inc | H&R Block 股份有 限公司 | HRB UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 4,043 | 1,562,564.37 | 0.04 |
| 23 3 | Lantheus Holdings | Lanthe us 控股 | LNTH UQ | 纳斯达 克证券 | 美国 | 2,721 | 1,556,985.51 | 0.04 |

| | | | | | | | | |
|---------|---|----------------------------|---------|-------------------|----|--------|--------------|------|
| | Inc | 股份有 限公司 | | 交易所 | | | | |
| 23 4 | Federal Signal Corp | 联邦信 号公司 | FSS UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 2,570 | 1,532,489.34 | 0.04 |
| 23 5 | Kinder Morgan Inc | 特拉华 州金德 摩根公 司 | KMI UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 10,784 | 1,527,117.02 | 0.04 |
| 23 6 | 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 | 1,692 | 1,519,256.16 | 0.04 |
| 23 7 | Entergy Corp | Enterg y 公司 | ETR UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 1,970 | 1,502,258.17 | 0.04 |
| 23 8 | Garmin Ltd | 佳明有 限公司 | GRMN UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 1,291 | 1,498,977.85 | 0.04 |
| 23 9 | DT Midstream Inc | DT Midstr eam Inc | DTM UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 2,901 | 1,468,534.37 | 0.04 |
| 24 0 | Cabot Corp | 卡博特 公司 | CBT UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 2,225 | 1,457,111.68 | 0.04 |
| 24 1 | Reinsuran ce Group of America Inc | RGA 美 国再保 险公司 | RGA UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 996 | 1,457,066.56 | 0.04 |
| 24 2 | Insulet Corp | Insule t 股份 有限公 司 | PODD UW | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 991 | 1,425,244.55 | 0.04 |
| 24 3 | Gap Inc/The | Gap 股 份有限 公司 | GPS UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 8,329 | 1,418,089.31 | 0.04 |
| 24 4 | Ensign Group Inc/The | Ensign 集团股 份有限 公司 | ENSG UW | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 1,608 | 1,417,474.34 | 0.04 |
| 24 5 | Interacti ve Brokers | 盈透证 券集团 股份有 | IBKR UW | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 1,609 | 1,405,856.80 | 0.04 |

| | | | | | | | | |
|---------|----------------------------------|-------------------------|----------|-----------|----|-------|--------------|------|
| | Group Inc | 限公司 | | | | | | |
| 24 6 | Marathon Petroleum Corp | 马拉松石油公司 | MPC UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,131 | 1,398,320.07 | 0.04 |
| 24 7 | Casey's General Stores Inc | 凯西杂货公司 | CASY UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 514 | 1,397,721.13 | 0.04 |
| 24 8 | Discover Financial Services | Discover 金融服务公司 | DFS UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,493 | 1,391,859.27 | 0.04 |
| 24 9 | CACI International Inc | CACI 国际公司 | CACI UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 450 | 1,379,452.72 | 0.04 |
| 25 0 | Vulcan Materials Co | Vulcan 材料 | VMC UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 777 | 1,377,071.37 | 0.04 |
| 25 1 | Capital One Financial Corp | 第一资本金融 | COF UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,373 | 1,354,746.60 | 0.03 |
| 25 2 | T Rowe Price Group Inc | 普徠仕 | TROW UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,644 | 1,351,024.91 | 0.03 |
| 25 3 | Tradeweb Markets Inc | Tradeweb Markets 股份有限公司 | TW UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,749 | 1,321,265.96 | 0.03 |
| 25 4 | American International Group Inc | 美国国际集团 | AIG UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 2,497 | 1,321,146.80 | 0.03 |
| 25 5 | Best Buy Co Inc | 百思买 | BBY UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 2,190 | 1,315,572.36 | 0.03 |
| 25 6 | Affirm Holdings Inc | Affirm 控股股份有限公司 | AFRM UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 6,109 | 1,315,271.54 | 0.03 |
| 25 7 | First Citizens | 第一公民银行 | FCNCA UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 109 | 1,307,863.94 | 0.03 |

| | | | | | | | | |
|---------|---|---|---------|-------------------|----|-------|--------------|------|
| | BancShare s Inc/NC | (北卡) | | 交易所 | | | | |
| 25 8 | Korn Ferry | 光辉国 际 | KFY UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 2,650 | 1,268,007.38 | 0.03 |
| 25 9 | Cloudflar e Inc | Cloudf lare 股 份有限 公司 | NET UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 2,148 | 1,267,991.99 | 0.03 |
| 26 0 | Regeneron Pharmaceu ticals 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 | 157 | 1,176,005.45 | 0.03 |
| 26 1 | Lamar Advertisi ng Co | 拉马尔 广告公 司 | LAMR UW | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 1,363 | 1,161,093.91 | 0.03 |
| 26 2 | Frontline PLC | Frontl ine 公 共有限 公司 | FRO UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 6,171 | 1,132,911.48 | 0.03 |
| 26 3 | Coherent Corp | 相干公 司 | COHR UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 2,154 | 1,112,342.68 | 0.03 |
| 26 4 | Westrock Co | WestRo ck 公司 | WRK UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 3,070 | 1,099,652.41 | 0.03 |
| 26 5 | Griffon Corp | Griffo n 公司 | GFF UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 2,398 | 1,091,371.64 | 0.03 |
| 26 6 | Fifth Third Bancorp | 五三银 行 | FITB UW | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 4,135 | 1,075,335.41 | 0.03 |
| 26 7 | Builders FirstSour ce Inc | Builde rs FirstS ource 股份有 限公司 | BLDR UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 1,075 | 1,060,401.92 | 0.03 |
| 26 8 | Incyte Corp | 因赛特 公司 | INCY UW | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 2,443 | 1,055,441.02 | 0.03 |
| 26 9 | Ares Managemen t Corp | 阿瑞斯 管理有 限合伙 | ARES UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 1,106 | 1,050,545.05 | 0.03 |

