

嘉实美国成长股票型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 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：2026 年 8 月 31 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 27 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 2026 年 01 月 01 日起至 2026 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 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
3.3 其他指标	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
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	13
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	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	40
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	40

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	40
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	67
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	68
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	68
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	68
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	68
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	68
7.11 投资组合报告附注	70
§8 基金份额持有人信息	70
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	70
8.2 盈利投资者数量占比	71
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	71
8.4 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	71
§9 开放式基金份额变动	72
§10 重大事件揭示	72
10.1 基金份额持有人大会决议	72
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	72
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	72
10.4 基金投资策略的改变	72
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	72
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	73
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	73
10.8 其他重大事件	78
§11 影响投资者决策的其他重要信息	78
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	78
§12 备查文件目录	78
12.1 备查文件目录	78
12.2 存放地点	79
12.3 查阅方式	79

§ 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	771,562,705.87 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（QDII）-人民币	嘉实美国成长股票（QDII）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	768,835,642.83 份	2,727,063.04 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	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。 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。 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。 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。
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	郭松	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		北京市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		北京市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 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		—	—

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金中期报告置备地点	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

2.6 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(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	嘉实美国成长股票（QDII）-人民币	嘉实美国成长股票（QDII）美元现汇
本期已实现收益	223,890,125.89	4,852,314.93

本期利润	618, 232, 854. 02	13, 443, 969. 67
加权平均基金份额本期利润	0. 7536	4. 5823
本期加权平均净值利润率	12. 86%	12. 81%
本期基金份额净值增长率	13. 71%	17. 34%
3. 1. 2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	1, 140, 977, 684. 84	26, 754, 642. 58
期末可供分配基金份额利润	1. 4840	9. 8108
期末基金资产净值	4, 987, 639, 593. 56	107, 958, 300. 82
期末基金份额净值	6. 487	5. 812
3. 1. 3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	548. 70%	481. 20%

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

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

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

（4）嘉实美国成长股票(QDII)美元现汇的期末基金份额净值为美元。

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（QDII）-人民币

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去三个月	22.79%	1.48%	15.71%	1.13%	7.08%	0.35%
过去六个月	13.71%	1.44%	4.82%	1.15%	8.89%	0.29%
过去一年	26.70%	1.23%	16.23%	1.01%	10.47%	0.22%
过去三年	86.09%	1.29%	75.92%	1.17%	10.17%	0.12%
过去五年	113.25%	1.34%	78.74%	1.27%	34.51%	0.07%
过去七年	227.96%	1.44%	200.75%	1.39%	27.21%	0.05%
过去十年	396.71%	1.31%	364.92%	1.25%	31.79%	0.06%
自基金合同生效起 至今	548.70%	1.22%	520.11%	1.17%	28.59%	0.05%

嘉实美国成长股票（QDII）美元现汇

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	24.75%	1.49%	15.71%	1.13%	9.04%	0.36%
过去六个月	17.34%	1.44%	4.82%	1.15%	12.52%	0.29%
过去一年	33.18%	1.23%	16.23%	1.01%	16.95%	0.22%
过去三年	97.42%	1.29%	75.92%	1.17%	21.50%	0.12%
过去五年	102.44%	1.32%	78.74%	1.27%	23.70%	0.05%
过去七年	231.17%	1.42%	200.75%	1.39%	30.42%	0.03%
过去十年	380.73%	1.29%	364.92%	1.25%	15.81%	0.04%
自基金合同生效起 至今	481.20%	1.20%	520.11%	1.17%	-38.91 %	0.03%

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：

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

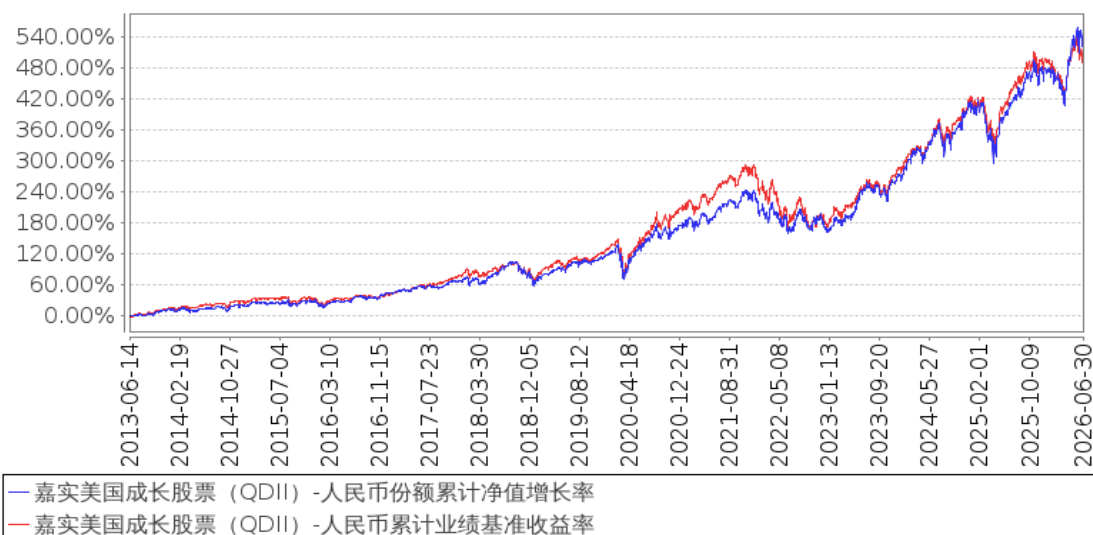
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

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

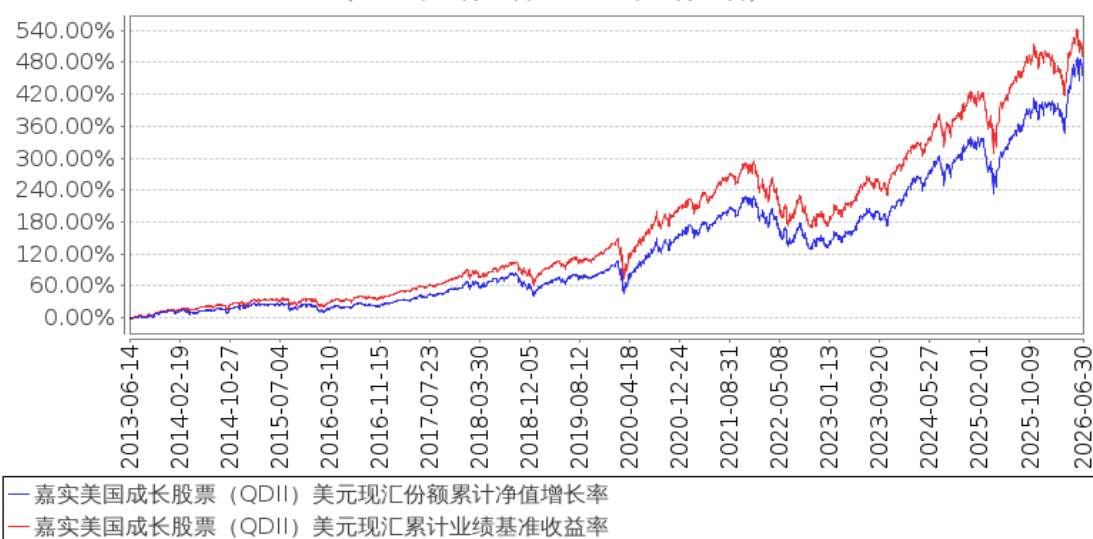
嘉实美国成长股票（QDII）-人民币份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013年06月14日至2026年06月30日)



