

大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 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 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§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.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
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.....	13
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.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	40
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	40
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	41
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	89
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	91
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.....	91

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	91
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	91
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	91
7.11 投资组合报告附注	91
§8 基金份额持有人信息	92
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	92
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	93
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	93
§9 开放式基金份额变动	93
§10 重大事件揭示	94
10.1 基金份额持有人大会决议	94
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	94
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	94
10.4 基金投资策略的改变	94
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	94
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	94
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	94
10.8 其他重大事件	95
§11 影响投资者决策的其他重要信息	97
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	97
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	98
§12 备查文件目录	98
12.1 备查文件目录	98
12.2 存放地点	98
12.3 查阅方式	98

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成标普 500 等权重指数证券投资基金	
基金简称	大成标普 500 等权重指数 (QDII)	
基金主代码	096001	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011 年 3 月 23 日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	277,456,503.38 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	大成标普 500 等权重指数 (QDII) A	大成标普 500 等权重指数 (QDII) C
下属分级基金的交易代码	096001	008401
报告期末下属分级基金的份额总额	260,278,386.48 份	17,178,116.90 份

注：根据 2021 年 9 月 4 日基金管理人披露的《大成基金管理有限公司关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金增设基金份额并修订基金合同、托管协议的公告》，自 2021 年 9 月 7 日起大成标普 500 等权重指数证券投资基金增加美元基金份额。本基金份额含人民币份额及美元份额(如有)。

2.2 基金产品说明

投资目标	通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。
投资策略	本基金将按照标的指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如股票停牌、流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。 本基金还可能将一定比例的基金资产投资于与标普 500 等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金，以优化投资组合的建立，达到节约交易成本和有效追踪标的指数表现的目的。
业绩比较基准	标普 500 等权重指数（全收益指数）收益率
风险收益特征	本基金为美国股票指数型证券投资基金，风险与预期收益高于混合型基金、债券基金以及货币市场基金，属于预期风险较高的产品。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	段皓静	许俊
	联系电话	0755-83183388	010-66596688

电子邮箱	office@dcfund.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话	4008885558	95566
传真	0755-83199588	010-66594942
注册地址	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、 27-33 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、 27-33 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518054	100818
法定代表人	吴庆斌	葛海蛟

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	-	中国银行（香港）有限公司
注册地址		-	香港花园道 1 号中银大厦
办公地址		-	香港花园道 1 号中银大厦
邮政编码		-	999000

2.5 信息披露方式

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

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	大成基金管理有限公司	广东省深圳市南山区海德三 道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 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)	
	大成标普 500 等权重指数(QDII)A	大成标普 500 等权重指数(QDII)C
本期已实现收益	16,036,320.58	947,331.57
本期利润	25,772,605.25	1,376,452.23

加权平均基金份额本期利润	0.1017	0.0884
本期加权平均净值利润率	4.25%	3.69%
本期基金份额净值增长率	4.19%	4.08%
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	178,682,796.52	11,704,451.82
期末可供分配基金份额利润	0.6865	0.6814
期末基金资产净值	628,754,275.19	41,491,446.49
期末基金份额净值	2.4157	2.4154
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	222.59%	8.01%

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、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成标普 500 等权重指数(QDII)A

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	-0.32%	0.38%	-0.45%	0.41%	0.13%	-0.03%
过去三个月	-2.44%	0.61%	-2.63%	0.67%	0.19%	-0.06%

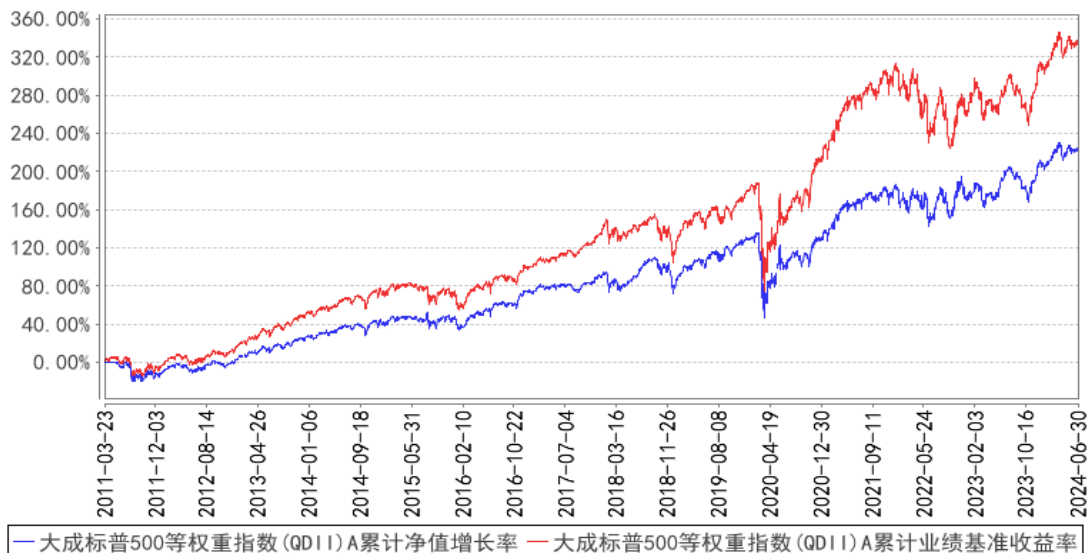
过去六个月	4.19%	0.58%	5.08%	0.64%	-0.89%	-0.06%
过去一年	7.62%	0.66%	11.79%	0.72%	-4.17%	-0.06%
过去三年	20.29%	1.01%	15.25%	1.05%	5.04%	-0.04%
自基金合同生效 起至今	222.59%	1.12%	334.17%	1.16%	111.58%	-0.04%

大成标普 500 等权重指数 (QDII)C

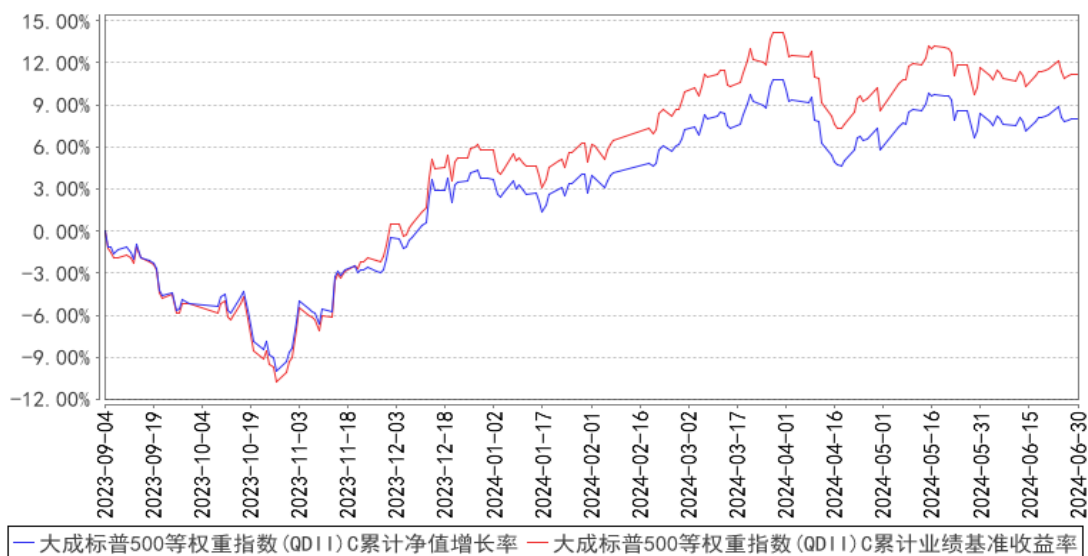
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准 差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.34%	0.38%	-0.45%	0.41%	0.11%	-0.03%
过去三个月	-2.50%	0.61%	-2.63%	0.67%	0.13%	-0.06%
过去六个月	4.08%	0.58%	5.08%	0.64%	-1.00%	-0.06%
自基金合同生效 起至今	8.01%	0.69%	11.15%	0.74%	-3.14%	-0.05%

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

大成标普500等权重指数(QDII)A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



大成标普500等权重指数(QDII)C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

2、本基金自 2023 年 8 月 30 日起增设 C 类基金份额类别，C 类的净值增长率和业绩比较基准收益率自 2023 年 9 月 4 日有份额之日开始计算。

3、同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司成立于 1999 年 4 月 12 日，注册资本人民币 2 亿元，是中国首批获准成立的“老十家”基金管理公司之一。公司总部位于深圳，同时设置了北方、华东和南方营销总部，在北京、上海等地开设有 5 家分公司。2009 年，公司在香港设立大成国际资产管理有限公司，大力拓展国际业务；2013 年，设立大成创新资本管理有限公司，开拓专户及专项管理业务。

公司业务资质齐全，全面覆盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理等业务，还受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金和基本养老保险基金。旗下大成国际资产管理公司具备 QFII、RQFII 等资格，是首批首家完成备案的能够提供港股通投资顾问服务的香港机构。

历经二十余年的磨砺和沉淀，大成基金形成了以长期投资能力为核心的竞争优势，打造了一支具有良好职业素养和丰富经验的资产管理队伍。公司目前已形成权益投资、固收投资、指数与期货投资、跨境投资、混合资产投资、大类资产配置六大投资团队，全面覆盖各类投资领域，综

合实力不断提升，各项业务迅猛发展，管理资产种类位居同业前列。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
冉凌浩	本基金基金经理	2011年8月26日	-	21年	英国曼彻斯特大学商学院金融学硕士。2003年4月至2004年6月就职于国信证券研究部，任研究员。2004年6月至2005年9月就职于华西证券研究部，任高级研究员。2005年9月加入大成基金管理有限公司，曾担任金融工程师、境外市场研究员及基金经理助理，现任国际业务部基金经理。2011年8月26日起任大成标普500等权重指数型证券投资基金基金经理。2014年11月13日起任大成纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）（转型前为大成纳斯达克100指数证券投资基金）基金经理。2016年12月2日至2023年3月14日任大成恒生综合中小型股指数基金（QDII-LOF）基金经理。2016年12月29日至2020年7月7日任大成海外中国机会混合型证券投资基金（LOF）基金经理。2017年8月10日起任大成恒生指数证券投资基金（LOF）基金经理。2019年3月20日起任大成中华沪深港300指数证券投资基金（LOF）基金经理。2021年5月18日起任大成恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理。2021年9月9日起任大成恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。2023年7月12日起任大成纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理。2024年5月29日起任大成全球美元债债券型证券投资基金（QDII）基金经理。2024年6月18日起任大成恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 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守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 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，公司严格执行了公平交易的原则和制度。公司运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合间连续 4 个季度的日内、3 日内、5 日内及 10 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析，针对同一基金经理管理的多个投资组合及公私募兼任基金经理管理的多个投资组合的投资交易行为加强了公平交易监测与分析，包括对不同时间窗下（同日、3 日、5 日、10 日）反向交易和同向交易价差监控的分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；部分股票同向交易溢价率较大主要来源于投资策略差异、市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，同时结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 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未发现存在异常交易行为。公司旗下投资组合间存在证券同日反向交易，但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情形。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

4.4 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，国际经济形势相对较为稳定，美股也继续保持升势并创出了历史新高。

从整体来看，上半年美国宏观经济韧性较强，并没有陷入经济衰退，但经济增速有所放缓。美国 2024 年 1 季度及 2 季度的 GDP 环比增速折年率分别为 1.4% 及 2.8%，保持在正增长区间。

分项来看，个人消费仍然是经济增长的主要支柱。最新公布的美国 2 季度个人消费实际增长季环比折年率为 2.3%，保持在较为健康的水平区间内，也仍然是 GDP 增长的重要支柱。较好的消费是由较好的劳动力市场推动的，美国 24 年 6 月份失业率为 4.1%，持续保持在低位水平区间，但较 2023 年的平均失业率水平有一定程度的上升。

从生产方面来看，美国 2 季度的 ISM 制造业 PMI 指数继续降至 50 以下的水平，这说明 3 月份 PMI 回到经济扩张区间只是昙花一现，而实际美国制造业景气程度仍然较低。

上半年，美国通胀水平继续在中等水平区间保持稳定，6 月份 CPI 为 3.0%，没有出现明显反弹。美国工资增速虽然有所下降，但仍然保持在高位，这对通胀的进一步下降形成了阻碍。同期，美联储既没有加息也没有降息，维持联邦基金目标利率区间不变。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成标普 500 等权重指数(QDII)A 的基金份额净值为 2.4157 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.19%，同期业绩比较基准收益率为 5.08%；截至本报告期末大成标普 500 等权重指数(QDII)C 的基金份额净值为 2.4154 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.08%，同期业绩比较基准收益率为 5.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从美国宏观经济来看，长期看来，美国非政府部门资产负债表依然相对较为健康，这是保持经济长期增长的保障。从近期看来，当前市场一致预计今年下半年美联储会开始降息，但具体降息时间以及今年能有多大的降息空间则还有一定的不确定性。

今年以来，本基金基准指数成份股中多数核心企业经营情况稳定，市场预计 2024 年盈利水平持续提升，因此，如果美国经济能保持稳定的正增长，则美股中长期前景依然可期。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由公司各投研部门、交易管理部、风险管理部、监察稽核部、基金运营部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括八名投资组合经理。