| | | 企业 | | | | | | |
|---------|--|--|---------|-------------------|----|-------|--------------|------|
| 27 0 | Texas Pacific Land Corp | 德克萨 斯州太 平洋土 地公司 | TPL UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 200 | 1,046,599.09 | 0.03 |
| 27 1 | FormFacto r Inc | Formfa ctor 股 份有限 公司 | FORM UW | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 2,416 | 1,042,226.65 | 0.03 |
| 27 2 | Halliburt on Co | 哈利伯 顿 | HAL UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 4,290 | 1,032,788.77 | 0.03 |
| 27 3 | Elevance Health Inc | Elevan ce 健康 股份有 限公司 | ELV UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 262 | 1,011,772.70 | 0.03 |
| 27 4 | FedEx Corp | 联邦快 递 | FDX UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 462 | 987,247.67 | 0.03 |
| 27 5 | Digital Realty Trust Inc | 数字房 地产信 托有限 公司 | DLR UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 903 | 978,517.84 | 0.03 |
| 27 6 | Macy's Inc | 梅西百 货股份 有限公司 | M UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 7,133 | 976,040.92 | 0.03 |
| 27 7 | Gartner Inc | Gartne r 公司 | IT UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 298 | 953,707.52 | 0.02 |
| 27 8 | Union Pacific Corp | 联合太 平洋 | UNP UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 586 | 944,930.72 | 0.02 |
| 27 9 | API Group Corp | API 集 团公司 | APG UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 3,492 | 936,489.74 | 0.02 |
| 28 0 | Barrett Business Services Inc | Barret t Busine ss Servic es 股份 有限公司 | BBSI UW | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 3,988 | 931,378.40 | 0.02 |

| | | | | | | | | |
|-----|-------------------------------------|-------------------------|---------|-----------|----|-------|------------|------|
| 281 | Stryker Corp | 史赛克 | SYK UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 382 | 926,309.39 | 0.02 |
| 282 | Marsh & McLennan Cos Inc | Marsh & McLennan 股份有限公司 | MMC UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 609 | 914,571.41 | 0.02 |
| 283 | Wintrust Financial Corp | Wintrust 金融公司 | WTFC UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,302 | 914,547.47 | 0.02 |
| 284 | General Dynamics Corp | 通用动力 | GD UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 442 | 913,954.23 | 0.02 |
| 285 | Archrock Inc | Archrock 有限公司 | AROC UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 6,312 | 909,583.79 | 0.02 |
| 286 | Juniper Networks Inc | 瞻博网络股份有限公司 | JNPR UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 3,446 | 895,419.42 | 0.02 |
| 287 | Airbnb Inc | 爱彼迎股份有限公司 | ABNB UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 808 | 873,154.44 | 0.02 |
| 288 | Applied Industrial Technologies Inc | 应用工业技术公司 | AIT UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 630 | 871,037.50 | 0.02 |
| 289 | Benchmark Electronics Inc | 基准电子有限公司 | BHE UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 3,062 | 861,106.44 | 0.02 |
| 290 | Woodward Inc | 伍德沃德公司 | WWD UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 691 | 858,755.03 | 0.02 |
| 291 | Xylem Inc/NY | 赛莱默公司 | XYL UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 871 | 841,915.47 | 0.02 |
| 292 | BellRing Brands Inc | BellRing Brands Inc | BRBR UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 2,061 | 839,291.45 | 0.02 |
| 293 | TechnipFMC PLC | TechnipFMC 公 | FTI UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 4,442 | 827,836.97 | 0.02 |

| | | | | | | | | |
|-----|---------------------------|---------------------------|---------|-----------|----|-------|------------|------|
| | | 共有限公司 | | 所 | | | | |
| 294 | Altair Engineering Inc | Altair Engineering 股份有限公司 | ALTR UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,180 | 824,815.92 | 0.02 |
| 295 | Generac Holdings Inc | Generac 控股公司 | GNRC UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 864 | 814,151.95 | 0.02 |
| 296 | Ingersoll Rand Inc | 英格索兰股份有限公司 | IR UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,231 | 796,947.57 | 0.02 |
| 297 | Eastman Chemical Co | 伊士曼化工 | EMN UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,134 | 791,773.08 | 0.02 |
| 298 | M&T Bank Corp | M&T 银行 | MTB UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 723 | 779,909.10 | 0.02 |
| 299 | Cheniere Energy Inc | Cheniere 能源股份有限公司 | LNG UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 623 | 776,244.57 | 0.02 |
| 300 | Exxon Mobil Corp | 埃克森美孚石油公司 | XOM UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 939 | 770,390.55 | 0.02 |
| 301 | Analog Devices Inc | 亚德诺半导体 | ADI UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 469 | 762,952.02 | 0.02 |
| 302 | Zoetis Inc | 硕腾股份有限公司 | ZTS UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 615 | 759,833.76 | 0.02 |
| 303 | ACM Research Inc | ACM Research Inc | ACMR UQ | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 4,621 | 759,433.66 | 0.02 |
| 304 | DR Horton Inc | 霍顿房屋公司 | DHI UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 749 | 752,280.56 | 0.02 |
| 305 | Taylor Morrison Home Corp | Taylor Morrison 房屋公司 | TMHC UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,895 | 748,733.06 | 0.02 |
| 30 | ChampionX | Champi | CHX UW | 纳斯达克 | 美国 | 3,163 | 748,622.09 | 0.02 |