嘉实美国成长股票（QDII）美元现汇份额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2026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金字[1999]5 号文批准，于 1999 年 3 月 25 日成立。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 2026 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 385 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、不动产基金等不同类别。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		
陈俊杰	本基金、嘉实全球产业升级股票发起式（QDII）基金经理	2026 年 4 月 11 日	-	11 年	曾任浙商证券股份有限公司研究所电子行业分析师，天风证券股份有限公司研究所电子行业高级分析师。2021 年 3 月加入嘉实基金管理有限公司任制造行业研究组行业主分析师。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。
张楠	本基金、嘉实上证综合增强策略 ETF 基金经理	2025 年 2 月 22 日	2026 年 5 月 13 日	14 年	2012 年 1 月加入嘉实基金管理有限公司从事投资模型研究和投资组合管理工作，现任基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。
张自力	本基金基金经理	2013 年 6 月 14 日	2026 年 4 月 11 日	30 年	曾任美国世纪投资管理公司（American Century Investments）资深副总经理，研究部总监暨基金经理，负责直接管理、支持公司旗下近二百亿美元的多项大型公募基金和对冲基金类产品。2012 年 2 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任定量投资部负责人、人工智能投资部负责人，现任股票投研人工智能投资总监，博士后科研工作站导师。博士研究生，毕业于美国德州大学奥斯汀分校和中国科学技术大学，具有基金从业资格。美国国籍。

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

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 3 次，其中 2 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，1 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易，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

2026 年上半年，全球主要资本市场整体收涨，但期间经历了大幅波动，呈现出鲜明的“深 V 型”走势。美股方面，标普 500 指数上半年上涨 9.5%，道琼斯工业平均指数上涨 8.9%，创 2021 年以来最佳上半年表现，纳斯达克综合指数上涨 12.8%。半导体相关方向涨幅尤为突出，反映人工智能资本开支对产业链的持续拉动。

报告期内，市场呈现两个阶段的明显分化。一季度，受部分大型科技公司自由现金流大幅下滑、市场对人工智能资本开支可持续性产生疑虑（即所谓“AI 泡沫”担忧）的影响，叠加此前已实施的高额关税对国际贸易和全球产业链的持续负面冲击，以及中东地缘局势趋于紧张，全球权益市场普遍承压：标普 500 下跌 4.3%，道指下跌 3.2%，纳指下跌 7.0%。3 月初，伊朗局势骤然升级并波及霍尔木兹海峡航运通道，布伦特原油价格一度突破每桶 120 美元，构成近年来全球原油市场最大规模的供给冲击之一，进一步加剧了市场的避险情绪与通胀担忧。

进入二季度后，随着市场对地缘冲突影响的逐步消化、企业二季度盈利韧性的初步验证，以及人工智能资本开支叙事的重新确认，全球权益市场特别是美股出现强劲反弹：标普 500 单季上涨 14.8%，纳指上涨 21.4%，道指上涨 12.9%，均为 2020 年二季度以来最佳单季表现，反弹以科技及半导体龙头公司拉动最为显著，带动上半年整体转正并录得较好收益。

报告期内，美联储将联邦基金利率目标区间维持在 3.5%—3.75% 不变，未进行降息操作，主要原因是核心 PCE 通胀率仍处于 2.8% 左右的水平，明显高于 2% 的政策目标，联储内部对下阶段政策路径存在分歧。关税方面，尽管进口环节成本上升对部分依赖进口的细分行业已形成实际压力，但市场预期其对整体通胀的边际影响将趋于减弱。

本基金以大盘成长股为投资方向，在组合构建过程中严格依据基金合同明确的风格进行管理，以合同约定的基准指数为基础，构建分散化的投资组合。行业配置上，本基金主要配置于信息科技、生物医药、非必需消费品等行业，并以细分行业内的龙头企业为核心持仓。本组合不持有受中东局势直接影响的上市公司资产，不持有潜在可能受地缘政治风险及其他各类风险事件直接冲击的上市公司股票。

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，以及在市场大幅波动环境下对美国成长股持续进行筛选与再平衡。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，涉及境内外券商和银行的多个环节；在一季度市场调整及伊朗局势升级期间，市场大幅震荡背景下，申赎的随机性和资金处理流程对仓位水平及投资业绩均产生一定影响，报告期内本基金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（QDII）-人民币基金份额净值为 6.487 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.71%；截至本报告期末嘉实美国成长股票（QDII）美元现汇基金份额净值为 5.812 美元，本报告期基金份额净值增长率为 17.34%；业绩比较基准收益率为 4.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

投资理念上，我们认为美股的核心驱动力是企业盈利能力的积极态势及成长空间。建立在对美股上市公司盈利能力、成长性、估值以及资本市场风险测度等多维度特征基础上的纪律化选股模型，是本组合的基础模型。面向下半年，我们依然坚持以企业盈利能力及资本市场定价模型为核心判断依据，避免追逐短期热点题材。

对企业盈利的回顾上，本报告期内以人工智能资本开支为代表的头部科技企业盈利质量成为市场关注焦点：一季度部分龙头公司自由现金流大幅收缩，一度引发市场对“AI 投资是否可持续”的广泛质疑并触发结构性调整；但随着二季度财报逐步验证盈利韧性，叠加半导体及硬件基础设