各投研部门、风险管理部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；交易管理部负责关注相关投资品种的流动性状况，协助反馈其市场交易信息；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管行沟

通估值调整事项；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内，大成标普 500 等权重指数(QDII)A 已分配利润 17,185,039.78 元，每十份基金份额分红 0.6940 元；大成标普 500 等权重指数(QDII)C 已分配利润 662,284.91 元，每十份基金份额分红 0.6922 元；符合基金合同规定的分红比例。

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

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

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

5.3 托管人对本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：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

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	49,216,536.02	31,359,238.59
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	623,112,175.79	420,451,075.44
其中：股票投资		623,112,175.79	420,451,075.44
基金投资		-	-
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		-	5,516,281.79
应收股利		626,188.20	534,003.68
应收申购款		2,385,646.60	2,992,256.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	171,858.62	-
资产总计		675,512,405.23	460,852,855.90
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		-	-
应付赎回款		4,467,580.35	4,264,000.73
应付管理人报酬		549,375.81	369,415.03
应付托管费		137,343.97	92,353.74
应付销售服务费		10,475.70	3,070.83
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	101,907.72	191,856.33
负债合计		5,266,683.55	4,920,696.66
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	277,456,503.38	190,869,817.52
未分配利润	6.4.7.12	392,789,218.30	265,062,341.72
净资产合计		670,245,721.68	455,932,159.24
负债和净资产总计		675,512,405.23	460,852,855.90

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 277,456,503.38 份，其中大成标普 500 等权重指数(QDII)A 基金份额总额为 260,278,386.48 份，基金份额净值 2.4157 元。大成标普 500 等权重指数(QDII)C 基金份额总额为 17,178,116.90 份，基金份额净值 2.4154 元。

6.2 利润表

会计主体：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

本报告期：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		31,408,854.81	37,555,418.21
1. 利息收入		65,137.95	28,727.54
其中：存款利息收入	6.4.7.13	65,137.95	28,727.54
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）		22,687,879.61	7,338,281.63

其中：股票投资收益	6.4.7.14	17,499,839.51	4,181,854.61
基金投资收益	6.4.7.15	-	-
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	5,188,040.10	3,156,427.02
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	10,165,405.33	29,638,360.93
4. 汇兑收益(损失以 “-”号填列)		-1,602,562.57	478,460.24
5. 其他收入(损失以 “-”号填列)	6.4.7.22	92,994.49	71,587.87
减：二、营业总支出		4,259,797.33	2,500,714.65
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,199,730.93	1,841,206.01
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	799,932.72	460,301.49
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	55,860.34	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资 产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.24	204,273.34	199,207.15
三、利润总额(亏损总 额以“-”号填列)		27,149,057.48	35,054,703.56
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以 “-”号填列)		27,149,057.48	35,054,703.56
五、其他综合收益的税 后净额		-	-
六、综合收益总额		27,149,057.48	35,054,703.56

6.3 净资产变动表

会计主体：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

本报告期：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	190,869,817.52	-	265,062,341.72	455,932,159.24
二、本期期初净资产	190,869,817.52	-	265,062,341.72	455,932,159.24
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	86,586,685.86	-	127,726,876.58	214,313,562.44
(一)、综合收益总额	-	-	27,149,057.48	27,149,057.48
(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)	86,586,685.86	-	118,425,143.79	205,011,829.65
其中：1. 基金申购款	142,709,415.53	-	196,215,958.18	338,925,373.71
2. 基金赎回款	-56,122,729.67	-	-77,790,814.39	-133,913,544.06
(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)	-	-	-17,847,324.69	-17,847,324.69
四、本期期末净资产	277,456,503.38	-	392,789,218.30	670,245,721.68
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	162,940,929.31	-	192,162,727.82	355,103,657.13
二、本期期初净资产	162,940,929.31	-	192,162,727.82	355,103,657.13
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	7,346,695.31	-	31,460,037.26	38,806,732.57
(一)、综合收益总额	-	-	35,054,703.56	35,054,703.56
(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)	7,346,695.31	-	8,232,392.85	15,579,088.16

其中：1. 基金申购款	43,277,947.47	-	50,121,201.43	93,399,148.90
2. 基金赎回款	-35,931,252.16	-	-41,888,808.58	-77,820,060.74
(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）	-	-	-11,827,059.15	-11,827,059.15
四、本期期末净资产	170,287,624.62	-	223,622,765.08	393,910,389.70

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：

谭晓冈

范瑛

梁靖

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

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

根据本基金的基金管理人大成基金管理有限公司于 2021 年 9 月 4 日发布的《关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金增设基金份额并修订基金合同、托管协议的公告》以及更新的《大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同》,自 2021 年 9 月 7 日起,本基金增加美元基金份额,现有的基金份额变更为人民币基金份额。其中,以人民币计价并进行申购、赎回的份额类别,称为人民币基金份额;以美元计价并进行申购、赎回的份额类别,称为美元基金份额。各类基金份

额分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。

根据本基金的基金管理人于 2023 年 8 月 28 日发布的《关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金增设 C 类基金份额并相应修订基金合同和托管协议的公告》，自 2023 年 8 月 30 日起，本基金在现有基金份额的基础上增设 C 类基金份额，原人民币基金份额转为 A 类人民币基金份额，原美元基金份额转为 A 类美元基金份额。其中，在投资人申购基金时收取申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费，并不收取申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。各类基金份额分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。

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

本财务报表由本基金的基金管理人大成基金管理有限公司于 2024 年 8 月 29 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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于 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止期间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

本基金在本报告期间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股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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	49,216,536.02
等于：本金	49,213,049.24
加：应计利息	3,486.78
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	49,216,536.02

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	537,471,120.80	-	623,112,175.79	85,641,054.99
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市	-	-	-

	场				
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		537,471,120.80	-	623,112,175.79	85,641,054.99

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

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	171,858.62
合计	171,858.62

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	8,496.77
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	-
其他	3,903.35
预提费用	89,507.60
合计	101,907.72

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

大成标普 500 等权重指数(QDII)A

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	182,508,938.23	182,508,938.23
本期申购	119,066,880.46	119,066,880.46
本期赎回(以“-”号填列)	-41,297,432.21	-41,297,432.21
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	260,278,386.48	260,278,386.48
-----	----------------	----------------

大成标普 500 等权重指数 (QDII)C

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	8,360,879.29	8,360,879.29
本期申购	23,642,535.07	23,642,535.07
本期赎回 (以“-”号填列)	-14,825,297.46	-14,825,297.46
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	17,178,116.90	17,178,116.90

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

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

大成标普 500 等权重指数 (QDII)A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	126,645,751.79	126,782,574.23	253,428,326.02
本期期初	126,645,751.79	126,782,574.23	253,428,326.02
本期利润	16,036,320.58	9,736,284.67	25,772,605.25
本期基金份额交易产生的变动数	53,185,763.93	53,274,233.29	106,459,997.22
其中：基金申购款	80,122,171.26	83,515,828.45	163,637,999.71
基金赎回款	-26,936,407.33	-30,241,595.16	-57,178,002.49
本期已分配利润	-17,185,039.78	-	-17,185,039.78
本期末	178,682,796.52	189,793,092.19	368,475,888.71

大成标普 500 等权重指数 (QDII)C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,786,784.04	5,847,231.66	11,634,015.70
本期期初	5,786,784.04	5,847,231.66	11,634,015.70
本期利润	947,331.57	429,120.66	1,376,452.23
本期基金份额交易产生的变动数	5,632,621.12	6,332,525.45	11,965,146.57
其中：基金申购款	15,235,513.15	17,342,445.32	32,577,958.47
基金赎回款	-9,602,892.03	-11,009,919.87	-20,612,811.90
本期已分配利润	-662,284.91	-	-662,284.91
本期末	11,704,451.82	12,608,877.77	24,313,329.59

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	65,137.95
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	-
合计	65,137.95

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	17,499,839.51
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	17,499,839.51

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	86,174,636.25
减：卖出股票成本总额	68,570,377.84
减：交易费用	104,418.90
买卖股票差价收入	17,499,839.51

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

无。

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	5,188,040.10
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,188,040.10

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	10,165,405.33
股票投资	10,165,405.33
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	10,165,405.33

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	92,246.82
其他	747.67
合计	92,994.49

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	29,835.26
信息披露费	59,672.34

证券出借违约金	-
指数使用费	103,828.22
银行划款手续费	10,937.52
合计	204,273.34

6.4.7.25 分部报告

无。

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

本基金本报告期存在控制关系或者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
大成基金管理有限公司(“大成基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
中国银行(香港)有限公司(“中银香港”)	境外资产托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	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	3,199,730.93	1,841,206.01
其中：应支付销售机构的客户维护费	900,940.45	681,627.14
应支付基金管理人的净管理费	2,298,790.48	1,159,578.87

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

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.00%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	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	799,932.72	460,301.49

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成标普 500 等权重指数(QDII)A	大成标普 500 等权重指数(QDII)C	合计
大成基金	-	1,160.39	1,160.39
合计	-	1,160.39	1,160.39
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		

关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成标普 500 等权重指数 (QDII) A	大成标普 500 等权重指数 (QDII) C	合计
合计	-	-	-

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给大成基金，再由大成基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.30\% / \text{当年天数}。$$

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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
	大成标普 500 等权重指数 (QDII) A	大成标普 500 等权重指数 (QDII) C
基金合同生效日（2011 年 3 月 23 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	4,340.28
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	4,340.28
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	0.00%

项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 -
	大成标普 500 等权重指数 (QDII)A	大成标普 500 等权重指数 (QDII)C
基金合同生效日（2011 年 3 月 23 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份 额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

注：基金管理人大成基金投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

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	35,271,367.46	65,137.95	9,047,647.51	28,727.54
中银香港	13,945,168.56	-	18,485,904.25	-

注：本基金的银行存款由基金托管人和境外资产托管人保管，按银行约定利率计息。

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

单位：人民币元

大成标普 500 等权重指数 (QDII) A								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形 式 发放总	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					

					额			
1	2024 年 1 月 18 日	-	2024 年 1 月 17 日	0.6940	11,332,568.59	5,852,471.19	17,185,039.78	-
合计	-	-	-	0.6940	11,332,568.59	5,852,471.19	17,185,039.78	-
大成标普 500 等权重指数(QDII)C								
序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2024 年 1 月 18 日	-	2024 年 1 月 17 日	0.6922	610,155.69	52,129.22	662,284.91	-
合计	-	-	-	0.6922	610,155.69	52,129.22	662,284.91	-

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

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控（合规与风险管理委员会、

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

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

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。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国银行股份有限公司及境外资产托管人中国银行(香港)有限公司,因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算,在境内交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算,违约风险发生的可能性很小;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。

本期末,本基金无债券投资(上年度末:同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

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

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。

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

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	35,271,367.46	-	-	13,945,168.56	49,216,536.02
交易性金融资产	-	-	-	623,112,175.79	623,112,175.79
应收股利	-	-	-	626,188.20	626,188.20
应收申购款	39,124.15	-	-	2,346,522.45	2,385,646.60
其他资产	-	-	-	171,858.62	171,858.62
资产总计	35,310,491.61	-	-	640,201,913.62	675,512,405.23
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,467,580.35	4,467,580.35
应付管理人报酬	-	-	-	549,375.81	549,375.81
应付托管费	-	-	-	137,343.97	137,343.97
应付销售服务费	-	-	-	10,475.70	10,475.70
其他负债	-	-	-	101,907.72	101,907.72
负债总计	-	-	-	5,266,683.55	5,266,683.55
利率敏感度缺口	35,310,491.61	-	-	-634,935,230.07	670,245,721.68
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	19,756,173.95	-	-	11,603,064.64	31,359,238.59
交易性金融资产	-	-	-	420,451,075.44	420,451,075.44
应收股利	-	-	-	534,003.68	534,003.68
应收申购款	13,163.18	-	-	2,979,093.22	2,992,256.40
应收清算款	-	-	-	5,516,281.79	5,516,281.79
资产总计	19,769,337.13	-	-	441,083,518.77	460,852,855.90
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,264,000.73	4,264,000.73
应付管理人报酬	-	-	-	369,415.03	369,415.03
应付托管费	-	-	-	92,353.74	92,353.74
应付销售服务费	-	-	-	3,070.83	3,070.83
其他负债	-	-	-	191,856.33	191,856.33
负债总计	-	-	-	4,920,696.66	4,920,696.66
利率敏感度缺口	19,769,337.13	-	-	-436,162,822.11	455,932,159.24

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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

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

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

金持有不以记账本位币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

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 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
货币资金	13,947,057.45	-	-	13,947,057.45
交易性金融资产	623,112,175.79	-	-	623,112,175.79
应收股利	626,188.20	-	-	626,188.20
其他资产	146,479.61	-	-	146,479.61
资产合计	637,831,901.05	-	-	637,831,901.05
以外币计价的 负债				
其他负债	3,903.35	-	-	3,903.35
负债合计	3,903.35	-	-	3,903.35
资产负债表外 外汇风险敞口净 额	637,827,997.70	-	-	637,827,997.70
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
货币资金	11,603,064.64	-	-	11,603,064.64