| | | | | | | | | |
|---------|---------------------------------|--------------------------------------|---------|-------------------|----|-------|------------|------|
| 6 | Corp | onx 公司 | | 克证券 交易所 | | | | |
| 30 7 | Alarm.com Holdings Inc | Alarm.com 控 股股份 有限公司 | ALRM UW | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 1,640 | 742,652.47 | 0.02 |
| 30 8 | MercadoLi bre Inc | Mercad oLibre 股份有 限公司 | MELI UW | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 63 | 737,867.54 | 0.02 |
| 30 9 | Abercromb ie & Fitch Co | 阿贝 克隆比 & 费奇 公司 | ANF UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 572 | 724,970.02 | 0.02 |
| 31 0 | Hubbell Inc | 哈贝 尔公 司 | HUBB UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 276 | 718,897.99 | 0.02 |
| 31 1 | Maplebear Inc | Maple bear Inc | CART UW | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 3,132 | 717,401.36 | 0.02 |
| 31 2 | Appfolio Inc | Appfol io 股份 有限公司 | APPF UQ | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 404 | 704,172.60 | 0.02 |
| 31 3 | Guardant Health Inc | Guard ant Health 股份有 限公司 | GH UW | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 3,331 | 685,593.03 | 0.02 |
| 31 4 | Starbucks Corp | 星巴 克 | SBUX UW | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 1,231 | 682,985.12 | 0.02 |
| 31 5 | Lennox Internati onal Inc | 雷诺 士国 际有 限公 司 | LII UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 178 | 678,659.79 | 0.02 |
| 31 6 | Cars.com Inc | Cars.c om 股份 有限公司 | CARS UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 4,761 | 668,434.69 | 0.02 |
| 31 7 | AT&T Inc | 美国电 话电报 公司 | T UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 4,864 | 662,443.47 | 0.02 |
| 31 | Elastic | Elasti | ESTC UN | 纽约证 | 美国 | 816 | 662,440.05 | 0.02 |

| | | | | | | | | |
|---------|--|---------------------------------------|---------|-------------------|----|-------|------------|------|
| 8 | NV | c 公共 有限责任 公司 | | 券交易 所 | | | | |
| 31 9 | 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 | 843 | 661,348.80 | 0.02 |
| 32 0 | Newmont Corp | 纽蒙黄 金公司 | NEM UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 2,172 | 648,122.88 | 0.02 |
| 32 1 | Burlingto n Stores Inc | 伯灵顿 商店股 份有限 公司 | BURL UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 378 | 646,543.30 | 0.02 |
| 32 2 | Moody's Corp | 穆迪 | MCO UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 212 | 635,975.39 | 0.02 |
| 32 3 | MKS Instrumen ts Inc | MKS Instru ments 股份有 限公司 | MKSI UW | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 680 | 632,819.93 | 0.02 |
| 32 4 | HNI Corp | HNI 公 司 | HNI UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 1,968 | 631,429.92 | 0.02 |
| 32 5 | Globus Medical Inc | Globus 医疗公 司 | GMED UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 1,292 | 630,643.98 | 0.02 |
| 32 6 | DoorDash Inc | DoorDa sh 股份 有限公 司 | DASH UW | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 809 | 627,179.92 | 0.02 |
| 32 7 | Carvana Co | Carvan a 公司 | CVNA UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 675 | 619,219.14 | 0.02 |
| 32 8 | Lincoln National Corp | 林肯国 民 | LNC UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 2,759 | 611,514.36 | 0.02 |
| 32 9 | ICON PLC | ICON 公 共有限 公司 | ICLR UW | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 273 | 609,892.37 | 0.02 |
| 33 | Doximity | Doximi | DOCS UN | 纽约证 | 美国 | 3,036 | 605,185.91 | 0.02 |

| | | | | | | | | |
|-----|-------------------------------------|-----------------|---------|-----------|----|-------|------------|------|
| 0 | Inc | ty Inc | | 券交易所 | | | | |
| 331 | Kirby Corp | Kirby 公司 | KEX UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 705 | 601,570.69 | 0.02 |
| 332 | Occidental Petroleum Corp | 西方石油 | OXY UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,313 | 589,802.49 | 0.02 |
| 333 | Entegris Inc | Entegris 股份有限公司 | ENTG UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 609 | 587,665.95 | 0.02 |
| 334 | Tencent Music Entertainment Group | 腾讯音乐娱乐集团 | TME UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 5,864 | 587,171.35 | 0.02 |
| 335 | Integer Holdings Corp | Integer 控股公司 | ITGR UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 700 | 577,648.52 | 0.01 |
| 336 | Public Service Enterprise Group Inc | 公共服务企业集团 | PEG UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,093 | 574,092.96 | 0.01 |
| 337 | TopBuild Corp | TopBuild 公司 | BLD UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 206 | 565,622.90 | 0.01 |
| 338 | XPO Inc | XPO 股份有限公司 | XPO UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 739 | 559,060.76 | 0.01 |
| 339 | Parker-Hannifin Corp | 派克汉尼汾公司 | PH UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 155 | 558,745.04 | 0.01 |
| 340 | Phillips 66 | Phillips 66 | PSX UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 554 | 557,374.06 | 0.01 |
| 341 | Zebra Technologies Corp | 斑马技术公司 | ZBRA UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 249 | 548,218.90 | 0.01 |
| 342 | Vontier Corp | Vontier Corp | VNT UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 2,006 | 546,120.98 | 0.01 |