施需求的持续验证，市场信心明显修复，头部公司重新成为盈利与股价拉动的主力。

站在当前时点展望下半年，显著的宏观关切主要包括：其一，中东局势及其对全球原油供给与运输通道的持续影响，若冲突进一步升级或延宕，对全球通胀和经济增长的负面外溢效应可能继续存在；其二，美联储降息路径的不确定性，市场普遍预期下半年或有一次 25 个基点的降息（9 月或 10 月为可能性较高的时点），但也有相当比例的观点认为年内可能不降息，具体取决于核心通胀能否如期回落至 2.5% 附近；其三，关税对国际贸易和企业成本端的影响虽预期边际减弱，但其对特定行业供应链和企业盈利空间的压制仍未完全消化。

我们预期，若美联储在下半年开启降息，对利率更为敏感的成长型资产及中小盘股票有望获得相对支撑；但在此之前，预计头部科技企业仍将是市场盈利与估值扩张的主要驱动力，尤其是与人工智能基础设施相关的半导体及硬件板块。当前二季报正在陆续披露，我们将重点关注头部企业资本开支回报率及自由现金流质量的边际变化，以判断本轮由龙头拉动的行情能否延续并扩散至更广泛的板块。

后续，我们将继续根据合同要求保持较高仓位水平，坚持量化框架的纪律化操作，密切跟踪地缘政治、货币政策及企业盈利等多维度信息，积极调整和优化模型，控制风险，力争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，完全尽职尽责的履行了应尽的义务。

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的复核，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）、投资组合报告等财务数据真实、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：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	299,585,747.76	379,182,498.73
结算备付金		—	—
存出保证金		—	—
交易性金融资产	6.4.7.2	4,849,969,980.82	4,854,742,523.71
其中：股票投资		4,837,979,682.13	4,819,000,932.88
基金投资		11,990,298.69	35,741,590.83
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		765,910.69	784,769.04
应收申购款		18,636,746.46	11,625,340.35
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		5,168,958,385.73	5,246,335,131.83
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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		-	80,286,374.59
应付赎回款		67,345,592.49	37,522,272.99
应付管理人报酬		4,930,618.06	5,155,620.35
应付托管费		821,769.69	859,270.04
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	262,511.11	286,899.95
负债合计		73,360,491.35	124,110,437.92
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	785,633,528.17	898,042,279.16
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	4,309,964,366.21	4,224,182,414.75
净资产合计		5,095,597,894.38	5,122,224,693.91
负债和净资产总计		5,168,958,385.73	5,246,335,131.83

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，嘉实美国成长股票（QDII）-人民币基金份额净值 6.487 元，基金份额总额 768,835,642.83 份，嘉实美国成长股票（QDII）美元现汇基金份额净值 5.812 美元，基金份额总额 2,727,063.04 份，基金份额总额合计为 771,562,705.87 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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		665,881,747.69	76,779,858.32
1. 利息收入		149,900.19	346,359.12
其中：存款利息收入	6.4.7.13	149,900.19	346,359.12
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）		270,790,975.23	91,309,984.12
其中：股票投资收益	6.4.7.14	262,873,074.83	75,089,236.69
基金投资收益	6.4.7.15	-4,039,407.54	-603,762.41
债券投资收益	6.4.7.16	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.17	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	11,957,307.94	16,824,509.84
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	402,934,382.87	-34,921,232.14
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-9,381,118.03	16,867,256.42
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	1,387,607.43	3,177,490.80
减：二、营业总支出		34,204,924.00	42,131,211.97
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	29,242,291.68	35,817,895.71
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,873,715.34	6,226,959.23
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		-	1,647.59

8. 其他费用	6. 4. 7. 24	88,916.98	84,709.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		631,676,823.69	34,648,646.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		631,676,823.69	34,648,646.35
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		631,676,823.69	34,648,646.35

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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	898,042,279.16	-	4,224,182,414.75	5,122,224,693.91
二、本期期初净资产	898,042,279.16	-	4,224,182,414.75	5,122,224,693.91
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-112,408,750.99	-	85,781,951.46	-26,626,799.53
（一）、综合收益总额	-	-	631,676,823.69	631,676,823.69
（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）	-112,408,750.99	-	-545,894,872.23	-658,303,623.22
其中：1. 基金申购款	137,574,012.23	-	679,676,345.20	817,250,357.43
2. 基金赎回款	-249,982,763.22	-	-1,225,571,217.43	-1,475,553,980.65
（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	785,633,528.17	—	4,309,964,366.21	5,095,597,894.38
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	1,366,507,768.39	—	5,373,916,595.44	6,740,424,363.83
二、本期期初净资产	1,366,507,768.39	—	5,373,916,595.44	6,740,424,363.83
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-432,772,998.42	—	-1,527,878,355.88	-1,960,651,354.30
（一）、综合收益总额	—	—	34,648,646.35	34,648,646.35
（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）	-432,772,998.42	—	-1,562,527,002.23	-1,995,300,000.65
其中：1. 基金申购款	166,320,200.16	—	642,387,900.45	808,708,100.61
2. 基金赎回款	-599,093,198.58	—	-2,204,914,902.68	-2,804,008,101.26
（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	933,734,769.97	—	3,846,038,239.56	4,779,773,009.53

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”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

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[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》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，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。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	299,585,747.76

等于：本金	299,577,949.17
加：应计利息	7,798.59
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	299,585,747.76

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	3,081,532,848.34	-	4,837,979,682.13	1,756,446,833.79
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	9,735,255.46	-	11,990,298.69	2,255,043.23
其他	-	-	-	-
合计	3,091,268,103.80	-	4,849,969,980.82	1,758,701,877.02

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 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	174,242.84
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	88,268.27
合计	262,511.11

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实美国成长股票（QDII）-人民币

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	878,768,426.26	878,768,426.26
本期申购	137,383,283.11	137,383,283.11
本期赎回（以“-”号填列）	-247,316,066.54	-247,316,066.54
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	768,835,642.83	768,835,642.83

嘉实美国成长股票（QDII）美元现汇

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,129,197.11	19,273,852.90
本期申购	30,917.26	190,729.12
本期赎回（以“-”号填列）	-433,051.33	-2,666,696.68
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	2,727,063.04	16,797,885.34

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（QDII）-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	1,059,117,576.47	3,075,401,468.04	4,134,519,044.51
本期期初	1,059,117,576.47	3,075,401,468.04	4,134,519,044.51
本期利润	223,890,125.89	394,342,728.13	618,232,854.02

本期基金份额交易产生的变动数	-142,030,017.52	-391,917,930.28	-533,947,947.80
其中：基金申购款	182,342,831.06	496,400,641.60	678,743,472.66
基金赎回款	-324,372,848.58	-888,318,571.88	-1,212,691,420.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,140,977,684.84	3,077,826,265.89	4,218,803,950.73