	4.64			
交易性金融资产	420,451,075.44	-	-	420,451,075.44
应收股利	534,003.68	-	-	534,003.68
应收清算款	5,516,281.79	-	-	5,516,281.79
资产合计	438,104,425.55	-	-	438,104,425.55
以外币计价的负债				
其他负债	3,879.19	-	-	3,879.19
负债合计	3,879.19	-	-	3,879.19
资产负债表外 外汇风险敞口净额	438,100,546.36	-	-	438,100,546.36

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%	31,891,400.11	21,905,027.32
所有外币相对人民币贬值 5%	-31,891,400.11	-21,905,027.32	

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

本基金的基金管理人通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，实现基金投资组合对标的

指数的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于标普 500 等权重指数成份股、备选成份股以及与标普 500 等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例为基金资产净值的 80%-95%，其中投资于与标普 500 等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例不超过 10%；投资于现金、银行存款、固定收益类证券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具的比例为基金资产净值的 5%-20%，其中投资于现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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	623,112,175.79	92.97	420,451,075.44	92.22
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	623,112,175.79	92.97	420,451,075.44	92.22

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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%	30,865,811.60	21,130,686.25

	业绩比较基准下降 5%	-30,865,811.60	-21,130,686.25
--	----------------	----------------	----------------

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	623,112,175.79	420,451,075.44
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	623,112,175.79	420,451,075.44

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，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票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的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

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（上年度末：同）。

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应收款项和其他金融负债，其账面价值与

公允价值相差很小。

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	623,112,175.79	92.24
	其中：普通股	623,112,175.79	92.24
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	49,216,536.02	7.29
8	其他各项资产	3,183,693.42	0.47
9	合计	675,512,405.23	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	623,112,175.79	92.97
合计	623,112,175.79	92.97

注：股票的国家（地区）类别根据其所在证券交易所确定。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
通讯	30,190,382.32	4.50
非必需消费品	64,780,115.41	9.67
必需消费品	47,335,679.76	7.06
能源	30,711,555.73	4.58
金融	95,199,589.54	14.20
房地产	38,651,446.70	5.77
医疗保健	77,188,738.67	11.52
工业	89,602,478.21	13.37
材料	34,204,310.51	5.10
科技	77,362,281.03	11.54
公用事业	37,885,597.91	5.65
政府	-	-
合计	623,112,175.79	92.97

注：以上分类采用彭博行业分类标准。

7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

无。

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

7.4.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	CARNIVAL CORP	嘉年华公司	CCL US	美国纽约证券交易所	美国	11,311	1,509,042.32	0.23
2	FEDEX CORP	联邦快递	FDX US	美国纽约证券交易所	美国	694	1,483,008.40	0.22
3	SYNCHRONY FINANCIAL	同步金融公司	SYF US	美国纽约证券交易所	美国	4,302	1,446,821.50	0.22
4	DIAMONDBACK ENERGY INC	Diamondback 能源股份有限公司	FANG US	纳斯达克证券交易所	美国	989	1,411,020.24	0.21
5	BAKER HUGHES CO	贝克休斯公司	BKR US	纳斯达克证券交易所	美国	5,622	1,409,151.80	0.21

6	NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDING	挪威邮轮控股有限公司	NCLH US	美国纽约证券交易所	美国	10,477	1,403,002.02	0.21
7	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	Discover 金融服务公司	DFS US	美国纽约证券交易所	美国	1,486	1,385,333.47	0.21
8	TESLA INC	特斯拉公司	TSLA US	纳斯达克证券交易所	美国	981	1,383,456.41	0.21
9	MGM RESORTS INTERNATIONAL	美高梅国际酒店集团	MGM US	美国纽约证券交易所	美国	4,354	1,378,977.08	0.21
10	SALESFORCE INC	Salesforce 股份有限公司	CRM US	美国纽约证券交易所	美国	748	1,370,560.61	0.20
11	EOG RESOURCES INC	EOG 能源公司	EOG US	美国纽约证券交易所	美国	1,527	1,369,795.83	0.20
12	M & T BANK CORP	制造商和贸易商银行	MTB US	美国纽约证券交易所	美国	1,267	1,366,728.67	0.20
13	TYSON FOODS INC-CL A	泰森食品公司	TSN US	美国纽约证券交易所	美国	3,350	1,364,204.93	0.20
14	CAESARS ENTERTAINMENT INC	西泽娱乐公司	CZR US	纳斯达克证券交易所	美国	4,815	1,363,699.64	0.20
15	AT&T INC	美国电话电报	T US	美国纽约证券交易所	美国	10,002	1,362,203.87	0.20

		公司		交易所				
16	PRU NTIAL FINAN CIAL INC	美国保 德信金 融集团	PRU US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,628	1,359,688.82	0.20
17	SCHLU MBERG ER LTD	斯伦贝 谢公司	SLB US	美国纽 约证券 交易所	美国	4,035	1,356,738.18	0.20
18	AVALO NBAY COMMU NITIE S INC	艾美隆 海湾社 区	AVB US	美国纽 约证券 交易所	美国	920	1,356,506.56	0.20
19	AUTOD ESK INC	欧特克 有限公 司	ADSK US	纳斯达 克证券 交易所	美国	768	1,354,388.47	0.20
20	AMAZO N.COM INC	亚马逊 公司	AMZN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	981	1,351,086.27	0.20
21	IRON MOUNT AIN INC	铁山公 司	IRM US	美国纽 约证券 交易所	美国	2,114	1,350,219.87	0.20
22	CHEVR ON CORP	雪佛龙 公司	CVX US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,209	1,347,761.83	0.20
23	WELLS FARGO & CO	富国银 行	WFC US	美国纽 约证券 交易所	美国	3,176	1,344,275.83	0.20
24	TARGA RESOU RCES CORP	Targa 资源公 司	TRGP US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,458	1,338,136.81	0.20
25	ROCKW ELL AUTOM ATION INC	罗克韦 尔自动 化公司	ROK US	美国纽 约证券 交易所	美国	682	1,337,992.27	0.20
26	TRUIS T FINAN CIAL CORP	Truist 金融公 司	TFC US	美国纽 约证券 交易所	美国	4,831	1,337,588.83	0.20

27	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	西方石油公司	OXY US	美国纽约证券交易所	美国	2,975	1,336,376.56	0.20
28	MCCORMICK & CO-NONVTG SHRS	味好美有限公司	MKC US	美国纽约证券交易所	美国	2,643	1,336,235.23	0.20
29	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	纽约梅隆银行	BK US	美国纽约证券交易所	美国	3,130	1,335,959.28	0.20
30	SERVICENOW INC	ServiceNow 公司	NOW US	美国纽约证券交易所	美国	238	1,334,332.66	0.20
31	UDR INC	UDR 不动产信托公司	UDR US	美国纽约证券交易所	美国	4,549	1,334,075.31	0.20
32	AFLAC INC	家庭人寿保险公司	AFL US	美国纽约证券交易所	美国	2,095	1,333,455.99	0.20
33	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	PNC 金融服务集团公司	PNC US	美国纽约证券交易所	美国	1,203	1,333,014.06	0.20
34	MOODY'S CORP	穆迪公司	MCO US	美国纽约证券交易所	美国	444	1,331,948.46	0.20
35	CUMMINS INC	康明斯公司	CMI US	美国纽约证券交易所	美国	673	1,328,249.44	0.20
36	EVERGY INC	Evergy 公司	EVERG US	纳斯达克证券交易所	美国	3,516	1,327,313.19	0.20
37	FORD MOTOR CO	福特汽车公司	F US	美国纽约证券交易所	美国	14,850	1,327,145.57	0.20

38	ROYAL CARIB BEAN CRUIS ES LTD	皇家加 勒比国 际游轮 有限公 司	RCL US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,168	1,327,111.65	0.20
39	DEVON ENERG Y CORP	戴文能 源公司	DVN US	美国纽 约证券 交易所	美国	3,927	1,326,581.13	0.20
40	CITIG ROUP INC	花旗集 团	C US	美国纽 约证券 交易所	美国	2,924	1,322,427.91	0.20
41	LOCKH EED MARTI N CORP	洛克希 德马丁 公司	LMT US	美国纽 约证券 交易所	美国	397	1,321,584.53	0.20
42	ELEVA NCE HEALT H INC	Elevan ce 健 康公司	ELV US	美国纽 约证券 交易所	美国	342	1,320,710.92	0.20
43	CORPA Y INC	Corpay 公司	CPAY US	美国纽 约证券 交易所	美国	695	1,319,562.30	0.20
44	PALO ALTO NETWO RKS INC	Palo Alto Networ ks 公 司	PANW US	纳斯达 克证券 交易所	美国	546	1,319,166.83	0.20
45	ARIST A NETWO RKS INC	ARISTA 网络公 司	ANET US	美国纽 约证券 交易所	美国	528	1,318,838.86	0.20
46	HUNTI NGTON BANCS HARES INC	亨廷顿 银行	HBAN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	14,027	1,317,573.28	0.20
47	JPMOR GAN CHASE & CO	摩根大 通	JPM US	美国纽 约证券 交易所	美国	914	1,317,500.44	0.20
48	MOSAI	美盛公	MOS US	美国纽	美国	6,388	1,315,701.35	0.20

	C CO/TH E	司		约证 券交 易所				
49	L3HAR RIS TECHN OLOGI ES INC	L3 哈 里斯科 技公司	LHX US	美国纽 约证 券交 易所	美国	822	1,315,641.20	0.20
50	FAIR ISAAC CORP	Fair Isaac 公司	FICO US	美国纽 约证 券交 易所	美国	124	1,315,563.38	0.20
51	KEYCO RP	科凯国 际集团	KEY US	美国纽 约证 券交 易所	美国	12,987	1,315,217.23	0.20
52	TYLER TECHN OLOGI ES INC	泰勒科 技公司	TYL US	美国纽 约证 券交 易所	美国	367	1,315,038.99	0.20
53	REPUB LIC SERVI CES INC	共和废 品处理 公司	RSG US	美国纽 约证 券交 易所	美国	949	1,314,386.17	0.20
54	ALLST ATE CORP	好事达 保险公 司	ALL US	美国纽 约证 券交 易所	美国	1,155	1,314,233.95	0.20
55	TE CONNE CTIVI TY LTD	泰科电 子有限 公司	TEL US	美国纽 约证 券交 易所	美国	1,224	1,312,231.46	0.20
56	HESS CORP	赫斯公 司	HES US	美国纽 约证 券交 易所	美国	1,248	1,312,079.23	0.20
57	DIGIT AL REALT Y TRUST INC	数字房 地产信 托公司	DLR US	美国纽 约证 券交 易所	美国	1,210	1,311,192.23	0.20
58	COCA- COLA CO/TH	可口可 乐公司	KO US	美国纽 约证 券交 易所	美国	2,890	1,310,964.17	0.20

	E							
59	UNITE DHEAL TH GROUP INC	联合健 康集团 公司	UNH US	美国纽 约证券 交易所	美国	361	1,310,211.29	0.20
60	EPAM SYSTE MS INC	亿盘系 统公司	EPAM US	美国纽 约证券 交易所	美国	977	1,309,788.03	0.20
61	APA CORP	阿帕奇 公司	APA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	6,237	1,308,603.63	0.20
62	COGNI ZANT TECH SOLUT IONS- A	高知特 科技公司	CTSH US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,700	1,308,480.48	0.20
63	ACCEN TURE PLC- CL A	埃森哲 公司	ACN US	美国纽 约证券 交易所	美国	605	1,308,217.14	0.20
64	EDWAR DS LIFES CIENC ES CORP	爱德华 兹生命 科学公 司	EW US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,987	1,308,047.10	0.20
65	NISOU RCE INC	尼索思 公司	NI US	美国纽 约证券 交易所	美国	6,369	1,307,702.87	0.20
66	ONEOK INC	欧尼克 公司	OKE US	美国纽 约证券 交易所	美国	2,250	1,307,678.72	0.20
67	EBAY INC	eBay 公司	EBAY US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,415	1,307,438.54	0.20
68	AMERI PRISE FINAN CIAL INC	阿默普 莱斯金 融公司	AMP US	美国纽 约证券 交易所	美国	429	1,306,089.51	0.19
69	LIVE NATIO	理想国 演艺股	LYV US	美国纽 约证券	美国	1,955	1,306,069.48	0.19

	N ENTER TAINM ENT IN	份有限 公司		交易所				
70	GLOBE LIFE INC	环球人 寿公司	GL US	美国纽 约证 券交 易所	美国	2,227	1,305,897.44	0.19
71	PEPSI CO INC	百事公 司	PEP US	纳斯 达克 证 券交 易所	美国	1,111	1,305,895.09	0.19
72	PINNA CLE WEST CAPIT AL	品尼高 西方资 本公司	PNW US	美国纽 约证 券交 易所	美国	2,399	1,305,883.62	0.19
73	CONAG RA BRAND S INC	康尼格 拉品牌 公司	CAG US	美国纽 约证 券交 易所	美国	6,445	1,305,393.86	0.19
74	EXXON MOBIL CORP	埃克森 美孚公 司	XOM US	美国纽 约证 券交 易所	美国	1,590	1,304,495.17	0.19
75	HONEY WELL INTER NATIO NAL INC	霍尼韦 尔国际 公司	HON US	纳斯 达克 证 券交 易所	美国	857	1,304,231.34	0.19
76	COTER RA ENERG Y INC	科特拉 能源公 司	CTRA US	美国纽 约证 券交 易所	美国	6,861	1,304,082.32	0.19
77	GILEA D SCIEN CES INC	吉利德 科学公 司	GILD US	纳斯 达克 证 券交 易所	美国	2,666	1,303,593.35	0.19
78	CORTE VA INC	科迪华 公司	CTVA US	美国纽 约证 券交 易所	美国	3,390	1,303,182.42	0.19
79	C. H. ROBIN SON WORLD	罗宾升 国际联 运股份 有限公	CHRW US	纳斯 达克 证 券交 易所	美国	2,075	1,303,128.25	0.19