| | | | | | | | | |
|-----|------------------------------|--------------------|---------|-----------|----|-------|------------|------|
| 343 | SPX Technologies Inc | SPX 公司 | SPXC UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 529 | 535,878.77 | 0.01 |
| 344 | IES Holdings Inc | IES 控股公司 | IESC UQ | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 534 | 530,249.74 | 0.01 |
| 345 | Lennar Corp | Lennar 公司 | LEN UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 495 | 528,706.29 | 0.01 |
| 346 | RxSight Inc | RxSight Inc | RXST UQ | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,210 | 518,871.66 | 0.01 |
| 347 | Patrick Industries Inc | Patrick 工业股份有限公司 | PATK UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 670 | 518,321.47 | 0.01 |
| 348 | Performance Food Group Co | Performance 食品集团公司 | PFGC UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,089 | 513,085.34 | 0.01 |
| 349 | Light & Wonder Inc | Light & Wonder Inc | LNW UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 682 | 509,766.89 | 0.01 |
| 350 | Delta Air Lines Inc | 达美航空有限公司 | DAL UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,503 | 508,157.37 | 0.01 |
| 351 | Elanco Animal Health Inc | Elanco 动物健康股份有限公司 | ELAN UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 4,895 | 503,400.45 | 0.01 |
| 352 | Target Corp | 塔吉特公司 | TGT UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 468 | 493,764.09 | 0.01 |
| 353 | Oshkosh Corp | 豪士科集团公司 | OSK UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 639 | 492,745.53 | 0.01 |
| 354 | 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 | 490,960.69 | 0.01 |
| 355 | Dow Inc | 陶氏公司 | DOW UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,277 | 482,804.00 | 0.01 |

| | | | | | | | | |
|-----|------------------------------------|--------------------|---------|-----------|----|--------|------------|------|
| 356 | 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 | 139 | 482,632.60 | 0.01 |
| 357 | Moderna Inc | 莫德纳公司 | MRNA UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 566 | 479,010.05 | 0.01 |
| 358 | Assurant Inc | 安信龙集团 | AIZ UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 388 | 459,714.23 | 0.01 |
| 359 | Chevron Corp | 雪佛龙 | CVX UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 396 | 441,450.53 | 0.01 |
| 360 | Okta Inc | Okta Inc | OKTA UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 658 | 438,977.95 | 0.01 |
| 361 | Regions Financial Corp | 地区金融公司 | RF UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 3,057 | 436,604.02 | 0.01 |
| 362 | Chegg Inc | Chegg 股份有限公司 | CHGG UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 19,294 | 434,514.15 | 0.01 |
| 363 | DraftKings Inc | DraftKings 股份有限公司 | DKNG UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,591 | 432,799.66 | 0.01 |
| 364 | 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 | 157 | 431,092.72 | 0.01 |
| 365 | 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 | 307 | 431,021.74 | 0.01 |
| 366 | Carlyle Group Inc/The | 凯雷投资集团 | CG UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,500 | 429,211.53 | 0.01 |
| 367 | United Airlines Holdings Inc | 美国联合航空控股股份有限公司 | UAL UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,232 | 427,245.39 | 0.01 |

| | | | | | | | | |
|-----|-------------------------------------|------------------------|---------|-----------|----|-------|------------|------|
| 368 | Evercore Inc | Evercore 股份有限公司 | EVR UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 285 | 423,350.09 | 0.01 |
| 369 | Nurix Therapeutics Inc | Nurix Therapeutics Inc | NRIX UQ | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 2,825 | 420,180.09 | 0.01 |
| 370 | PayPal Holdings Inc | Paypal 控股股份有限公司 | PYPL UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,008 | 416,876.75 | 0.01 |
| 371 | Travel + Leisure Co | Travel + Leisure 公司 | TNL UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,290 | 413,526.87 | 0.01 |
| 372 | Cboe Global Markets Inc | Cboe 环球市场公司 | CBOE UF | 芝加哥期权交易所 | 美国 | 339 | 410,862.44 | 0.01 |
| 373 | NEXTracker Inc | NEXTracker Inc | NXT UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,192 | 398,252.43 | 0.01 |
| 374 | Zions Bancorp NA | 锡安银行 | ZION UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,271 | 392,852.52 | 0.01 |
| 375 | Mohawk Industries Inc | Mohawk 工业股份有限公司 | MHK UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 479 | 387,766.41 | 0.01 |
| 376 | Armstrong World Industries Inc | 阿姆斯壮世界工业有限公司 | AWI UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 475 | 383,343.45 | 0.01 |
| 377 | Houlihan Lokey Inc | 华利安股份有限公司 | HLI UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 381 | 366,186.81 | 0.01 |
| 378 | Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc | Ollie's 折扣商店控股股份有限公司 | OLLI UQ | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 521 | 364,511.38 | 0.01 |
| 379 | Wynn Resorts | 永利渡假村有 | WYNN UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 559 | 356,557.37 | 0.01 |

| | | | | | | | | |
|-----|--------------------------------|---------------------------------|---------|-----------|----|-------|------------|------|
| | Ltd | 限公司 | | 交易所 | | | | |
| 380 | TPG Inc | TPG Inc | TPG UN | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,182 | 349,169.73 | 0.01 |
| 381 | Everest Group Ltd | Everest 集团有限公司 | EG UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 128 | 347,578.03 | 0.01 |
| 382 | Cava Group Inc | Cava Group Inc | CAVA UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 521 | 344,386.57 | 0.01 |
| 383 | STERIS PLC | 思泰瑞医疗公共有限公司 | STE UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 216 | 337,957.42 | 0.01 |
| 384 | CBIZ Inc | CBIZ 公司 | CBZ UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 635 | 335,340.88 | 0.01 |
| 385 | Ventas Inc | Ventas 公司 | VTR UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 908 | 331,710.35 | 0.01 |
| 386 | Charter Communications Inc | Charter 通信公司 | CHTR UN | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 155 | 330,247.36 | 0.01 |
| 387 | National HealthCare Corp | 国家卫生保健公司 | NHC UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 422 | 326,014.04 | 0.01 |
| 388 | GE Healthcare Technologies Inc | GE Health Care Technologies Inc | GEHC UN | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 581 | 322,641.07 | 0.01 |
| 389 | PROCEPT BioRobotics Corp | PROCEPT BioRobotics Corp | PRCT UN | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 725 | 315,647.75 | 0.01 |
| 390 | Virtu Financial Inc | Virtu 金融股份有限公司 | VIRT UN | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,898 | 303,673.66 | 0.01 |
| 391 | Primerica Inc | Primerica 股 | PRI UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 179 | 301,804.44 | 0.01 |