嘉实美国成长股票（QDII）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	25,376,537.54	64,286,832.70	89,663,370.24
本期期初	25,376,537.54	64,286,832.70	89,663,370.24
本期利润	4,852,314.93	8,591,654.74	13,443,969.67
本期基金份额交易产生的变动数	-3,474,209.89	-8,472,714.54	-11,946,924.43
其中：基金申购款	274,389.82	658,482.72	932,872.54
基金赎回款	-3,748,599.71	-9,131,197.26	-12,879,796.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	26,754,642.58	64,405,772.90	91,160,415.48

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	129,708.49
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	20,191.70
合计	149,900.19

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	262,873,074.83
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	262,873,074.83

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
----	----

	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,478,530,563.64
减：卖出股票成本总额	1,215,055,687.21
减：交易费用	601,801.60
买卖股票差价收入	262,873,074.83

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	21,889,298.53
减：卖出/赎回基金成本总额	25,921,822.49
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	6,883.58
基金投资收益	-4,039,407.54

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	11,949,168.45
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	8,139.49
合计	11,957,307.94

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	402,934,382.87
股票投资	402,327,018.53
债券投资	—
资产支持证券投资	—
基金投资	607,364.34
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	402,934,382.87

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,387,607.43
合计	1,387,607.43

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	28,760.90
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行划款手续费	648.71
合计	88,916.98

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、关联关系

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
中国银行（香港）有限公司	基金托管人的子公司、境外资产托管人
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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	29,242,291.68	35,817,895.71
其中：应支付销售机构的客户维护费	12,687,699.29	14,083,592.82
应支付基金管理人的净管理费	16,554,592.39	21,734,302.89

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 1.20%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×1.20%/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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,873,715.34	6,226,959.23

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20%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：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	299,585,747.76	129,708.49	257,326,149.53	329,117.47

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(2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日), 本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2026 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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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风险管理制度，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，还有董事会合规与风险控制委员会、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 2026 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	299,585,747.76	-	-	-	299,585,747.76
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	4,849,969,980.82	4,849,969,980.82
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	-	-	-	765,910.69	765,910.69
应收申购款	-	-	-	18,636,746.46	18,636,746.46
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	299,585,747.76	-	-	4,869,372,637.97	5,168,958,385.73
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	67,345,592.49	67,345,592.49
应付管理人报酬	-	-	-	4,930,618.06	4,930,618.06
应付托管费	-	-	-	821,769.69	821,769.69
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	-	-	-	262,511.11	262,511.11
负债总计	-	-	-	73,360,491.35	73,360,491.35
利率敏感度缺口	299,585,747.76	-	-	4,796,012,146.62	5,095,597,894.38
上年度末 2025 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	379,182,498.73	-	-	-	379,182,498.73
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	4,854,742,523.71	4,854,742,523.71
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	-	-	-	784,769.04	784,769.04
应收申购款	-	-	-	11,625,340.35	11,625,340.35
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	379,182,498.73	-	-	4,867,152,633.	5,246,335,131.83

				10	
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	-	-	-	80,286,374.59	80,286,374.59
应付赎回款	-	-	-	37,522,272.99	37,522,272.99
应付管理人报酬	-	-	-	5,155,620.35	5,155,620.35
应付托管费	-	-	-	859,270.04	859,270.04
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	-	-	-	286,899.95	286,899.95
负债总计	-	-	-	124,110,437.92	124,110,437.92
利率敏感度缺口	379,182,498.73	-	-	4,743,042,195.18	5,122,224,693.91

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 （2026 年 6 月 30 日）	上年度末 （2025 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	-	-
	市场利率上升 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 2026 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	219,367,120.96	-	-	219,367,120.96
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	4,849,969,980.82	-	-	4,849,969,980.82
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	765,910.69	-	-	765,910.69
应收申购款	29,722.77	-	-	29,722.77
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	5,070,132,735.24	-	-	5,070,132,735.24
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
应付赎回款	78,651.93	-	-	78,651.93
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	201.40	-	-	201.40
负债合计	78,853.33	-	-	78,853.33
资产负债表外 汇风险敞口净 额	5,070,053 ,881.91	-	-	5,070,053,881.91
项目	上年度末 2025 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	214,097,4 45.17	-	-	214,097,445.17
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资 产	4,854,742 ,523.71	-	-	4,854,742,523.71
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	784,769.0 4	-	-	784,769.04
应收申购款	14,616.46	-	-	14,616.46
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	5,069,639 ,354.38	-	-	5,069,639,354.38
以外币计价的 负债				
应付清算款	80,286,37 4.59	-	-	80,286,374.59
衍生金融负债	-	-	-	-
应付赎回款	49,110.16	-	-	49,110.16

应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
其他负债	90.81	-	-	90.81
负债合计	80,335,575.56	-	-	80,335,575.56
资产负债表外汇风险敞口净额	4,989,303,778.82	-	-	4,989,303,778.82

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	所有外币相对人民币升值 5%	253,502,694.10	249,465,188.94
	所有外币相对人民币贬值 5%	-253,502,694.10	-249,465,188.94

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025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	4,837,979,682.13	94.94	4,819,000,932.88	94.08
交易性金融资产—基金投资	11,990,298.69	0.24	35,741,590.83	0.70
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	4,849,969,980.82	95.18	4,854,742,523.71	94.78

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	288,879,339.52	265,217,424.85
	业绩比较基准下降 5%	-288,879,339.52	-265,217,424.85

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
---------------	------------------------	--------------------------

第一层次	4,849,969,980.82	4,854,742,523.71
第二层次	—	—
第三层次	—	—
合计	4,849,969,980.82	4,854,742,523.71

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	4,837,979,682.13	93.60
	其中：普通股	4,670,719,654.63	90.36
	存托凭证	164,513,016.56	3.18
	优先股	—	—
	房地产信托凭证	2,747,010.94	0.05
2	基金投资	11,990,298.69	0.23
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	299,585,747.76	5.80
8	其他各项资产	19,402,657.15	0.38
9	合计	5,168,958,385.73	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	4,837,979,682.13	94.94
合计	4,837,979,682.13	94.94

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（%）
通信服务	557,898,457.12	10.95
非必需消费品	375,112,955.17	7.36
必需消费品	113,392,880.93	2.23
能源	49,851,058.30	0.98
金融	134,684,065.69	2.64
医疗保健	300,444,363.34	5.90
工业	449,871,805.29	8.83
信息技术	2,776,227,705.36	54.48
原材料	52,975,652.27	1.04
房地产	2,747,010.94	0.05
公用事业	24,773,727.72	0.49
合计	4,837,979,682.13	94.94