	WIDE INC	司						
80	HILTON WORLD WIDE HOLDI NGS IN	希尔顿 全球控 股公司	HLT US	美国纽 约证 券交 易所	美国	836	1,300,036.65	0.19
81	BORGW ARNER INC	博格华 纳公司	BWA US	美国纽 约证 券交 易所	美国	5,658	1,300,027.53	0.19
82	DOLLA R GENER AL CORP	达乐公 司	DG US	美国纽 约证 券交 易所	美国	1,379	1,299,537.56	0.19
83	FMC CORP	富美实 公司	FMC US	美国纽 约证 券交 易所	美国	3,166	1,298,526.48	0.19
84	MARAT HON OIL CORP	马拉松 石油公 司	MRO US	美国纽 约证 券交 易所	美国	6,355	1,298,487.64	0.19
85	INTUI T INC	财捷公 司	INTU US	纳斯 达克 证 券交 易所	美国	277	1,297,413.77	0.19
86	CARMA X INC	车美仕 公司	KMX US	美国纽 约证 券交 易所	美国	2,481	1,296,767.87	0.19
87	TARGE T CORP	塔吉特 公司	TGT US	美国纽 约证 券交 易所	美国	1,229	1,296,658.26	0.19
88	MID- AMERI CA APART MENT COMM	MAA 房 产信托	MAA US	美国纽 约证 券交 易所	美国	1,275	1,295,850.01	0.19
89	UNITE D RENTA LS INC	美国联 合租赁 有限公 司	URI US	美国纽 约证 券交 易所	美国	281	1,295,161.42	0.19
90	O'REI	奥莱利	ORLY	纳斯 达克	美国	172	1,294,528.49	0.19

	LLY AUTOM OTIVE INC	汽车股 份有限 公司	US	克 证 券 交易 所				
91	NASDA Q INC	纳斯达 克公司	NDAQ US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	3,014	1,294,395.36	0.19
92	DUKE ENERG Y CORP	杜克能 源公司	DUK US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	1,812	1,294,346.33	0.19
93	AMGEN INC	安进公 司	AMGN US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	581	1,293,752.59	0.19
94	COMCA ST CORP- CLASS A	康卡斯 特公司	CMCSA US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	4,634	1,293,282.15	0.19
95	VIATR IS INC	晖致公 司	VTRS US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	17,061	1,292,505.26	0.19
96	CHART ER COMMU NICAT IONS INC-A	特许通 讯公司	CHTR US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	606	1,291,160.65	0.19
97	INTUI TIVE SURGI CAL INC	直觉外 科手术 公司	ISRG US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	407	1,290,335.29	0.19
98	UNIVE RSAL HEALT H SERVI CES-B	环球健 康服务 公司	UHS US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	979	1,290,281.98	0.19
99	CORNI NG INC	康宁公 司	GLW US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	4,658	1,289,689.25	0.19
100	DEERE & CO	迪尔公 司	DE US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	484	1,288,788.56	0.19

101	QORVO INC	科沃公 司	QRVO US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,558	1,288,456.45	0.19
102	CITIZ ENS FINAN CIAL GROUP	公民金 融集团	CFG US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	5,012	1,286,974.36	0.19
103	LOEWS CORP	洛斯保 险公司	L US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,416	1,286,899.39	0.19
104	HUMAN A INC	哈门那 公司	HUM US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	483	1,286,194.62	0.19
105	CISCO SYSTE MS INC	思科	CSCO US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	3,798	1,285,981.03	0.19
106	MONST ER BEVER AGE CORP	怪物饮 料公司	MNST US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	3,612	1,285,812.98	0.19
107	EQUIT Y RESID ENTIA L	公平住 屋公司	EQR US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,601	1,285,342.18	0.19
108	ROSS STORE S INC	罗斯百 货公司	ROST US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,241	1,285,262.22	0.19
109	CSX CORP	CSX 运 输公司	CSX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	5,391	1,285,168.36	0.19
110	EXTRA SPACE STORA GE INC	额外空 间仓储 公司	EXR US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,160	1,284,788.15	0.19
111	VALER O ENERG Y CORP	瓦莱罗 能源公 司	VLO US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,150	1,284,776.74	0.19
112	AIRBN	爱彼迎	ABNB	纳 斯 达	美国	1,188	1,283,796.38	0.19

	B INC- CLASS A		US	克 证 券 交 易 所				
113	BUNGE GLOBA L SA	邦吉有 限公司	BG US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,687	1,283,686.27	0.19
114	PROGR ESSIV E CORP	前进保 险公司	PGR US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	867	1,283,426.71	0.19
115	GARTN ER INC	加特纳 公司	IT US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	401	1,283,344.68	0.19
116	ARCH CAPIT AL GROUP LTD	艾奇资 本集团	ACGL US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,784	1,282,736.77	0.19
117	UBER TECHN OLOGI ES INC	优步	UBER US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,476	1,282,508.14	0.19
118	VERIZ ON COMMU NICAT IONS INC	威瑞森 电信公 司	VZ US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	4,354	1,279,680.80	0.19
119	CHURC H & DWIGH T CO INC	丘奇& 德怀特 公司	CHD US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,731	1,279,047.37	0.19
120	HOLOG IC INC	豪洛捷 公司	HOLX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,416	1,278,462.40	0.19
121	WILLI AMS COS INC	威廉姆 斯公司	WMB US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	4,214	1,276,374.25	0.19
122	LKQ CORP	LKQ 公 司	LKQ US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	4,306	1,276,313.95	0.19

123	HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	亨廷顿 英戈尔斯工业 公司	HII US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	727	1,276,280.96	0.19
124	PHILLIPS 66	菲利浦 66	PSX US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,268	1,275,722.57	0.19
125	METLIFE INC	大都会 人寿保 险公司	MET US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,550	1,275,586.73	0.19
126	S&P GLOBAL INC	标普全 球公司	SPGI US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	401	1,274,599.67	0.19
127	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	哈特福 德金融 服务公 司	HIG US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,776	1,272,554.57	0.19
128	BIOGEN INC	生物基 因公司	BIIB US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	770	1,272,143.78	0.19
129	ELI LILLY & CO	礼来公 司	LLY US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	197	1,271,135.05	0.19
130	MOTOROLA SOLUTIONS INC	摩托罗 拉解决 方案公 司	MSI US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	462	1,271,101.13	0.19
131	ALTRIA GROUP INC	高特利 集团公 司	MO US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,915	1,270,909.77	0.19
132	WARNER BROS DISCOVERY INC	华纳兄 弟探索 公司	WBD US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	23,966	1,270,758.61	0.19
133	NORTHROP GRUMM	诺斯罗 普-格 鲁曼公	NOC US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	409	1,270,733.74	0.19

	AN CORP	司						
134	AMERI CAN EXPRES S CO	美国运 通公司	AXP US	美国纽 约证券 交易所	美国	770	1,270,662.12	0.19
135	INCYT E CORP	因塞特 医疗公 司	INCY US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,941	1,270,590.28	0.19
136	OTIS WORLD WIDE CORP	奥的斯	OTIS US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,852	1,270,519.72	0.19
137	PAYPA L HOLDI NGS INC	Paypal 控股有 限公司	PYPL US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,072	1,270,481.52	0.19
138	F5 INC	F5 公 司	FFIV US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,035	1,270,409.47	0.19
139	CAMPB ELL SOUP CO	康宝浓 汤公司	CPB US	美国纽 约证券 交易所	美国	3,944	1,270,205.00	0.19
140	DANA HER CORP	丹纳赫 公司	DHR US	美国纽 约证券 交易所	美国	713	1,269,589.89	0.19
141	JACK HENRY & ASSOC IATES INC	杰克亨 利公司	JKHY US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,073	1,269,564.30	0.19
142	GLOBA L PAYME NTS INC	环汇有 限公司	GPN US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,842	1,269,435.59	0.19
143	MOLSO N COORS BEVER AGE CO -	莫尔森 库尔斯 饮料公 司	TAP US	美国纽 约证券 交易所	美国	3,503	1,268,980.12	0.19

	B							
144	HALLIBURTON CO	哈利伯顿公司	HAL US	美国纽约证券交易所	美国	5,270	1,268,717.21	0.19
145	BOEING CO/TH E	波音公司	BA US	美国纽约证券交易所	美国	978	1,268,611.59	0.19
146	WILLIS TOWERS WATSON PLC	韦莱韬悦股份有限公司	WTW US	纳斯达克证券交易所	美国	679	1,268,520.94	0.19
147	NEWMONT CORP	纽蒙特公司	NEM US	美国纽约证券交易所	美国	4,250	1,268,196.24	0.19
148	EVEREST GROUP LTD	艾弗再保险有限公司	EG US	美国纽约证券交易所	美国	467	1,268,116.71	0.19
149	COLGATE-PALMOLIVE CO	高露洁公司	CL US	美国纽约证券交易所	美国	1,833	1,267,674.70	0.19
150	CBRE GROUP INC - A	世邦魏理仕集团公司	CBRE US	美国纽约证券交易所	美国	1,996	1,267,598.02	0.19
151	LAM RESEARCH CORP	拉姆研究公司	LRCX US	纳斯达克证券交易所	美国	167	1,267,358.49	0.19
152	GEN DIGITAL INC	数字世代公司	GEN US	纳斯达克证券交易所	美国	7,114	1,266,487.38	0.19
153	BLACKSTONE INC	黑石公司	BX US	美国纽约证券交易所	美国	1,435	1,266,097.40	0.19
154	FRANKLIN RESOURCES	富兰克林资源公司	BEN US	美国纽约证券交易所	美国	7,948	1,265,989.07	0.19

	INC							
155	ZEBRA TECHN OLOGIES CORP- CL A	斑马技 术公司	ZBRA US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	575	1,265,967.34	0.19
156	TAPES TRY INC	挂毯公 司	TPR US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	4,150	1,265,566.45	0.19
157	ROPER TECHN OLOGIES INC	儒博科 技公司	ROP US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	315	1,265,384.01	0.19
158	VENTA S INC	芬塔公 司	VTR US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,463	1,265,102.36	0.19
159	LAS VEGAS SANDS CORP	金沙集 团	LVS US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	4,011	1,264,912.57	0.19
160	PUBLI C STORA GE	大众仓 储信托 公司	PSA US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	617	1,264,864.82	0.19
161	ALLIA NT ENERG Y CORP	美国联 合能源 公司	LNT US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	3,486	1,264,560.86	0.19
162	US BANCO RP	美国合 众银行	USB US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	4,468	1,264,148.93	0.19
163	TERAD YNE INC	泰瑞达 公司	TER US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,196	1,263,972.47	0.19
164	ORACL E CORP	甲骨文 公司	ORCL US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,256	1,263,918.02	0.19
165	OMNIC OM GROUP	宏盟集 团	OMC US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,977	1,263,844.62	0.19
166	OLD	统领货	ODFL	纳 斯 达	美国	1,004	1,263,627.25	0.19

	DOMINION FREIGHT LINE	运线公司	US	克证券交易所				
167	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	IBM 公司	IBM US	美国纽约证券交易所	美国	1,025	1,263,394.56	0.19
168	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	瑞杰金融公司	RJF US	美国纽约证券交易所	美国	1,434	1,263,273.33	0.19
169	ELECTRONIC ARTS INC	艺电公司	EA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,272	1,263,066.80	0.19
170	NUCOR CORP	纽柯钢铁公司	NUE US	美国纽约证券交易所	美国	1,121	1,262,923.69	0.19
171	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	微芯科技公司	MCHP US	纳斯达克证券交易所	美国	1,936	1,262,469.86	0.19
172	PTC INC	参数科技公司	PTC US	纳斯达克证券交易所	美国	975	1,262,357.61	0.19
173	ARTHUR J GALLAGHER & CO	亚瑟加拉格尔有限公司	AJG US	美国纽约证券交易所	美国	683	1,262,218.50	0.19
174	NETAPP INC	美国网存公司	NTAP US	纳斯达克证券交易所	美国	1,375	1,262,156.28	0.19
175	GARMIN LTD	佳明公司	GRMN US	美国纽约证券交易所	美国	1,087	1,262,113.80	0.19
176	CLOROX	高乐氏公司	CLX US	美国纽约证券交易所	美国	1,297	1,261,454.93	0.19