| | | | | | | | | |
|---------|-------------------------------------|---------------------------------|---------|-------------------|----|-------|------------|------|
| | | 份有限公司 | | 所 | | | | |
| 39 2 | CH Robinson Worldwide Inc | 罗宾逊 全球物 流有限 公司 | CHRW UW | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 474 | 297,678.45 | 0.01 |
| 39 3 | 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 | 729 | 293,905.88 | 0.01 |
| 39 4 | Principal Financial Group Inc | 信安金 融 | PFG UW | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 506 | 282,903.31 | 0.01 |
| 39 5 | Kyndryl Holdings Inc | Kyndry l Holdin gs Inc | KD UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 1,502 | 281,634.17 | 0.01 |
| 39 6 | Tidewater Inc | 美国潮 水公司 | TDW UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 412 | 279,559.56 | 0.01 |
| 39 7 | Walt Disney Co/The | 华特迪 士尼公 司 | DIS UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 390 | 275,971.79 | 0.01 |
| 39 8 | Antero Resources Corp | Antero 资源公 司 | AR UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 1,177 | 273,708.39 | 0.01 |
| 39 9 | MDU Resources Group Inc | MDU 资 源集团 股份有 限公司 | MDU UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 1,518 | 271,543.91 | 0.01 |
| 40 0 | Ford Motor Co | 福特汽 车 | F UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 3,021 | 269,986.99 | 0.01 |
| 40 1 | Danaher Corp | 丹纳赫 | DHR UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 148 | 263,533.39 | 0.01 |
| 40 2 | Morningst ar Inc | 晨星公 司 | MORN UW | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 124 | 261,449.51 | 0.01 |
| 40 3 | Kemper Corp | Kemper 公司 | KMPR UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 603 | 254,968.33 | 0.01 |
| 40 4 | Automatic Data | ADP 公 司 | ADP UW | 纳斯达 克证券 | 美国 | 141 | 239,854.52 | 0.01 |

| | | | | | | | | |
|---------|--------------------------------------|--------------------------------|---------|-------------------|----|-------|------------|------|
| | Processin g Inc | | | 交易所 | | | | |
| 40 5 | Enphase Energy Inc | Enphas e 能源 股份有 限公司 | ENPH UQ | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 337 | 239,476.66 | 0.01 |
| 40 6 | Antero Midstream Corp | Antero 中游公 司 | AM UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 2,261 | 237,515.86 | 0.01 |
| 40 7 | Badger Meter Inc | Badger Meter 公司 | BMI UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 177 | 235,070.01 | 0.01 |
| 40 8 | First Solar Inc | 福思第 一太阳 能公司 | FSLR UW | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 145 | 232,987.21 | 0.01 |
| 40 9 | Hyatt Hotels Corp | 凯悦酒 店集团 | H UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 211 | 228,450.43 | 0.01 |
| 41 0 | Chemed Corp | Chemed 公司 | CHE UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 57 | 220,410.97 | 0.01 |
| 41 1 | Acuity Brands Inc | Acuity Brands 股份有 限公司 | AYI UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 125 | 215,086.82 | 0.01 |
| 41 2 | Ingredion Inc | 宜瑞安 公司 | INGR UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 253 | 206,813.32 | 0.01 |
| 41 3 | Renaissan ceRe Holdings Ltd | 复兴再 保险控 股公司 | RNR UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 113 | 179,998.95 | 0.00 |
| 41 4 | United Rentals Inc | 联合租 赁公司 | URI UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 39 | 179,755.50 | 0.00 |
| 41 5 | Nuvalent Inc | Nuvalent Inc | NUVL UW | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 306 | 165,435.55 | 0.00 |
| 41 6 | Textron Inc | 德事隆 | TXT UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 262 | 160,319.65 | 0.00 |
| 41 7 | Artivion Inc | Artivion 股份有 限公 | AORT UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 873 | 159,586.51 | 0.00 |

| | | 司 | | | | | | |
|---------|--|--|---------|-------------------|----|-----|------------|------|
| 41 8 | Ferrari NV | 法拉利 | RACE UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 52 | 151,339.31 | 0.00 |
| 41 9 | Ferguson PLC | Fergus on 公共 有限公司 | FERG UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 108 | 149,051.32 | 0.00 |
| 42 0 | eBay Inc | eBay 公 司 | EBAY UW | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 389 | 148,929.31 | 0.00 |
| 42 1 | Valvoline Inc | 胜牌股 份有限 公司 | VVV UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 456 | 140,392.26 | 0.00 |
| 42 2 | CDW Corp/DE | 特拉华 CDW 公 司 | CDW UW | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 84 | 134,002.08 | 0.00 |
| 42 3 | McDonald' s Corp | 麦当劳 | MCD UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 70 | 127,133.56 | 0.00 |
| 42 4 | Herc Holdings Inc | Herc 控 股公司 | HRI UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 131 | 124,440.98 | 0.00 |
| 42 5 | Eagle Materials Inc | 鹰牌材 料有限 公司 | EXP UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 79 | 122,433.72 | 0.00 |
| 42 6 | Installed Building Products Inc | Instal led Buildi ng Produc ts 股份 有限公司 | IBP UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 83 | 121,664.74 | 0.00 |
| 42 7 | Intercont inental Exchange Inc | 洲际交 易所 (ICE) | ICE UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 111 | 108,290.23 | 0.00 |
| 42 8 | Axon Enterpris e Inc | Axon Enterp rise 股 份有限 公司 | AXON UW | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 48 | 100,655.50 | 0.00 |
| 42 | Clorox | 高乐氏 | CLX UN | 纽约证 | 美国 | 98 | 95,314.25 | 0.00 |