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	Apple Inc	苹果公司	AAPL UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	214,321	422,384,260.59	8.29
2	NVIDIA	英伟达	NVDA UW	纳斯达	美国	292,144	398,131,792.64	7.81

	Corp	公司		克证券 交易所				
3	Alphabet Inc	Alphabet 股份有限公司	GOOGL UW	纳斯达克 克证券 交易所	美国	118,447	288,301,340.36	5.66
3	Alphabet Inc	Alphabet 股份有限公司	GOOG UW	纳斯达克 克证券 交易所	美国	44,847	107,924,094.58	2.12
4	Broadcom Inc	博通股份有限公司	AVGO UW	纳斯达克 克证券 交易所	美国	90,707	233,372,554.70	4.58
5	Microsoft Corp	微软公司	MSFT UW	纳斯达克 克证券 交易所	美国	90,775	230,623,139.11	4.53
6	Amazon. com Inc	亚马逊公司	AMZN UW	纳斯达克 克证券 交易所	美国	128,919	209,275,489.77	4.11
7	Western Digital Corp	西部数据公司	WDC UW	纳斯达克 克证券 交易所	美国	39,411	171,448,019.93	3.36
8	Lam Research Corp	泛林集团	LRCX UW	纳斯达克 克证券 交易所	美国	46,380	136,884,415.23	2.69
9	Eli Lilly & Co	礼来	LLY UN	纽约证 券交易 所	美国	16,310	133,239,615.91	2.61
10	Tesla Inc	特斯拉公司	TSLA UW	纳斯达克 克证券 交易所	美国	42,049	120,456,279.24	2.36
11	Taiwan Semicondu ctor Manufactu ring Co Ltd	台湾积 体电路 制造股 份有限 公司	TSM UN	纽约证 券交易 所	美国	35,373	115,057,103.16	2.26
12	Micron Technolog y Inc	美光科技 股份有 限公司	MU UW	纳斯达克 克证券 交易所	美国	12,935	101,691,784.90	2.00
13	Seagate Technolog y	Seagate Techno	STX UW	纳斯达克 克证券 交易所	美国	15,125	99,409,342.31	1.95

	Holdings PLC	logy 控股公共有限公司						
14	GE Vernova Inc	通用电气 Vernova 股份有限公司	GEV UN	纽约证券交易所	美国	11,762	94,117,806.44	1.85
15	Advanced Micro Devices Inc	AMD 公司	AMD UW	纳斯达克证券交易所	美国	22,987	90,948,523.38	1.78
16	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	22,516	86,382,901.06	1.70
17	KLA Corp	科磊公司	KLAC UW	纳斯达克证券交易所	美国	36,860	75,744,227.31	1.49
18	Costco Wholesale Corp	开市客公司	COST UW	纳斯达克证券交易所	美国	10,662	67,931,788.15	1.33
19	Lumentum Holdings Inc	Lumentum 控股股份有限公司	LITE UW	纳斯达克证券交易所	美国	11,065	64,665,639.85	1.27
20	Palantir Technologies Inc	Palantir 技术股份有限公司	PLTR UW	纳斯达克证券交易所	美国	73,015	58,019,741.73	1.14
21	General Electric Co	通用电气公司	GE UN	纽约证券交易所	美国	20,085	51,125,115.34	1.00
22	AbbVie Inc	艾伯维股份有限公司	ABBV UN	纽约证券交易所	美国	29,691	50,887,252.76	1.00
23	Applied Materials Inc	应用材料公司	AMAT UW	纳斯达克证券交易所	美国	9,600	47,273,094.72	0.93
24	Amphenol Corp	安费诺公司	APH UN	纽约证券交易所	美国	39,045	46,889,058.04	0.92

25	Caterpillar Inc	卡特彼勒公司	CAT UN	纽约证券交易所	美国	5,715	41,450,480.15	0.81
26	Comfort Systems USA Inc	美国舒适系统公司	FIX UN	纽约证券交易所	美国	3,061	41,320,020.42	0.81
27	Marvell Technology Inc	美满电子科技有限公司	MRVL UW	纳斯达克证券交易所	美国	19,310	39,178,039.71	0.77
28	Intel Corp	英特尔公司	INTC UW	纳斯达克证券交易所	美国	39,843	37,890,930.74	0.74
29	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM UW	纳斯达克证券交易所	美国	30,000	37,757,586.33	0.74
30	Netflix Inc	奈飞公司	NFLX UW	纳斯达克证券交易所	美国	74,640	36,297,302.13	0.71
31	Vertiv Holdings Co	维谛技术控股公司	VRT UN	纽约证券交易所	美国	15,685	35,768,474.56	0.70
32	Flex Ltd	伟创力国际有限公司	FLEX UW	纳斯达克证券交易所	美国	28,357	31,301,663.56	0.61
33	Amgen Inc	安进公司	AMGN UW	纳斯达克证券交易所	美国	10,232	25,235,827.32	0.50
34	Mastercard Inc	万事达股份有限公司	MA UN	纽约证券交易所	美国	6,929	24,238,184.12	0.48
35	Tower Semiconductor Ltd	塔尔半导体有限公司	TSEM UW	纳斯达克证券交易所	美国	13,511	23,984,632.30	0.47
36	Oracle Corp	甲骨文股份有限公司	ORCL UN	纽约证券交易所	美国	23,422	23,378,374.07	0.46
37	Texas Instruments Inc	德州仪器公司	TXN UW	纳斯达克证券交易所	美国	11,310	22,960,713.33	0.45
38	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	11,621	21,280,126.21	0.42

39	Teradyne Inc	泰瑞达	TER UW	纳斯达克证券交易所	美国	6,428	21,182,740.28	0.42
40	Visa Inc	维萨公司	V UN	纽约证券交易所	美国	8,920	20,843,824.99	0.41
41	Arista Networks Inc	Arista 网络股份有限公司	ANET UN	纽约证券交易所	美国	17,923	20,737,550.71	0.41
42	AppLovin Corp	AppLovin 公司	APP UW	纳斯达克证券交易所	美国	5,154	18,086,313.76	0.35
43	Corning Inc	康宁公司	GLW UN	纽约证券交易所	美国	10,350	18,005,979.74	0.35
44	Coherent Corp	相干公司	COHR UN	纽约证券交易所	美国	6,613	17,767,118.82	0.35
45	ASML Holding NV	阿斯麦控股公司	ASML UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,258	17,045,745.14	0.33
46	Onto Innovation Inc	Onto 创新股份有限公司	ONTO UN	纽约证券交易所	美国	6,106	15,738,734.65	0.31
47	McKesson Corp	McKesson 公司	MCK UN	纽约证券交易所	美国	3,035	15,619,069.18	0.31
48	Sterling Infrastructure Inc	Sterling 基础设施股份有限公司	STRL UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,658	15,195,246.49	0.30
49	Trane Technologies PLC	特灵科技公共有限公司	TT UN	纽约证券交易所	美国	4,523	15,130,527.96	0.30
50	Citigroup Inc	花旗集团	C UN	纽约证券交易所	美国	14,321	13,651,544.29	0.27
51	CrowdStrike Holdings	CrowdStrike 控股股	CRWD UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,610	13,565,919.29	0.27