	COMPANY			交易所				
177	TRIMBLE INC	天宝公司	TRMB US	纳斯达克证券交易所	美国	3,165	1,261,349.53	0.19
178	EXPEDITORS INTL WASH INC	康捷国际物流公司	EXPD US	纳斯达克证券交易所	美国	1,418	1,261,103.08	0.19
179	MARATHON PETROLEUM CORP	马拉松原油公司	MPC US	美国纽约证券交易所	美国	1,020	1,261,084.41	0.19
180	GENERAL ELECTRIC CO	通用电气航空航天公司	GE US	美国纽约证券交易所	美国	1,113	1,260,970.45	0.19
181	REGIONS FINANCIAL CORP	地区金融公司	RF US	美国纽约证券交易所	美国	8,828	1,260,824.42	0.19
182	PFIZER INC	辉瑞制药有限公司	PFE US	美国纽约证券交易所	美国	6,320	1,260,257.70	0.19
183	VERISK ANALYTICS INC	Verisk Analytics 公司	VRSK US	纳斯达克证券交易所	美国	656	1,260,194.98	0.19
184	CONSTELLATION BRANDS INC-A	星座品牌公司	STZ US	美国纽约证券交易所	美国	687	1,259,671.59	0.19
185	FORTIVE CORP	Fortive 公司	FTV US	美国纽约证券交易所	美国	2,385	1,259,508.67	0.19
186	GE HEALTHCARE	奇异医疗保健科技公	GEHC US	纳斯达克证券交易所	美国	2,268	1,259,466.34	0.19

	TECHNOLOGY	司						
187	UNION PACIFIC CORP	联合太平洋公司	UNP US	美国纽约证券交易所	美国	781	1,259,370.13	0.19
188	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	芯源系统有限公司	MPWR US	纳斯达克证券交易所	美国	215	1,259,029.04	0.19
189	WASTE MANAGEMENT INC	美国废物管理公司	WM US	美国纽约证券交易所	美国	828	1,258,917.29	0.19
190	MARSH & MCLENNAN COS	威达信集团	MMC US	美国纽约证券交易所	美国	838	1,258,474.29	0.19
191	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	波克夏海瑟威公司	BRK/B US	美国纽约证券交易所	美国	434	1,258,245.09	0.19
192	NORTHERN TRUST CORP	北美信托公司	NTRS US	纳斯达克证券交易所	美国	2,102	1,258,065.21	0.19
193	MORGAN STANLEY	摩根士丹利	MS US	美国纽约证券交易所	美国	1,816	1,257,859.10	0.19
194	ABBVIE INC	艾伯维公司	ABBV US	美国纽约证券交易所	美国	1,029	1,257,838.01	0.19
195	DOVER CORP	都福公司	DOV US	美国纽约证券交易所	美国	978	1,257,738.38	0.19
196	HUNT (JB) TRANSPORT	JB亨特运输服务公司	JBHT US	纳斯达克证券交易所	美国	1,103	1,257,737.66	0.19

	SVCS INC							
197	INTEL CORP	英特尔 公司	INTC US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	5,698	1,257,645.44	0.19
198	DARDE N RESTA URANT S INC	达登饭 店集团 公司	DRI US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,166	1,257,446.32	0.19
199	ZOETI S INC	硕腾公 司	ZTS US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,017	1,256,505.58	0.19
200	ARCHE R- DANIE LS- MIDLA ND CO	阿彻丹 尼尔斯 米德兰 公司	ADM US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,916	1,256,256.71	0.19
201	DAVIT A INC	达维塔 公司	DVA US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,272	1,256,177.18	0.19
202	CHUBB LTD	丘博保 险有限 公司	CB US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	691	1,256,171.76	0.19
203	GODAD DY INC - CLASS A	GoDadd y 公司	GDDY US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,261	1,255,559.07	0.19
204	ALLEG ION PLC	安朗杰 有限公 司	ALLE US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,491	1,255,468.85	0.19
205	ADVAN CED MICRO DEVIC ES	美国超 威半导 体公司	AMD US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,086	1,255,457.52	0.19
206	STEEL DYNAM ICS INC	钢铁动 态公司	STLD US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,360	1,255,172.02	0.19
207	LEIDO S HOLDI	雷多斯 控股公 司	LDOS US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,207	1,254,866.70	0.19

	NGS INC							
208	IDEX CORP	IDEX 公司	IEX US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	875	1,254,673.14	0.19
209	TJX COMPA NIES INC	TJX 公 司	TJX US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,599	1,254,672.43	0.19
210	CBOE GLOBA L MARKE TS INC	芝加 哥 选 择 权 交 易 所 全 球 市 场 公 司	CBOE US	巴 兹 全 球 市 场	美国	1,035	1,254,403.03	0.19
211	PUBLI C SERVI CE ENTER PRISE GP	公 共 服 务 企 业 集 团 公 司	PEG US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,388	1,254,285.44	0.19
212	KINDE R MORGA N INC	金 德 摩 根 公 司	KMI US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	8,857	1,254,235.48	0.19
213	FACTS ET RESEA RCH SYSTE MS INC	辉 盛 研 究 系 统 公 司	FDS US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	431	1,254,062.87	0.19
214	MOHAW K INDUS TRIES INC	莫 霍 克 工 业 公 司	MHK US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,548	1,253,157.41	0.19
215	BANK OF AMERI CA CORP	美 国 银 行	BAC US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	4,421	1,253,056.57	0.19
216	NORDS ON	诺 信 公 司	NDSN US	纳 斯 达 克 证 券	美国	758	1,252,966.41	0.19

	CORP			交易所				
217	INVIT ATION HOMES INC	邀请回 家公司	INVH US	美国纽 约证 券交 易所	美国	4,898	1,252,814.61	0.19
218	STATE STREE T CORP	道富公 司	STT US	美国纽 约证 券交 易所	美国	2,375	1,252,535.10	0.19
219	GENER AL MILLS INC	通用磨 坊公司	GIS US	美国纽 约证 券交 易所	美国	2,778	1,252,437.32	0.19
220	3M CO	3M 公 司	MMM US	美国纽 约证 券交 易所	美国	1,719	1,251,926.54	0.19
221	SMURF IT WESTR OCK PLC	SMURFI T WESTRO CK 公 司	SW US	美国纽 约证 券交 易所	美国	3,494	1,251,526.23	0.19
222	ZIMME R BIOME T HOLDI NGS INC	齐默尔 控股公 司	ZBH US	美国纽 约证 券交 易所	美国	1,618	1,251,477.06	0.19
223	GENUI NE PARTS CO	通用配 件公司	GPC US	美国纽 约证 券交 易所	美国	1,269	1,250,953.52	0.19
224	REGEN ERON PHARM ACEUT ICALS	再生元 制药股 份有限 公司	REGN US	纳斯 达克 证 券交 易所	美国	167	1,250,910.26	0.19
225	CF INDUS TRIES HOLDI NGS INC	CF 实 业控 股公 司	CF US	美国纽 约证 券交 易所	美国	2,368	1,250,868.57	0.19
226	GOLDM AN	高盛集 团	GS US	美国纽 约证 券	美国	388	1,250,754.54	0.19

	SACHS GROUP INC			交易所				
227	COPART INC	科帕特公司	CPRT US	纳斯达克证券交易所	美国	3,240	1,250,599.46	0.19
228	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	阿卡迈技术公司	AKAM US	纳斯达克证券交易所	美国	1,947	1,249,939.23	0.19
229	EXPEDIA GROUP INC	亿客行	EXPE US	纳斯达克证券交易所	美国	1,392	1,249,884.50	0.19
230	DUPONT DE NEMOURS INC	杜邦公司	DD US	美国纽约证券交易所	美国	2,178	1,249,379.50	0.19
231	FREEMORTEMCMORMAN INC	自由港麦克莫兰公司	FCX US	美国纽约证券交易所	美国	3,606	1,248,983.10	0.19
232	WALMART INC	沃尔玛公司	WMT US	美国纽约证券交易所	美国	2,588	1,248,853.97	0.19
233	CAMDEN PROPERTY TRUST	卡姆登物业信托	CPT US	美国纽约证券交易所	美国	1,606	1,248,833.87	0.19
234	TELEFLEX INC	泰利福公司	TFX US	美国纽约证券交易所	美国	833	1,248,650.21	0.19
235	MICROSOFT CORP	微软公司	MSFT US	纳斯达克证券交易所	美国	392	1,248,646.72	0.19
236	SYSCO CORP	西斯科公司	SYY US	美国纽约证券交易所	美国	2,454	1,248,551.65	0.19
237	HOST HOTEL	豪斯特酒店及	HST US	纳斯达克证券交易所	美国	9,737	1,247,697.86	0.19

	S & RESOR TS INC	度假村 公司		交易所				
238	UNITE D PARCE L SERVI CE-CL B	联合包 裹服务 公司	UPS US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,279	1,247,412.00	0.19
239	SOUTH WEST AIRLI NES CO	西南航 空公司	LUV US	美国纽 约证券 交易所	美国	6,113	1,246,426.93	0.19
240	BRIST OL- MYERS SQUIB B CO	百时美 施贵宝 公司	BMJ US	美国纽 约证券 交易所	美国	4,211	1,246,354.95	0.19
241	LYOND ELLBA SELL INDU- CL A	利安德 巴塞尔 工业公 司	LYB US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,828	1,246,238.43	0.19
242	NETFL IX INC	奈飞公 司	NFLX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	259	1,245,721.31	0.19
243	WYNN RESOR TS LTD	永利度 假公司	WYNN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,953	1,245,718.32	0.19
244	GE VERNO VA INC	奇异维 诺瓦公 司	GEV US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,019	1,245,541.50	0.19
245	TEXTR ON INC	德事隆 集团	TXT US	美国纽 约证券 交易所	美国	2,035	1,245,230.84	0.19
246	INTL FLAVO RS & FRAGR ANCES	国际香 料香精 公司	IFF US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,835	1,245,125.72	0.19

247	DOLLAR TREE INC	美元树	DLTR US	纳斯达克证券交易所	美国	1,636	1,244,878.92	0.19
248	ILLINOIS TOOL WORKS	伊利诺伊工具集团	ITW US	美国纽约证券交易所	美国	737	1,244,620.93	0.19
249	KENVUE INC	Kenvue 公司	KVUE US	美国纽约证券交易所	美国	9,602	1,244,085.28	0.19
250	INSULET CORP	Insulet 公司	PODD US	纳斯达克证券交易所	美国	865	1,244,032.83	0.19
251	NVR INC	NVR 公司	NVR US	美国纽约证券交易所	美国	23	1,243,889.44	0.19
252	ROLLINS INC	罗林斯公司	ROL US	美国纽约证券交易所	美国	3,577	1,243,782.18	0.19
253	SCHWAB (CHARLES) CORP	嘉信理财公司	SCHW US	美国纽约证券交易所	美国	2,368	1,243,611.78	0.19
254	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	是德科技公司	KEYS US	美国纽约证券交易所	美国	1,276	1,243,576.71	0.19
255	AXON ENTERPRISE INC	泰瑟国际公司	AXON US	纳斯达克证券交易所	美国	593	1,243,514.85	0.19
256	WRBERKLEY CORP	W. R. 柏克利公司	WRB US	美国纽约证券交易所	美国	2,220	1,243,253.16	0.19
257	CINTAS CORP	信达思公司	CTAS US	纳斯达克证券交易所	美国	249	1,242,662.63	0.19
258	SYNOPSYS INC	新思科技公司	SNPS US	纳斯达克证券交易所	美国	293	1,242,575.97	0.19

259	STERIS PLC	思泰瑞有限公司	STE US	美国纽约证券交易所	美国	794	1,242,306.43	0.19
260	MCDONALD'S CORP	麦当劳公司	MCD US	美国纽约证券交易所	美国	684	1,242,276.50	0.19
261	BOOKING HOLDINGS INC	缤客控股公司	BKNG US	纳斯达克证券交易所	美国	44	1,242,244.00	0.19
262	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	宣伟公司	SHW US	美国纽约证券交易所	美国	584	1,242,080.94	0.19
263	AMERICAN AIRLINES GROUP INC	美国航空集团公司	AAL US	纳斯达克证券交易所	美国	15,382	1,242,044.88	0.19
264	AVERY DENNISON CORP	艾利丹尼森公司	AVY US	美国纽约证券交易所	美国	797	1,241,945.03	0.19
265	CENTROPOINT ENERGY INC	中点能源公司	CNP US	美国纽约证券交易所	美国	5,624	1,241,713.20	0.19
266	JOHNSON & JOHNSON	强生公司	JNJ US	美国纽约证券交易所	美国	1,192	1,241,650.48	0.19
267	CONOCOPHILIPS	康菲石油公司	COP US	美国纽约证券交易所	美国	1,522	1,240,678.67	0.19
268	EQUIFAX INC	艾可菲公司	EFX US	美国纽约证券交易所	美国	718	1,240,678.10	0.19
269	BOSTON SCIENTIFIC	波士顿科学公司	BSX US	美国纽约证券交易所	美国	2,260	1,240,366.80	0.19