| | | | | | | | | |
|-----|--|----------------------|---------|-----------|----|-----|-----------|------|
| 9 | Co/The | 公司 | | 券交易所 | | | | |
| 430 | 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 | 92,492.75 | 0.00 |
| 431 | 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 | 56 | 88,692.17 | 0.00 |
| 432 | Six Flags Entertainment Corp/DE | 六旗娱乐公司 | SIX UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 337 | 79,593.39 | 0.00 |
| 433 | Fortinet Inc | Fortinet 股份有限公司 | FTNT UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 183 | 78,604.40 | 0.00 |
| 434 | Avantor Inc | Avantor 股份有限公司 | AVTR UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 520 | 78,565.84 | 0.00 |
| 435 | Floor & Decor Holdings Inc | Floor&Decor 控股股份有限公司 | FND UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 110 | 77,932.27 | 0.00 |
| 436 | 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 | 119 | 75,971.83 | 0.00 |
| 437 | FNB Corp/PA | FNB/宾州 | FNB UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 778 | 75,850.82 | 0.00 |
| 438 | Sysco Corp | Sysco 公司 | SYU UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 138 | 70,211.95 | 0.00 |
| 439 | IQVIA Holdings Inc | 艾昆纬 | IQV UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 46 | 69,316.97 | 0.00 |
| 440 | iRobot Corp | iRobot 公司 | IRBT UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 995 | 64,600.52 | 0.00 |

| | | | | | | | | |
|---------|---------------------------------------|---------------------------------------|---------|-------------------|----|--------|-----------|------|
| 44 1 | Inter Parfums Inc | Inter Parfum s 股份 有限公 司 | IPAR UW | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 78 | 64,499.96 | 0.00 |
| 44 2 | Apellis Pharmaceu ticals Inc | Apelli s 制药 公司 | APLS UW | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 230 | 62,878.33 | 0.00 |
| 44 3 | AeroViron ment Inc | AeroVi ronmen t 股份 有限公 司 | AVAV UW | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 48 | 62,314.46 | 0.00 |
| 44 4 | NIKE Inc | 耐克公 司 | NKE UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 114 | 61,234.75 | 0.00 |
| 44 5 | Crane NXT Co | Crane NXT Co | CXT UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 138 | 60,406.47 | 0.00 |
| 44 6 | Phoenix Motor Inc | Phoeni x Motor Inc | PEV UR | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 23,185 | 55,535.45 | 0.00 |
| 44 7 | Snap-on Inc | 实耐宝 | SNA UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 29 | 54,023.35 | 0.00 |
| 44 8 | Travelers Cos Inc/The | 旅行家 集团 | TRV UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 35 | 50,720.72 | 0.00 |
| 44 9 | KeyCorp | KeyCor p 公司 | KEY UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 461 | 46,686.31 | 0.00 |
| 45 0 | Equitrans Midstream Corp | Equitr ans Midstr eam 公 司 | ETRN UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 491 | 45,420.38 | 0.00 |
| 45 1 | Avnet Inc | 安富利 股份有 限公司 | AVT UW | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 116 | 42,567.24 | 0.00 |
| 45 2 | Albemarle Corp | 雅保公 司 | ALB UN | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 53 | 36,079.85 | 0.00 |
| 45 | Arcosa | Arcosa | ACA UN | 纽约证 | 美国 | 57 | 33,883.44 | 0.00 |

| | | | | | | | | |
|-----|---|--------------------|---------|-----------|----|-----|-----------|------|
| 3 | Inc | Inc | | 券交易所 | | | | |
| 454 | Solventum Corp | Solventum 公司 | SOLV UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 87 | 32,787.27 | 0.00 |
| 455 | Science Applications International Corp | 科学应用国际公司 | SAIC UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 37 | 30,996.95 | 0.00 |
| 456 | Victoria's Secret & Co | 维多利亚的秘密 | VSCO UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 246 | 30,978.92 | 0.00 |
| 457 | Paramount Global | 派拉蒙全球 | PARA UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 407 | 30,137.31 | 0.00 |
| 458 | Paycom Software Inc | Paycom 软件股份有限公司 | PAYC UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 28 | 28,543.69 | 0.00 |
| 459 | Global Payments Inc | 环汇有限公司 | GPN UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 35 | 24,120.65 | 0.00 |
| 460 | 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 | 23,879.98 | 0.00 |
| 461 | Shake Shack Inc | Shake Shack 股份有限公司 | SHAK UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 32 | 20,525.18 | 0.00 |
| 462 | ON Semiconductor Corp | 安森美半导体公司 | ON UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 40 | 19,541.69 | 0.00 |
| 463 | QIAGEN NV | 德国 QIAGEN 公共有限公司 | QGEN UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 62 | 18,156.09 | 0.00 |
| 464 | BILL Holdings Inc | Bill 控股股份有限公司 | BILL UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 47 | 17,625.57 | 0.00 |
| 46 | L3Harris | L3Harr | LHX UN | 纽约证 | 美国 | 11 | 17,605.90 | 0.00 |