	Inc	份有限 公司						
52	Quanta Services Inc	Quanta 服务股 份有限 公司	PWR UN	纽约证 券交易 所	美国	2,687	13,177,371.61	0.26
53	MasTec Inc	MasTec 股份有 限公司	MTZ UN	纽约证 券交易 所	美国	4,323	12,250,271.22	0.24
54	Cardinal Health Inc	嘉德诺 健康集 团	CAH UN	纽约证 券交易 所	美国	7,526	12,177,048.46	0.24
55	ARM Holdings PLC	ARM 控 股公共 有限公司	ARM UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	5,000	12,074,704.07	0.24
56	Goldman Sachs Group Inc/The	高盛	GS UN	纽约证 券交易 所	美国	1,687	11,620,629.47	0.23
57	Southern Copper Corp	南方铜 业公司	SCCO UN	纽约证 券交易 所	美国	9,210	10,931,049.07	0.21
58	Bloom Energy Corp	Bloom 能源公 司	BE UN	纽约证 券交易 所	美国	5,287	10,899,993.41	0.21
59	Gilead Sciences Inc	吉利德 科学公 司	GILD UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	12,649	10,884,326.70	0.21
60	Amkor Technolog y Inc	安靠技 术公司	AMKR UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	18,407	10,810,503.02	0.21
61	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	1,103	10,384,872.64	0.20
62	Cia de Minas Buenavent ura SAA	布埃纳 文图拉 矿业公 司	BVN UN	纽约证 券交易 所	美国	48,850	9,745,148.10	0.19
63	RTX Corp	RTX 公 司	RTX UN	纽约证 券交易 所	美国	7,454	9,632,297.75	0.19
64	Uber	优步技	UBER UN	纽约证	美国	19,495	9,581,296.24	0.19

	Technologies Inc	术股份有限公司		券交易所				
65	Intuitive Surgical Inc	直觉外科手术公司	ISRG UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,439	9,314,733.41	0.18
66	Iridium Communications Inc	Iridium 通信股份有限公司	IRDM UW	纳斯达克证券交易所	美国	24,911	9,306,198.20	0.18
67	Marathon Petroleum Corp	马拉松石油公司	MPC UN	纽约证券交易所	美国	5,248	9,138,567.03	0.18
68	Vistra Corp	Vistra 公司	VST UN	纽约证券交易所	美国	8,182	8,839,939.71	0.17
69	Cloudflare Inc	Cloudflare 股份有限公司	NET UN	纽约证券交易所	美国	5,219	8,718,744.24	0.17
70	Analog Devices Inc	亚德诺半导体公司	ADI UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,166	8,564,299.59	0.17
71	Newmont Corp	纽蒙黄金公司	NEM UN	纽约证券交易所	美国	13,399	8,523,613.87	0.17
72	Dell Technologies Inc	戴尔科技公司	DELL UN	纽约证券交易所	美国	2,778	8,163,516.68	0.16
73	Cheniere Energy Inc	切尼尔能源公司	LNG UN	纽约证券交易所	美国	5,006	8,149,133.28	0.16
74	Viasat Inc	ViaSat 股份有限公司	VSAT UW	纳斯达克证券交易所	美国	12,861	7,866,905.59	0.15
75	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公司	TCEHY UV	纽约证券交易所	美国	20,561	7,732,948.88	0.15
76	HCA Healthcare Inc	HCA 医疗保健有限公司	HCA UN	纽约证券交易所	美国	2,896	7,690,333.22	0.15
77	Monster Beverage	怪兽饮料公司	MNST UW	纳斯达克证券	美国	11,462	7,503,755.42	0.15

	Corp			交易所				
78	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	5,690	7,398,917.69	0.15
79	Coca-Cola Co/The	可口可乐	KO UN	纽约证券交易所	美国	12,981	7,185,267.04	0.14
80	Bank of New York Mellon Corp/The	纽约梅隆银行	BNY UN	纽约证券交易所	美国	7,294	7,184,037.47	0.14
81	TJX Cos Inc/The	TJX 公司	TJX UN	纽约证券交易所	美国	6,906	7,125,965.42	0.14
82	Walmart Inc	沃尔玛股份有限公司	WMT UW	纳斯达克证券交易所	美国	9,122	7,036,733.92	0.14
83	Valero Energy Corp	Valero 能源	VLO UN	纽约证券交易所	美国	3,950	7,006,631.64	0.14
84	Alcoa Corp	美国铝业公司	AA UN	纽约证券交易所	美国	19,672	6,985,927.05	0.14
85	Celestica Inc	天弘股份有限公司	CLS UN	纽约证券交易所	美国	2,780	6,907,233.37	0.14
86	Carpenter Technology Corp	卡朋特科技公司	CRS UN	纽约证券交易所	美国	1,639	6,885,825.08	0.14
87	EchoStar Corp	回声星通信公司	ECHO UW	纳斯达克证券交易所	美国	9,053	6,258,396.39	0.12
88	Morgan Stanley	摩根士丹利	MS UN	纽约证券交易所	美国	4,195	5,972,633.50	0.12
89	Interactive Brokers Group Inc	盈透证券集团股份有限公司	IBKR UW	纳斯达克证券交易所	美国	10,028	5,944,806.34	0.12
90	AT&T Inc	美国电话电报公司	T UN	纽约证券交易所	美国	41,244	5,814,811.32	0.11
91	Jabil Inc	捷普集	JBL UN	纽约证	美国	2,098	5,508,227.11	0.11