	TIFIC CORP							
270	COSTA R GROUP INC	科斯塔 集团	CSGP US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,347	1,240,110.09	0.19
271	PARKE R HANNI FIN CORP	帕克汉 尼汾公 司	PH US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	344	1,240,053.51	0.19
272	KELLA NOVA	家乐氏 公司	K US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,016	1,239,798.65	0.18
273	AMERI CAN INTER NATIO NAL GROUP	美国国 际集团 公司	AIG US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,343	1,239,666.38	0.18
274	CDW CORP/ DE	CDW 公 司	CDW US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	777	1,239,519.28	0.18
275	MSCI INC	MSCI 明晟	MSCI US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	361	1,239,434.26	0.18
276	TEXAS INSTR UMENT S INC	德州仪 器公司	TXN US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	894	1,239,420.51	0.18
277	ABBOT T LABOR ATORI ES	雅培制 药公司	ABT US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,673	1,238,933.10	0.18
278	ETSY INC	Etsy 公司	ETSY US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,947	1,238,738.04	0.18
279	APTIV PLC	安波福 有限公 司	APT US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,468	1,238,613.32	0.18
280	PAYCO M SOFTW ARE	Paycom 软件公 司	PAYC US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,215	1,238,592.23	0.18

	INC							
281	WELLTOWER INC	WELLTOWER 房地产信托	WELL US	美国纽约证券交易所	美国	1,667	1,238,529.16	0.18
282	SBA COMMUNICATIONS CORP	SBA 通信公司	SBAC US	纳斯达克证券交易所	美国	885	1,238,106.89	0.18
283	MARKET TAXES HOLDINGS INC	Market Axess 控股公司	MKTX US	纳斯达克证券交易所	美国	866	1,237,632.82	0.18
284	SEMPRA	桑普拉	SRE US	美国纽约证券交易所	美国	2,283	1,237,533.04	0.18
285	NXP SEMICONDUCTORS NV	恩智浦半导体公司	NXPI US	纳斯达克证券交易所	美国	645	1,236,949.14	0.18
286	HORMEL FOODS CORP	荷美尔食品公司	HRL US	美国纽约证券交易所	美国	5,692	1,236,849.58	0.18
287	T-MOBILE US INC	T-Mobile 美国公司	TMUS US	纳斯达克证券交易所	美国	985	1,236,765.63	0.18
288	PROLOGIS INC	安博	PLD US	美国纽约证券交易所	美国	1,545	1,236,634.85	0.18
289	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	第一资本金融公司	COF US	美国纽约证券交易所	美国	1,253	1,236,341.94	0.18
290	ENTERGY CORP	安特吉公司	ETR US	美国纽约证券交易所	美国	1,621	1,236,122.08	0.18
291	ATMOS	ATMOS	ATO US	美国纽	美国	1,485	1,234,541.71	0.18

	ENERGY CORP	能源公司		约证券交易所				
292	AMERICAN WATER WORKS CO INC	美国水业股份有限公司	AWK US	美国纽约证券交易所	美国	1,341	1,234,387.13	0.18
293	AGILENT TECHNOLOGIES INC	安捷伦科技有限公司	A US	美国纽约证券交易所	美国	1,336	1,234,259.70	0.18
294	KLA CORP	科天半导体公司	KLAC US	纳斯达克证券交易所	美国	210	1,233,984.75	0.18
295	CINNATI FINANCIAL CORP	辛辛那提金融公司	CINF US	纳斯达克证券交易所	美国	1,466	1,233,895.67	0.18
296	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	Healthpeak Properties 公司	DOC US	美国纽约证券交易所	美国	8,830	1,233,421.02	0.18
297	TRANE TECHNOLOGIES PLC	特灵科技有限公司	TT US	美国纽约证券交易所	美国	526	1,233,058.84	0.18
298	CME GROUP INC	芝加哥交易所集团	CME US	纳斯达克证券交易所	美国	880	1,232,993.41	0.18
299	FASTENAL CO	快扣	FAST US	纳斯达克证券交易所	美国	2,752	1,232,478.00	0.18
300	AMERICAN ELECTRIC POWER	美国电力公司	AEP US	纳斯达克证券交易所	美国	1,971	1,232,477.01	0.18
301	REGEN	Regenc	REG US	纳斯达克	美国	2,780	1,232,337.75	0.18

	CY CENTE RS CORP	y Center s 公司		克 证 券 交 易 所				
302	SIMON PROPE RTY GROUP INC	西蒙地 产集团	SPG US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,139	1,232,225.15	0.18
303	FISER V INC	费哲金 融服务 公司	FI US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,160	1,232,126.80	0.18
304	INGER SOLL- RAND INC	英格索 兰公司	IR US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,903	1,231,999.37	0.18
305	FIRST ENERG Y CORP	第一能 源公司	FE US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	4,516	1,231,705.74	0.18
306	SNAP- ON INC	实耐宝 公司	SNA US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	661	1,231,359.88	0.18
307	ADOBE INC	奥多比 公司	ADBE US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	311	1,231,318.19	0.18
308	APPLI ED MATER IALS INC	应用材 料	AMAT US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	732	1,231,116.79	0.18
309	KRAFT HEINZ CO/TH E	卡夫亨 氏公司	KHC US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	5,358	1,230,333.41	0.18
310	FIFTH THIRD BANCO RP	五三银 行	FITB US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	4,730	1,230,069.29	0.18
311	SEAGA TE TECHN OLOGY HOLDI NGS	希捷科 技有限 公司	STX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,670	1,229,094.34	0.18

312	MERCK & CO. INC.	默克集团	MRK US	美国纽约证券交易所	美国	1,393	1,229,040.89	0.18
313	SKYW RKS SOLUT IONS INC	思佳讯 解决方案公司	SWKS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,618	1,228,991.29	0.18
314	CROWD STRIK E HOLDI NGS INC - A	Crowds trike 控股公司	CRWD US	纳斯达克证券交易所	美国	450	1,228,913.32	0.18
315	MONDE LEZ INTER NATIO NAL INC-A	亿滋国际有限公司	MDLZ US	纳斯达克证券交易所	美国	2,634	1,228,439.10	0.18
316	PARAM OUNT GLOBA L- CLASS B	派拉蒙 全球	PARA US	纳斯达克证券交易所	美国	16,588	1,228,299.13	0.18
317	GENER AL DYNAM ICS CORP	通用动力公司	GD US	美国纽约证券交易所	美国	594	1,228,255.23	0.18
318	AON PLC- CLASS A	怡安保险集团	AON US	美国纽约证券交易所	美国	587	1,228,171.85	0.18
319	WW GRAIN GER INC	固安捷 公司	GWW US	美国纽约证券交易所	美国	191	1,228,146.05	0.18
320	IQVIA HOLDI NGS INC	艾昆纬 控股公司	IQV US	美国纽约证券交易所	美国	815	1,228,115.83	0.18
321	GENER	通用汽	GM US	美国纽	美国	3,709	1,228,091.17	0.18

	AL MOTOR S CO	车公司		约 证 券 交 易 所				
322	SMITH (A. O.) CORP	A. O. 史 密斯	AOS US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	2, 107	1, 228, 022. 19	0. 18
323	XCEL ENERG Y INC	埃 克 西 尔 能 源 公 司	XEL US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	3, 226	1, 227, 952. 34	0. 18
324	WALT DISNE Y CO/TH E	华 特 迪 斯 尼 公 司	DIS US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1, 735	1, 227, 720. 65	0. 18
325	BROWN & BROWN INC	布 朗 保 险 经 纪 公 司	BRO US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1, 926	1, 227, 261. 04	0. 18
326	QUEST DIAGN OSTIC S INC	奎 斯 特 诊 疗 公 司	DGX US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1, 258	1, 227, 199. 61	0. 18
327	HOME DEPOT INC	家 得 宝 公 司	HD US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	500	1, 226, 664. 82	0. 18
328	MASTE RCARD INC - A	万 事 达 卡 公 司	MA US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	390	1, 226, 183. 04	0. 18
329	FORTI NET INC	飞 塔 公 司	FTNT US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2, 854	1, 225, 885. 00	0. 18
330	EMERS ON ELECT RIC CO	艾 默 生 电 气 集 团	EMR US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1, 561	1, 225, 522. 82	0. 18
331	KROGE R CO	克 罗 格 公 司	KR US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	3, 444	1, 225, 516. 83	0. 18
332	PHILI P MORRI S	菲 利 普 莫 里 斯 国 际 公 司	PM US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1, 697	1, 225, 503. 22	0. 18

	INTERNATIONAL							
333	AUTOZONE INC	汽车地带	AZO US	美国纽约证券交易所	美国	58	1,225,223.78	0.18
334	APPLE INC	苹果公司	AAPL US	纳斯达克证券交易所	美国	816	1,224,854.04	0.18
335	ECOLAB INC	艺康化工公司	ECL US	美国纽约证券交易所	美国	722	1,224,640.80	0.18
336	BAXTER INTERNATIONAL INC	百特国际有限公司	BAX US	美国纽约证券交易所	美国	5,136	1,224,378.54	0.18
337	KIMBERLY-CLARK CORP	金佰利公司	KMB US	美国纽约证券交易所	美国	1,243	1,224,260.23	0.18
338	KIMCO REALTY CORP	金克地产公司	KIM US	美国纽约证券交易所	美国	8,827	1,224,194.81	0.18
339	NRG ENERGY INC	NRG 能源公司	NRG US	美国纽约证券交易所	美国	2,206	1,224,093.18	0.18
340	REALTY INCOME CORP	Realty Income 公司	O US	美国纽约证券交易所	美国	3,251	1,223,798.56	0.18
341	MCKESSON CORP	麦克森公司	MCK US	美国纽约证券交易所	美国	294	1,223,726.86	0.18
342	COSTCO WHOLESALE CORP	好市多公司	COST US	纳斯达克证券交易所	美国	202	1,223,657.16	0.18
343	ANSYS INC	安西斯公司	ANSS US	纳斯达克证券交易所	美国	534	1,223,536.15	0.18

344	BROWN - FORMA N CORP- CLASS B	百富门 公司	BF/B US	美国纽 约证 券交 易所	美国	3,974	1,223,223.00	0.18
345	INTER PUBLI C GROUP OF COS INC	埃培智 集团	IPG US	美国纽 约证 券交 易所	美国	5,897	1,222,557.85	0.18
346	PROCT ER & GAMBL E CO/TH E	宝洁公 司	PG US	美国纽 约证 券交 易所	美国	1,040	1,222,365.93	0.18
347	PPG INDUS TRIES INC	PPG 工 业公司	PPG US	美国纽 约证 券交 易所	美国	1,362	1,221,976.66	0.18
348	META PLATF ORMS INC- CLASS A	Meta 平台公 司	META US	纳斯 达克 证 券交 易所	美国	340	1,221,781.53	0.18
349	PACKA GING CORP OF AMERI CA	美国包 装公司	PKG US	美国纽 约证 券交 易所	美国	939	1,221,703.42	0.18
350	DOMIN O'S PIZZA INC	达美乐 比萨公 司	DPZ US	美国纽 约证 券交 易所	美国	332	1,221,687.17	0.18
351	CADEN CE DESIG N SYS INC	铿腾电 子公司	CDNS US	纳斯 达克 证 券交 易所	美国	557	1,221,652.89	0.18

352	WEST PHARM ACEUT ICAL SERVI CES	West Pharma ceutic al Servic es 公 司	WST US	美国纽 约证券 交易所	美国	520	1,220,698.26	0.18
353	TRAVE LERS COS INC/T HE	旅行者 集团	TRV US	美国纽 约证券 交易所	美国	842	1,220,195.68	0.18
354	TRANS DIGM GROUP INC	TransD igm 集 团公司	TDG US	美国纽 约证券 交易所	美国	134	1,220,106.31	0.18
355	ANALO G DEVIC ES INC	亚德诺 公司	ADI US	纳斯达 克证券 交易所	美国	750	1,220,072.53	0.18
356	AMPHE NOL CORP- CL A	安费诺 公司	APH US	美国纽 约证券 交易所	美国	2,541	1,220,016.72	0.18
357	CATAL ENT INC	康泰伦 特公司	CTLT US	美国纽 约证券 交易所	美国	3,044	1,219,852.45	0.18
358	SOUTH ERN CO/TH E	南方电 力公司	SO US	美国纽 约证券 交易所	美国	2,206	1,219,533.88	0.18
359	HP INC	惠普公 司	HPQ US	美国纽 约证券 交易所	美国	4,886	1,219,450.50	0.18
360	LOWE' S COS INC	劳氏公 司	LOW US	美国纽 约证券 交易所	美国	776	1,219,231.28	0.18
361	CHARL ES RIVER LABOR ATORI ES	查尔斯 河实验 室国际 公司	CRL US	美国纽 约证券 交易所	美国	828	1,219,026.60	0.18
362	VERIS	威瑞信	VRSN	纳斯达	美国	962	1,218,993.53	0.18