| | | | | | | | | |
|-----|--------------------------|------------------------|---------|-----------|----|-----|-----------|------|
| 5 | Technologies Inc | is Technologies 股份有限公司 | | 券交易所 | | | | |
| 466 | AMC Networks Inc | AMC 网络公司 | AMCX UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 210 | 14,457.43 | 0.00 |
| 467 | Crown Holdings Inc | Crown 控股股份有限公司 | CCK UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 27 | 14,314.39 | 0.00 |
| 468 | News Corp | 新闻集团 | NWS UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 69 | 13,960.76 | 0.00 |
| 469 | Assured Guaranty Ltd | 美国保证担保有限公司 | AGO UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 25 | 13,745.82 | 0.00 |
| 470 | Plug Power Inc | 普拉格动力公司 | PLUG UR | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 471 | 7,821.16 | 0.00 |
| 471 | STAG Industrial Inc | STAG 实业公司 | STAG UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 19 | 4,882.86 | 0.00 |
| 472 | Berry Global Group Inc | Berry 全球集团股份有限公司 | BERY UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 7 | 2,935.89 | 0.00 |
| 473 | Atlassian Corp | Atlassian Corp | TEAM UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 2 | 2,521.18 | 0.00 |
| 474 | MarketAxess Holdings Inc | MarketAxess 控股公司 | MKTX UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1 | 1,429.14 | 0.00 |
| 475 | Conagra Brands Inc | 康尼格拉品牌股份有限公司 | CAG UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 7 | 1,417.81 | 0.00 |
| 476 | Peloton Interactive Inc | 派乐腾 | PTON UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 25 | 602.21 | 0.00 |

| | | | | | | | | |
|---------|------------------|-----------|--------|---------|----|---|--------|------|
| 47 7 | Under Armour Inc | 安德玛股份有限公司 | UAA UN | 纽约证券交易所 | 美国 | 8 | 380.29 | 0.00 |
|---------|------------------|-----------|--------|---------|----|---|--------|------|

注：本表所使用的证券代码为彭博代码。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称（英文） | 证券代码 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|---|----------|----------------|----------------|
| 1 | Microsoft Corp | MSFT UW | 136,906,513.70 | 9.18 |
| 2 | Alphabet Inc | GOOGL UW | 96,351,492.46 | 6.46 |
| 2 | Alphabet Inc | GOOG UW | 39,947,683.08 | 2.68 |
| 3 | Apple Inc | AAPL UW | 129,323,678.36 | 8.67 |
| 4 | Amazon.com Inc | AMZN UW | 110,004,944.88 | 7.38 |
| 5 | Meta Platforms Inc | META UW | 76,687,436.07 | 5.14 |
| 6 | Broadcom Inc | AVGO UW | 52,362,565.14 | 3.51 |
| 7 | Eli Lilly & Co | LLY UN | 51,008,969.64 | 3.42 |
| 8 | NVIDIA Corp | NVDA UW | 48,182,133.25 | 3.23 |
| 9 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | TSM UN | 36,504,115.07 | 2.45 |
| 10 | Tesla Inc | TSLA UW | 36,388,088.53 | 2.44 |
| 11 | Costco Wholesale Corp | COST UW | 34,931,665.48 | 2.34 |
| 12 | AbbVie Inc | ABBV UN | 31,703,493.41 | 2.13 |
| 13 | QUALCOMM Inc | QCOM UW | 30,172,205.81 | 2.02 |
| 14 | General Electric Co | GE UN | 29,300,628.85 | 1.97 |
| 15 | Netflix Inc | NFLX UW | 28,669,252.92 | 1.92 |
| 16 | Vertiv Holdings Co | VRT UN | 25,929,556.80 | 1.74 |
| 17 | Dell Technologies Inc | DELL UN | 23,564,791.31 | 1.58 |
| 18 | Mastercard Inc | MA UN | 21,550,686.96 | 1.45 |
| 19 | ASML Holding NV | ASML UW | 19,770,983.69 | 1.33 |
| 20 | Adobe Inc | ADBE UW | 18,589,541.10 | 1.25 |

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 | Advanced Micro Devices Inc | AMD UW | 22,281,026.77 | 1.49 |
| 2 | General Electric Co | GE UN | 21,377,276.28 | 1.43 |

| | | | | |
|----|-------------------------|---------|---------------|------|
| 3 | Mastercard Inc | MA UN | 17,962,551.26 | 1.20 |
| 4 | UnitedHealth Group Inc | UNH UN | 14,353,515.12 | 0.96 |
| 5 | Home Depot Inc/The | HD UN | 14,117,461.07 | 0.95 |
| 6 | Tesla Inc | TSLA UW | 12,912,349.45 | 0.87 |
| 7 | Adobe Inc | ADBE UW | 12,241,657.96 | 0.82 |
| 8 | Intuit Inc | INTU UW | 12,223,170.44 | 0.82 |
| 9 | Visa Inc | V UN | 12,173,074.39 | 0.82 |
| 10 | Salesforce Inc | CRM UN | 10,952,690.23 | 0.73 |
| 11 | ServiceNow Inc | NOW UN | 10,059,770.01 | 0.67 |
| 12 | AbbVie Inc | ABBV UN | 9,135,627.39 | 0.61 |
| 13 | NVIDIA Corp | NVDA UW | 8,852,895.44 | 0.59 |
| 14 | Palo Alto Networks Inc | PANW UW | 8,621,608.52 | 0.58 |
| 15 | Caterpillar Inc | CAT UN | 8,401,012.56 | 0.56 |
| 16 | Marathon Petroleum Corp | MPC UN | 8,388,202.29 | 0.56 |
| 17 | Walt Disney Co/The | DIS UN | 7,655,035.90 | 0.51 |
| 18 | Toyota Motor Corp | TM UN | 7,451,460.42 | 0.50 |
| 19 | Uber Technologies Inc | UBER UN | 7,203,525.11 | 0.48 |
| 20 | Cigna Group/The | CI UN | 6,860,511.41 | 0.46 |