		团		券交易 所				
92	Lockheed Martin Corp	洛克希 德马丁	LMT UN	纽约证 券交易 所	美国	1,558	5,406,074.78	0.11
93	MKS Inc	MKS 股 份有限 公司	MKSI UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,760	5,331,899.44	0.10
94	SPX Technolog ies Inc	SPX 公 司	SPXC UN	纽约证 券交易 所	美国	3,070	5,126,373.04	0.10
95	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	11,753	5,034,250.65	0.10
96	Phillips 66	菲利浦 66	PSX UN	纽约证 券交易 所	美国	4,112	4,734,485.44	0.09
97	Phinia Inc	Phinia 股份有 限公司	PHIN UN	纽约证 券交易 所	美国	8,438	4,733,834.72	0.09
98	EMCOR Group Inc	埃姆科 集团公司	EME UN	纽约证 券交易 所	美国	825	4,663,089.50	0.09
99	PepsiCo Inc	百事公 司	PEP UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	5,025	4,634,034.20	0.09
100	American Express Co	美国运 通	AXP UN	纽约证 券交易 所	美国	1,996	4,598,358.70	0.09
101	Bank of America Corp	美国银 行公司	BAC UN	纽约证 券交易 所	美国	11,819	4,586,777.58	0.09
102	Chevron Corp	雪佛龙	CVX UN	纽约证 券交易 所	美国	4,035	4,555,413.25	0.09
103	Tapestry Inc	TPR-DR S-RS	TPR UN	纽约证 券交易 所	美国	4,552	4,538,250.88	0.09
104	JPMorgan Chase & Co	摩根大 通	JPM UN	纽约证 券交易 所	美国	2,033	4,532,394.39	0.09
10	Boeing	波音	BA UN	纽约证	美国	2,959	4,362,617.99	0.09

5	Co/The			券交易所				
106	Enova International Inc	Enova International 公司	ENVA UN	纽约证券交易所	美国	2,599	4,261,289.10	0.08
107	Anglogold Ashanti Plc	安格鲁阿山帝公共有限公司	AU UN	纽约证券交易所	美国	7,619	4,197,563.87	0.08
108	Cadence Design Systems Inc	铿腾电子科技有限公司	CDNS UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,602	4,095,139.71	0.08
109	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	3,147	4,036,861.16	0.08
110	Booking Holdings Inc	缤客控股公司	BKNG UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,289	3,992,763.17	0.08
111	Halozyne Therapeutics Inc	Halozyne Therapeutics 股份有限公司	HALO UW	纳斯达克证券交易所	美国	7,432	3,961,918.51	0.08
112	Cintas Corp	信达思公司	CTAS UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,135	3,631,577.33	0.07
113	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	3,211	3,564,339.99	0.07
114	TD SYNEX Corp	TD SYNEX 公司	SNX UN	纽约证券交易所	美国	1,898	3,455,927.76	0.07
115	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	37,837	3,442,925.75	0.07
116	Powell Industrie	Powell 工业股	POWL UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,728	3,370,238.19	0.07

	s Inc	份有限 公司		交易所				
11 7	APA Corp	APA	APA UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	15,170	3,365,176.47	0.07
11 8	Altria Group Inc	高特利	MO UN	纽约证 券交易 所	美国	6,861	3,362,193.63	0.07
11 9	Bristol-M yers Squibb Co	百时美 施贵宝 公司	BMJ UN	纽约证 券交易 所	美国	8,547	3,354,219.36	0.07
12 0	Virtu Financial Inc	Virtu 金融股 份有限 公司	VIRT UN	纽约证 券交易 所	美国	8,220	3,335,062.07	0.07
12 1	Targa Resources Corp	Targa 资源公 司	TRGP UN	纽约证 券交易 所	美国	1,792	3,272,684.31	0.06
12 2	Sandisk Corp	闪迪公 司/特 拉华州	SNDK UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	210	3,252,091.01	0.06
12 3	WEC Energy Group Inc	WEC 能 源集团 股份有 限公司	WEC UN	纽约证 券交易 所	美国	4,045	3,217,024.07	0.06
12 4	DaVita Inc	DaVita 股份有 限公司	DVA UN	纽约证 券交易 所	美国	2,043	3,095,735.49	0.06
12 5	Hasbro Inc	孩之宝	HAS UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	5,419	3,048,253.78	0.06
12 6	Advanced Energy Industrie s Inc	Advanc ed 能源 工业公 司	AEIS UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,199	3,044,956.76	0.06
12 7	NRG Energy Inc	NRG 能 源股份 有限公 司	NRG UN	纽约证 券交易 所	美国	2,956	2,940,628.96	0.06
12 8	Verizon Communica tions Inc	Verizo n 通信 股份有 限公司	VZ UN	纽约证 券交易 所	美国	10,099	2,912,284.04	0.06
12	Lattice	莱迪斯	LSCC UW	纳斯达	美国	2,791	2,907,650.58	0.06

9	Semiconduc tor Corp	半导体 公司		克证券 交易所				
13 0	Johnson & Johnson	强生	JNJ UN	纽约证 券交易 所	美国	1,680	2,906,003.98	0.06
13 1	Akamai Technolog ies Inc	阿卡迈 技术公 司	AKAM UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,583	2,884,732.38	0.06
13 2	Cisco Systems Inc	思科公 司	CSCO UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,599	2,879,229.92	0.06
13 3	BWX Technolog ies Inc	BWX 科 技公司	BWXT UN	纽约证 券交易 所	美国	2,164	2,868,905.01	0.06
13 4	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴 巴集团 控股有 限公司	BABA UN	纽约证 券交易 所	美国	4,371	2,857,367.21	0.06
13 5	Exelixis Inc	Exelix is 股份 有限公 司	EXEL UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	7,699	2,853,103.65	0.06
13 6	Hilton Worldwide Holdings Inc	希尔顿 全球控 股股份 有限公 司	HLT UN	纽约证 券交易 所	美国	1,255	2,824,666.17	0.06
13 7	Westingho use Air Brake Technolog ies Corp	西屋制 动公司	WAB UN	纽约证 券交易 所	美国	1,532	2,813,086.96	0.06
13 8	FTAI Aviation Ltd	FTAI 航 空有限 公司	FTAI UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,516	2,793,310.01	0.05
13 9	ESCO Technolog ies Inc	ESCO 科技公 司	ESE UN	纽约证 券交易 所	美国	1,164	2,775,077.78	0.05
14 0	Bladex Inc	拉美出 口银行	BLX UN	纽约证 券交易 所	美国	6,628	2,774,918.40	0.05
14 1	Archer-Da niels-Mid land Co	Archer -Danie ls-Mid	ADM UN	纽约证 券交易 所	美国	5,280	2,747,462.57	0.05