	IGN INC	公司	US	克 证 券 交 易 所				
363	RALPH LAURE N CORP	拉夫劳 伦	RL US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	977	1,218,922.40	0.18
364	WABTE C CORP	美国西 屋制动 公司	WAB US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,082	1,218,754.78	0.18
365	EQUIN IX INC	易昆尼 克斯公 司	EQIX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	226	1,218,622.93	0.18
366	CROWN CASTL E INC	冠城国 际公司	CCI US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,750	1,218,504.63	0.18
367	ULTA BEAUT Y INC	ULTA 美妆公 司	ULTA US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	443	1,218,258.11	0.18
368	PPL CORP	PPL 公 司	PPL US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	6,179	1,217,609.15	0.18
369	FIDEL ITY NATIO NAL INFO SERV	富达国 民信息 服务公 司	FIS US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,266	1,217,013.42	0.18
370	EASTM AN CHEMI CAL CO	伊士曼 化工公 司	EMN US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,743	1,216,984.55	0.18
371	CONSO LIDAT ED EDISO N INC	爱迪生 联合电 气公司	ED US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,909	1,216,564.57	0.18
372	HOWME T AEROS PACE INC	Howmet 航天公 司	HWM US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,198	1,216,051.16	0.18
373	WATER S CORP	沃特世 公司	WAT US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	588	1,215,764.80	0.18

374	XYLEM INC	赛莱默 公司	XYL US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,257	1,215,026.11	0.18
375	DAYFO RCE INC	Dayfor ce 公 司	DAY US	美国纽 约证券 交易所	美国	3,436	1,214,589.17	0.18
376	INVES CO LTD	景顺集 团	IVZ US	美国纽 约证券 交易所	美国	11,390	1,214,366.81	0.18
377	AMCOR PLC	安姆科 公开有 限公司	AMCR US	美国纽 约证券 交易所	美国	17,421	1,214,245.51	0.18
378	EATON CORP PLC	伊顿公 司	ETN US	美国纽 约证券 交易所	美国	543	1,213,392.22	0.18
379	VISTR A CORP	维斯达 能源公 司	VST US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,980	1,213,269.28	0.18
380	KEURI G DR PEPPE R INC	克里格 胡椒博 士公司	KDP US	纳斯达 克证券 交易所	美国	5,097	1,213,265.01	0.18
381	CARDI NAL HEALT H INC	卡地纳 健康公 司	CAH US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,731	1,212,923.78	0.18
382	EDISO N INTER NATIO NAL	爱迪生 国际公 司	EIX US	美国纽 约证券 交易所	美国	2,370	1,212,907.95	0.18
383	CVS HEALT H CORP	西维斯 健康公 司	CVS US	美国纽 约证券 交易所	美国	2,881	1,212,638.28	0.18
384	CARRI ER GLOBA L CORP	开利全 球	CARR US	美国纽 约证券 交易所	美国	2,696	1,212,009.83	0.18
385	BLACK ROCK INC	贝莱德 集团	BLK US	美国纽 约证券 交易所	美国	216	1,211,991.59	0.18
386	HEWLE	慧与	HPE US	美国纽	美国	8,033	1,211,973.70	0.18

	TT PACKA RD ENTER PRISE			约 证 券 交 易 所				
387	CMS ENERG Y CORP	CMS 能 源公司	CMS US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,855	1,211,257.74	0.18
388	FEDER AL REALT Y INVS TRUST	FRT 信 托	FRT US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,683	1,211,075.01	0.18
389	GENER AC HOLDI NGS INC	Genera c 控股 公司	GNRC US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,285	1,210,862.56	0.18
390	UNITE D AIRLI NES HOLDI NGS INC	美国联 合航空 控股公 司	UAL US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	3,491	1,210,644.20	0.18
391	WEYER HAEUS ER CO	惠好公 司	WY US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	5,983	1,210,539.50	0.18
392	INTER CONTI NENTA L EXCHA NGE IN	洲际交 易所集 团公司	ICE US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,240	1,209,728.69	0.18
393	TAKE- TWO INTER ACTIV E SOFTW RE	TAKE- TWO 互 动软件 公司	TTWO US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,091	1,208,987.43	0.18
394	HCA	HCA 医	HCA US	美 国 纽	美国	528	1,208,960.70	0.18

	HEALTHCARE INC	疗保健公司		约证券交易所				
395	DEXCOM INC	德康医疗公司	DXCM US	纳斯达克证券交易所	美国	1,496	1,208,822.73	0.18
396	ESSEX PROPERTIES TRUST INC	埃塞克斯信托公司	ESS US	美国纽约证券交易所	美国	623	1,208,567.02	0.18
397	STARBUCKS CORP	星巴克	SBUX US	纳斯达克证券交易所	美国	2,178	1,208,400.97	0.18
398	JM SMUCKER CO/THE	斯马克公司	SJM US	美国纽约证券交易所	美国	1,555	1,208,400.25	0.18
399	NORFOLK SOUTHERN CORP	诺福克南方公司	NSC US	美国纽约证券交易所	美国	789	1,207,211.57	0.18
400	LULULEMON ATHLETICA INC	露露乐蒙公司	LULU US	纳斯达克证券交易所	美国	567	1,207,015.52	0.18
401	AUTOMATIC DATA PROCESSING	自动数据处理公司	ADP US	纳斯达克证券交易所	美国	709	1,206,076.99	0.18
402	VICI PROPERTIES INC	VICI 房地产公司	VICI US	美国纽约证券交易所	美国	5,908	1,205,891.05	0.18
403	DTE ENERGY COMPANY	DTE 能源公司	DTE US	美国纽约证券交易所	美国	1,524	1,205,706.61	0.18
404	HENRY SCHEIN	亨利香恩公司	HSIC US	纳斯达克证券交易所	美国	2,636	1,204,198.29	0.18

	N INC			交易所				
405	DELTA AIR LINES INC	达美航空有限公司	DAL US	美国纽约证券交易所	美国	3,561	1,203,957.69	0.18
406	CATERPILLAR INC	卡特彼勒公司	CAT US	美国纽约证券交易所	美国	507	1,203,586.10	0.18
407	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	信安金融集团公司	PFGE US	纳斯达克证券交易所	美国	2,151	1,202,618.64	0.18
408	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	福泰制药公司	VRTX US	纳斯达克证券交易所	美国	360	1,202,570.53	0.18
409	PAYCHEX INC	沛齐公司	PAYX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,423	1,202,368.70	0.18
410	DOMINION ENERGY INC	道明尼资源公司	D US	美国纽约证券交易所	美国	3,440	1,201,293.41	0.18
411	JACOBS SOLUTIONS INC	雅各布布解决方案公司	J US	美国纽约证券交易所	美国	1,206	1,200,796.38	0.18
412	ASSURANT INC	美国艾斯兰公司	AIZ US	美国纽约证券交易所	美国	1,013	1,200,233.30	0.18
413	WESTERN DIGITAL CORP	西部数据公司	WDC US	纳斯达克证券交易所	美国	2,221	1,199,334.75	0.18
414	SOLVENTUM CORP	Solventum 公司	SOLV US	美国纽约证券交易所	美国	3,180	1,198,431.29	0.18
415	TROWER PRICE	普信集团有限公司	TROW US	纳斯达克证券交易所	美国	1,458	1,198,171.73	0.18

	GROUP INC							
416	HUBBELL INC	哈贝尔 公司	HUBB US	美国 纽约 证券 交易所	美国	460	1,198,163.32	0.18
417	NEXTERA ENERGY INC	新纪元 能源公 司	NEE US	美国 纽约 证券 交易所	美国	2,374	1,198,036.03	0.18
418	LAMB WESTON HOLDINGS INC	蓝威士 顿控股 公司	LW US	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,999	1,197,843.47	0.18
419	PULTE GROUP INC	普尔特 房屋有 限公司	PHM US	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,526	1,197,392.20	0.18
420	MOLINA HEALTHCARE INC	莫利纳 医疗保 健公司	MOH US	美国 纽约 证券 交易所	美国	565	1,197,120.67	0.18
421	SUPER MICRO COMPUTER INC	超威电 脑公司	SMCI US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	205	1,197,065.43	0.18
422	JUNIPER NETWORKS INC	瞻博网 络公司	JNPR US	美国 纽约 证券 交易所	美国	4,605	1,196,577.60	0.18
423	CELANESE CORP	塞拉尼 斯公司	CE US	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,244	1,195,899.56	0.18
424	BIO-RAD LABORATORIES-A	BIO RAD 实 验室	BIO US	美国 纽约 证券 交易所	美国	614	1,195,089.81	0.18
425	BEST BUY CO INC	百思买 集团	BBY US	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,989	1,194,828.05	0.18

426	LINDE PLC	林德公 开有限 公司	LIN US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	382	1,194,632.84	0.18
427	IDEXX LABOR ATORI ES INC	IDEXX 实验 室 公 司	IDXX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	344	1,194,428.87	0.18
428	BECTO N DICKI NSON AND CO	碧迪公 司	BDX US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	717	1,194,238.37	0.18
429	LENN A CORP- A	莱纳房 产公 司	LEN US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,118	1,194,128.55	0.18
430	AMERE N CORPO RATIO N	阿曼瑞 恩公 司	AEE US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,356	1,193,989.58	0.18
431	PACCA R INC	帕卡公 司	PCAR US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,625	1,192,153.29	0.18
432	MASCO CORP	马斯可 木业公 司	MAS US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,509	1,192,135.68	0.18
433	KKR & CO INC	科尔伯 格-克 拉维斯 -罗伯 茨公 司	KKR US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,589	1,191,788.82	0.18
434	MEDTR ONIC PLC	美敦力 公 司	MDT US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,124	1,191,458.71	0.18
435	TRACT OR SUPPL Y COMPA NY	拖拉机 供应公 司	TSCO US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	619	1,191,102.08	0.18
436	RTX CORP	雷神技 术公 司	RTX US	美 国 纽 约 证 券	美国	1,664	1,190,524.53	0.18

				交易所				
437	CENTE NE CORP	圣丁公 司	CNC US	美国纽 约证券 交易所	美国	2,517	1,189,299.72	0.18
438	INTER NATIO NAL PAPER CO	国际纸 业公司	IP US	美国纽 约证券 交易所	美国	3,865	1,188,570.29	0.18
439	BROAD RIDGE FINAN CIAL SOLUT IO	布罗德 里奇金 融解决 方案公 司	BR US	美国纽 约证券 交易所	美国	845	1,186,362.76	0.18
440	ALEXA NDRIA REAL ESTAT E EQUIT	亚历山 大房地 产公司	ARE US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,422	1,185,410.19	0.18
441	METTL ER- TOLED O INTER NATIO NAL	梅特勒 -托利 多国际 公司	MTD US	美国纽 约证券 交易所	美国	119	1,185,280.99	0.18
442	THE CIGNA GROUP	信诺保 险集团	CI US	美国纽 约证券 交易所	美国	503	1,185,020.86	0.18
443	JOHNS ON CONTR OLS INTER NATIO N	江森自 控国际 有限公司	JCI US	美国纽 约证券 交易所	美国	2,499	1,183,822.27	0.18
444	MARRI OTT INTER NATIO NAL - CL A	万豪国 际	MAR US	纳斯达 克证券 交易所	美国	687	1,183,732.90	0.18
445	CHIPO	墨式烧	CMG US	美国纽	美国	2,650	1,183,209.15	0.18

	TLE MEXIC AN GRILL INC	烤公司		约证 券交 易所				
446	P G & E CORP	太平洋 煤气与 电力公 司	PCG US	美国纽 约证 券交 易所	美国	9,507	1,182,993.35	0.18
447	STANL EY BLACK & DECKE R INC	史丹利 百得公 司	SWK US	美国纽 约证 券交 易所	美国	2,076	1,181,991.47	0.18
448	BXP INC	波士顿 地产公 司	BXP US	美国纽 约证 券交 易所	美国	2,690	1,180,172.42	0.18
449	WEC ENERG Y GROUP INC	WEC 能 源集团	WEC US	美国纽 约证 券交 易所	美国	2,106	1,177,609.34	0.18
450	ON SEMIC ONDU CTOR	安森美 半导体	ON US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	2,410	1,177,386.56	0.18
451	VISA INC- CLASS A SHARE S	VISA 公司	V US	美国纽 约证 券交 易所	美国	629	1,176,589.28	0.18
452	HASBR O INC	孩之宝 公司	HAS US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	2,821	1,176,125.11	0.18
453	REVI TY INC	Revvit y 公司	RVTY US	美国纽 约证 券交 易所	美国	1,573	1,175,528.46	0.18
454	TELED YNE TECHN OLOG IES INC	得立达 科技公 司	TDY US	美国纽 约证 券交 易所	美国	424	1,172,383.69	0.17

455	VERAL TO CORP	Veralt o 公司	VLTO US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,722	1,171,641.22	0.17
456	DR HORTO N INC	霍顿房 屋公司	DHI US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,162	1,167,089.47	0.17
457	DECKE RS OUTDO OR CORP	德克斯 户外用 品公司	DECK US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	169	1,165,827.24	0.17
458	ALIGN TECHN OLOGY INC	阿莱技 术公司	ALGN US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	677	1,164,861.99	0.17
459	STRYK ER CORP	史赛克 公司	SYK US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	480	1,163,948.98	0.17
460	AMETE K INC	阿美特 克股份 有限公司	AME US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	979	1,163,158.54	0.17
461	YUM! BRAND S INC	百胜餐 饮集团	YUM US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,232	1,163,027.62	0.17
462	CENCO RA INC	森科拉 公司	COR US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	724	1,162,503.66	0.17
463	EQT CORP	EQT 能 源公司	EQT US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	4,410	1,162,251.37	0.17
464	AIR PRODU CTS & CHEMI CALS INC	空气化 工产品 有限公 司	APD US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	630	1,158,614.57	0.17
465	HERSH EY CO/TH E	好时公 司	HSY US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	884	1,158,145.77	0.17
466	NVIDI A CORP	英伟达 公司	NVDA US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,315	1,157,785.01	0.17