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 | 2,747,010,323.12 |
| 卖出收入（成交）总额 | 979,361,054.95 |

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 | SSgA Funds Management Inc | 3,935,614.45 | 0.10 |
| 2 | iMGP DBi Managed Futures Strategy ETF | ETF | 交易型开放式 | iM Global Partner Fund Management LLC | 2,244,290.33 | 0.06 |
| 3 | Invesco QQQ Trust Series 1 | ETF | 交易型开放式 | Invesco Capital Management LLC | 1,908,717.32 | 0.05 |
| 4 | iShares Russell 1000 Value ETF | ETF | 交易型开放式 | BlackRock Fund Advisors | 1,638,818.07 | 0.04 |
| 5 | SPDR Gold Shares | ETF | 交易型开放式 | State Street Global Advisors Inc | 1,339,259.28 | 0.03 |
| 6 | Global X Robotics & Artificial Intelligence ETF | ETF | 交易型开放式 | Global X Management Co LLC | 1,189,452.23 | 0.03 |
| 7 | Invesco Golden Dragon China ETF | ETF | 交易型开放式 | Invesco Capital Management LLC | 881,022.14 | 0.02 |
| 8 | iShares Russell 2000 Growth ETF | ETF | 交易型开放式 | BlackRock Fund Advisors | 731,560.53 | 0.02 |
| 9 | iShares 20+ Year Treasury Bond ETF | ETF | 交易型开放式 | BlackRock Fund Advisors | 717,545.18 | 0.02 |
| 10 | Invesco KBW Bank | ETF | 交易型开放式 | Invesco Capital | 663,433.81 | 0.02 |

| | | | | | | |
|--|-----|--|--|-------------------|--|--|
| | ETF | | | Management LLC | | |
|--|-----|--|--|-------------------|--|--|

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 | - |
| 3 | 应收股利 | 569,924.31 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 96,282,838.97 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 96,852,763.28 |

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 | 261,710 | 3,181.95 | 78,667,107.75 | 9.45 | 754,082,084.14 | 90.55 |
| 嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇 | 642 | 7,010.86 | - | - | 4,500,970.38 | 100.00 |
| 合计 | 262,215 | 3,192.99 | 78,667,107.75 | 9.40 | 758,583,054.52 | 90.60 |

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 | 410,633.70 | 0.05 |
| | 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 | 410,763.76 | 0.05 |

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、基金投资和相关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 |
| | 嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇 | 0 |

| | | | |
|--|----|--|---|
| | 合计 | | 0 |
|--|----|--|---|

§ 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 | 373,719,810.71 | 4,460,681.52 |
| 本报告期基金总申购份额 | 705,345,928.57 | 723,887.05 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 246,316,547.39 | 683,598.19 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 832,749,191.89 | 4,500,970.38 |

§ 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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动情况。

(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，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员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 | - | 3,535,106,775.76 | 95.44 | 1,058,135.83 | 96.29 | - |
| 招商证券 (香港)有限公司 China Merchants Securities (HK) Co., Ltd. | - | 116,159,788.22 | 3.14 | 31,539.82 | 2.87 | 新增 |
| 瑞银集团 Union Bank of Switzerland | - | 52,903,155.40 | 1.43 | 9,247.66 | 0.84 | - |
| Wolfe Research Securities | - | - | - | - | - | - |
| 德意志银行股份有限公司 Deutsche Bank | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 花旗环球 金融亚洲 有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited | - | - | - | - | - | - |
| 金贝塔证 券有限公 司 iGoldenbe ta Sec urities Company Limited | - | - | - | - | - | - |
| 麦格理资 本证券股 份有限公 司 Macquarie Secur ities Gr oup | - | - | - | - | - | - |
| 瑞士信贷 （香港）有 限公司 Credit S uisse （Hong Ko ng） Limi ted | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 国际有限 公司 CITIC Se curities Inter national Company Limited | - | - | - | - | - | - |
| 麦格理银 行有限公 司香港分 行 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|---|--|--|--|--|--|--|
| Macquaire Bank Limited Hong K ong Bran ch. | | | | | | |
|---|--|--|--|--|--|--|

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 | - | - | - | - | - | - | 46,419,277.68 | 10.0 |
| 招商证券（香港）有限公司 China Merchants Securities (HK) Co., Ltd. | - | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | | |
|--|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 瑞银集团 Union Bank of Switzerland | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Wolfe Research Securities | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 德意志银行股份有限公司 Deutsche Bank | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 花旗环球金融亚洲有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 金贝塔证券有限公司 iGoldenbeta Securities Company Limited | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 麦格理资本证券股份有限公司 Macquarie Securities Group | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 瑞士信贷（香港）有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券国际有限公司 CITIC Securities International Company Limited | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 麦格理银行有限公司香港分行 Macquarie Bank Limited Hong Kong Branch. | - | - | - | - | - | - | - | - |

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）2024年1月15日暂停申购、赎回及定投业务的公告 | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024年1月11日 |
| 2 | 关于嘉实美国成长股票（QDII）2024年2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 | 2024年2月7日 |
| 3 | 嘉实美国成长股票型证券投资基金暂停大额申购（含定期定额投资）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 | 2024年3月23日 |
| 4 | 关于嘉实美国成长股票（QDII）2024年3月29日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告 | 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 | 2024年3月27日 |
| 5 | 关于嘉实美国成长股票（QDII）2024年5月27日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告 | 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 | 2024年5月23日 |
| 6 | 关于嘉实美国成长股票（QDII）2024年6月19日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告 | 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 | 2024年6月17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

2024 年 8 月 30 日