467	PENTA IR PLC	滨特尔 集团	PNR US	美国纽 约证 券交 易所	美国	2,118	1,157,300.10	0.17
468	EVERS OURCE ENERG Y	能源方 案公司	ES US	美国纽 约证 券交 易所	美国	2,863	1,157,112.45	0.17
469	MATCH GROUP INC	Match Group 公司	MTCH US	纳斯 达克 证 券交 易所	美国	5,335	1,155,092.50	0.17
470	ESTEE LAUDE R COMPA NIES- CL A	雅诗兰 黛公司	EL US	美国纽 约证 券交 易所	美国	1,523	1,154,877.98	0.17
471	COOPE R COS INC/T HE	库珀医 疗公司	COO US	美国纽 约证 券交 易所	美国	1,856	1,154,746.85	0.17
472	CONST ELLAT ION ENERG Y	星座能 源公司	CEG US	纳斯 达克 证 券交 易所	美国	807	1,151,818.38	0.17
473	MICRO N TECHN OLOGY INC	美光科 技公司	MU US	纳斯 达克 证 券交 易所	美国	1,227	1,150,175.08	0.17
474	DOW INC	陶氏公 司	DOW US	美国纽 约证 券交 易所	美国	3,039	1,148,975.21	0.17
475	AMERI CAN TOWER CORP	美国电 塔公司	AMT US	美国纽 约证 券交 易所	美国	829	1,148,419.82	0.17
476	QUANT A SERVI CES INC	广达服 务公司	PWR US	美国纽 约证 券交 易所	美国	634	1,148,078.02	0.17
477	EXELO N CORP	爱克斯 龙电力 公司	EXC US	纳斯 达克 证 券交 易所	美国	4,654	1,147,948.88	0.17

478	BIO-TECHNE CORP	Bio-Techne 公司	TECH US	纳斯达克证券交易所	美国	2,248	1,147,907.97	0.17
479	LABCORP HOLDINGS INC	美国控股实验室公司	LH US	美国纽约证券交易所	美国	791	1,147,246.68	0.17
480	BUILDERS FIRST SOURCE INC	Builders FirstSource 公司	BLDR US	美国纽约证券交易所	美国	1,160	1,144,247.65	0.17
481	BROADCOM INC	博通公司	AVGO US	纳斯达克证券交易所	美国	100	1,144,229.12	0.17
482	VULCAN MATERIALS CO	火神材料公司	VMC US	美国纽约证券交易所	美国	645	1,143,128.74	0.17
483	QUALCOMM INC	高通公司	QCOM US	纳斯达克证券交易所	美国	805	1,142,710.40	0.17
484	BALL CORP	波尔公司	BALL US	美国纽约证券交易所	美国	2,670	1,142,093.93	0.17
485	ALBEMARLE CORP	雅保公司	ALB US	美国纽约证券交易所	美国	1,676	1,140,940.24	0.17
486	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	赛默飞世尔科技公司	TMO US	美国纽约证券交易所	美国	287	1,131,101.55	0.17
487	BATH & BODY WORKS INC	Bath & Body Works 公司	BBWI US	美国纽约证券交易所	美国	4,050	1,127,121.24	0.17
488	JABIL INC	捷普公司	JBL US	美国纽约证券交易所	美国	1,452	1,125,771.28	0.17

				交易所				
489	AES CORP	爱依斯 电力公 司	AES US	美国纽 约证券 交易所	美国	8,971	1,123,329.57	0.17
490	RESME D INC	瑞思迈 公司	RMD US	美国纽 约证券 交易所	美国	819	1,117,289.67	0.17
491	POOL CORP	普尔公 司	POOL US	纳斯达 克证券 交易所	美国	508	1,112,661.96	0.17
492	MARTI N MARIE TTA MATER IALS	马丁- 玛丽埃 塔材料 公司	MLM US	美国纽 约证券 交易所	美国	288	1,112,054.47	0.17
493	MODER NA INC	莫德纳 公司	MRNA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,239	1,048,574.99	0.16
494	FIRST SOLAR INC	第一太 阳能公 司	FSLR US	纳斯达 克证券 交易所	美国	634	1,018,716.48	0.15
495	NIKE INC - CL B	耐克公 司	NKE US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,857	997,481.82	0.15
496	NEWS CORP - CLASS A	新闻集 团公司	NWSA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,973	977,124.26	0.15
497	WALGR EENS BOOTS ALLIA NCE INC	沃尔格 林联合 博姿集 团	WBA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	11,158	961,804.49	0.14
498	ENPHA SE ENERG Y INC	Enphas e 能源 公司	ENPH US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,320	938,009.46	0.14
499	FOX CORP - CLASS A	福斯公 司	FOXA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,413	836,007.92	0.12

500	ALPHA BET INC- CL A	谷歌 (Alpha bet)	GOOGL US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	533	691,912.15	0.10
501	ALPHA BET INC- CL C	谷歌 (Alpha bet)	GOOG US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	443	579,088.56	0.09
502	FOX CORP - CLASS B	福斯公 司	FOX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,186	498,845.50	0.07
503	NEWS CORP - CLASS B	新闻集 团公司	NWS US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,500	303,494.78	0.05

7.4.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细
无。

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	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	DOC US	1,624,320.51	0.36
2	VISTRA CORP	VST US	1,571,164.09	0.34
3	COOPER COS INC/THE	COO US	1,460,997.00	0.32
4	EXXON MOBIL CORP	XOM US	1,431,061.46	0.31
5	SUPER MICRO COMPUTER INC	SMCI US	1,357,364.45	0.30
6	DECKERS OUTDOOR CORP	DECK US	1,316,103.04	0.29
7	GODADDY INC - CLASS A	GDDY US	1,244,039.11	0.27
8	KKR & CO INC	KKR US	1,232,871.30	0.27
9	CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	CRWD US	1,217,055.57	0.27
10	SOLVENTUM CORP	SOLV US	1,175,089.82	0.26
11	EPAM SYSTEMS INC	EPAM US	1,032,061.47	0.23

12	LULULEMON ATHLETICA INC	LULU US	971,851.34	0.21
13	GLOBE LIFE INC	GL US	948,572.63	0.21
14	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	WBA US	935,206.80	0.21
15	WARNER BROS DISCOVERY INC	WBD US	931,194.02	0.20
16	GE VERNOVA INC	GEV US	920,915.84	0.20
17	3M CO	MMM US	910,993.58	0.20
18	PARAMOUNT GLOBAL- CLASS B	PARA US	883,632.24	0.19
19	HUMANA INC	HUM US	825,462.86	0.18
20	ARCHER-DANIELS- MIDLAND CO	ADM US	816,322.20	0.18

注：本项中“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.2 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	NVIDIA CORP	NVDA US	1,644,117.89	0.36
2	EXXON MOBIL CORP	XOM US	1,455,220.14	0.32
3	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	PEAK US	1,365,555.60	0.30
4	ZIONS BANCORP NA	ZION US	1,227,950.31	0.27
5	COOPER COS INC/THE	COO US	1,204,165.08	0.26
6	COMERICA INC	CMA US	1,131,777.06	0.25
7	WHIRLPOOL CORP	WHR US	1,093,398.68	0.24
8	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	PXD US	1,084,501.24	0.24
9	ILLUMINA INC	ILMN US	1,078,977.00	0.24
10	ROBERT HALF INC	RHI US	1,038,826.72	0.23
11	DENTSPLY SIRONA INC	XRAY US	1,027,132.09	0.23
12	VF CORP	VFC US	971,981.08	0.21
13	FIRST SOLAR INC	FSLR US	902,568.23	0.20
14	BROADCOM INC	AVGO US	885,328.13	0.19
15	MICRON TECHNOLOGY INC	MU US	854,766.31	0.19
16	CONSTELLATION ENERGY	CEG US	827,218.27	0.18

17	NRG ENERGY INC	NRG US	760,172.62	0.17
18	GENERAL ELECTRIC CO	GE US	721,266.44	0.16
19	WESTERN DIGITAL CORP	WDC US	701,602.24	0.15
20	TERADYNE INC	TER US	695,134.98	0.15

注：本项中“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.3 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	261,066,072.86
卖出收入（成交）总额	86,174,636.25

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

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

无。

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

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

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未超出基金合同规定的备选股票库。

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	626,188.20
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,385,646.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	171,858.62
8	其他	-
9	合计	3,183,693.42

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

7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 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 (%)
大成标普 500 等权重指数 (QDII)A	54,977	4,734.31	89,297,682.05	34.31	170,980,704.43	65.69
大成标普 500 等权重指数 (QDII)C	3,231	5,316.66	11,362,437.83	66.14	5,815,679.07	33.86
合计	58,208	4,766.64	100,660,119.88	36.28	176,796,383.50	63.72

注：1、上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各

自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

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	大成标普 500 等权重指数 (QDII)A	18,702.93	0.0072
	大成标普 500 等权重指数 (QDII)C	-	-
	合计	18,702.93	0.0067

注：上述占基金总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	大成标普 500 等权重指数 (QDII)A	0~10
	大成标普 500 等权重指数 (QDII)C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	大成标普 500 等权重指数 (QDII)A	0
	大成标普 500 等权重指数 (QDII)C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成标普 500 等权重指数(QDII)A	大成标普 500 等权重指数(QDII)C
基金合同生效日（2011年3月23日）基金份额总额	822,754,222.26	-
本报告期期初基金份额总额	182,508,938.23	8,360,879.29
本报告期基金总申购份额	119,066,880.46	23,642,535.07
减：本报告期基金总赎回份额	41,297,432.21	14,825,297.46

本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	260,278,386.48	17,178,116.90

注：大成标普 500 等权重指数 QDII 份额变动含人民币份额及美元份额（如有）。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

无。

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

一、基金管理人的重大人事变动

无。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

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

本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

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

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，基金管理人及其相关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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	-----	------	-----------	----

	元数量	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 (%)	
Morgan Stanley	1	342,551,754.75	100.00	102,766.55	100.00	-
Daiwa Capital Markets Hong Kong Limited	1	-	-	-	-	-

注：本基金采用托管人结算模式，本基金管理人负责选择证券经纪商，租用其交易单元作为本基金的交易单元。证券经纪商的选择标准如下：

- （一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- （二）经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- （三）研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；
- （四）具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；
- （五）相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用交易单元的使用流程为：首先根据证券经纪商选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行本基金交易单元选择。

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

无。

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	大成标普 500 等权重指数证券投资基金(人民币 A 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 6 月 28 日
2	大成标普 500 等权重指数证券投资基金(美元 A 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 6 月 28 日
3	大成标普 500 等权重指数证券投资基金(人民币 C 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 6 月 28 日
4	大成标普 500 等权重指数证券投资基金(美元 C 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 6 月 28 日

5	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东兴证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 6 月 28 日
6	大成基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 6 月 28 日
7	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加部分代销机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 6 月 13 日
8	大成基金管理有限公司关于暂停海银基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 6 月 12 日
9	大成标普 500 等权重指数证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 4 月 23 日
10	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 4 月 19 日
11	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国信证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 4 月 15 日
12	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 4 月 2 日
13	大成标普 500 等权重指数证券投资基金（人民币）C 类份额增加财信证券股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 4 月 1 日
14	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加山西证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 4 月 1 日
15	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 3 月 29 日
16	大成标普 500 等权重指数证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 3 月 21 日
17	大成标普 500 等权重指数证券投资基金托管协议	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 3 月 19 日
18	大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 3 月 19 日
19	大成基金管理有限公司关于调整旗下部分基金基金份额净值的小数点	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本	2024 年 3 月 19 日

	保留位数并相应修订基金合同和托管协议的公告	公司网站	
20	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海万得基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 3 月 4 日
21	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华西证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 2 月 28 日
22	大成标普 500 等权重指数(QDII)C 人民币类份额增加兴业证券股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 2 月 22 日
23	关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金暂停大额申购（含定期定额申购）业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 2 月 7 日
24	关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金暂停大额申购（含定期定额申购）业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 2 月 1 日
25	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 1 月 23 日
26	大成标普 500 等权重指数证券投资基金(人民币)C 类份额增加上海华夏财富投资管理有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 1 月 22 日
27	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 1 月 19 日
28	大成基金管理有限公司关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2023 年度第 1 次分红的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 1 月 16 日
29	关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金暂停大额申购（含定期定额申购）业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 1 月 10 日
30	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金 2024 年境外（地区）主要市场节假日暂停申购赎回安排的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 1 月 5 日
31	关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金恢复大额申购（含定期定额申购）业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 1 月 4 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
-----	----------------	------------

类别	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20240110-20240630	-	63,391,512.89	-	63,391,512.89	22.85
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险，甚至有可能引起基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成标普 500 等权重指数证券投资基金的文件；
- 2、《大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成标普 500 等权重指数证券投资基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在规定报刊上披露的各种公告原稿。

12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

大成基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日