		land 公 司						
14 2	Welltower Inc	沃尔塔 公司	WELL UN	纽约证 券交易 所	美国	1,777	2,747,010.94	0.05
14 3	Eaton Corp PLC	伊顿公 共有限 公司	ETN UN	纽约证 券交易 所	美国	927	2,690,395.68	0.05
14 4	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	15,280	2,561,176.28	0.05
14 5	Five Below Inc	Five Below 股份有 限公司	FIVE UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,024	2,478,452.18	0.05
14 6	Fabrinet	Fabrin et 公 司	FN UN	纽约证 券交易 所	美国	641	2,453,921.50	0.05
14 7	Spotify Technolog y SA	Spotif y 科技 股份有 限公司	SPOT UN	纽约证 券交易 所	美国	756	2,364,078.92	0.05
14 8	Crown Holdings Inc	Crown 控股股 份有限 公司	CCK UN	纽约证 券交易 所	美国	3,102	2,362,467.19	0.05
14 9	Vertex Pharmaceu ticals Inc	福泰制 药公司	VRTX UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	697	2,358,075.31	0.05
15 0	Illinois Tool Works Inc	伊利诺 伊工具 股份有 限公司	ITW UN	纽约证 券交易 所	美国	1,272	2,343,207.32	0.05
15 1	Planet Labs PBC	Planet Labs PBC	PL UN	纽约证 券交易 所	美国	10,384	2,343,098.89	0.05
15 2	Constelli um SE	Conste llium 有限公 司	CSTM UN	纽约证 券交易 所	美国	10,779	2,339,726.21	0.05
15	Corpay	Corpay	CPAY UN	纽约证	美国	1,030	2,337,964.70	0.05

3	Inc	股份有 限公司		券交易 所				
15 4	AMETEK Inc	阿美特 克股份 有限公 司	AME UN	纽约证 券交易 所	美国	1,397	2,302,017.32	0.05
15 5	National Fuel Gas Co	国家燃 气公司	NFG UN	纽约证 券交易 所	美国	4,262	2,241,256.19	0.04
15 6	Entegris Inc	Entegr is 股份 有限公 司	ENTG UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,793	2,196,440.19	0.04
15 7	Darling Ingredien ts Inc	Darlin g Ingre dients 公司	DAR UN	纽约证 券交易 所	美国	5,885	2,189,286.84	0.04
15 8	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	987	2,134,550.43	0.04
15 9	Charles Schwab Corp/The	嘉信理 财	SCHW UN	纽约证 券交易 所	美国	3,383	2,126,018.42	0.04
16 0	Hartford Insurance Group Inc/The	哈特福 德保险 集团股 份有限 公司	HIG UN	纽约证 券交易 所	美国	2,331	2,103,915.07	0.04
16 1	Weatherfo rd Internati onal 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	3,733	2,072,144.81	0.04
16 2	Roku Inc	Roku 股 份有限 公司	ROKU UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,196	2,066,123.57	0.04
16 3	Entergy Corp	Enterg y 公司	ETR UN	纽约证 券交易 所	美国	2,583	2,020,680.83	0.04
16 4	Cencora Inc	Cencor a 股份 有限公 司	COR UN	纽约证 券交易 所	美国	1,009	1,944,694.62	0.04

165	XP Inc	XP 股份有限公司	XP UW	纳斯达克证券交易所	美国	16,832	1,864,063.78	0.04
166	Ecolab Inc	艺康集团	ECL UN	纽约证券交易所	美国	981	1,861,530.74	0.04
167	Credo Technology Group Holding Ltd	Credo 科技集团控股有限公司	CRDO UW	纳斯达克证券交易所	美国	994	1,841,110.91	0.04
168	OGE Energy Corp	OGE 能源公司	OGE UN	纽约证券交易所	美国	5,513	1,827,109.61	0.04
169	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	610	1,818,240.59	0.04
170	Viking Holdings Ltd	Viking Holdings Ltd	VIK UN	纽约证券交易所	美国	2,538	1,809,332.34	0.04
171	Stryker Corp	史赛克公司	SYK UN	纽约证券交易所	美国	830	1,779,805.32	0.03
172	Hubbell Inc	哈贝尔公司	HUBB UN	纽约证券交易所	美国	462	1,646,319.85	0.03
173	Boston Scientific Corp	波士顿科学	BSX UN	纽约证券交易所	美国	5,461	1,587,453.79	0.03
174	Northrop Grumman Corp	诺斯洛普格鲁门公司	NOC UN	纽约证券交易所	美国	457	1,585,268.78	0.03
175	Teradata Corp	美商天睿信息系统有限公司	TDC UN	纽约证券交易所	美国	6,431	1,517,701.11	0.03
176	UGI Corp	UGI 公司	UGI UN	纽约证券交易所	美国	6,359	1,495,945.12	0.03
177	Regions Financial Corp	Regions 金融公司	RF UN	纽约证券交易所	美国	7,267	1,494,743.27	0.03
17	Expedia	亿客行	EXPE UW	纳斯达克	美国	856	1,491,813.77	0.03

8	Group Inc	集团股份有限 公司		克证券 交易所				
17 9	CVS Health Corp	CVS 健 康公司	CVS UN	纽约证 券交易 所	美国	2,072	1,459,905.52	0.03
18 0	NiSource Inc	NiSource 公 司	NI UN	纽约证 券交易 所	美国	4,453	1,442,140.99	0.03
18 1	Devon Energy Corp	戴文能 源	DVN UN	纽约证 券交易 所	美国	5,038	1,417,826.14	0.03
18 2	Tenet Healthcar e Corp	Tenet 医疗保 健公司	THC UN	纽约证 券交易 所	美国	1,096	1,396,504.76	0.03
18 3	Watts Water Technolog ies Inc	沃茨水 工业公 司	WTS UN	纽约证 券交易 所	美国	516	1,375,721.43	0.03
18 4	Rocket Lab Corp	Rocket Lab 公 司	RKLB UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,976	1,368,040.10	0.03
18 5	MACOM Technolog y Solutions Holdings Inc	MACOM 技术解 决方案 控股股 份有限 公司	MTSI UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	527	1,365,278.89	0.03
18 6	InterDigi tal Inc	InterD igital 股份有 限公司	IDCC UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	696	1,342,145.60	0.03
18 7	Tutor Perini Corp	Tutor Perini 公司	TPC UN	纽约证 券交易 所	美国	2,067	1,168,062.47	0.02
18 8	Adobe Inc	奥多比 公司	ADBE UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	831	1,160,384.07	0.02
18 9	Parker-Ha nnifin Corp	派克汉 尼汾公 司	PH UN	纽约证 券交易 所	美国	173	1,152,504.81	0.02
19 0	Twilio Inc	Twilio 股份有 限公司	TWLO UN	纽约证 券交易 所	美国	819	1,150,934.96	0.02

19 1	Terex Corp	特雷克斯公司	TEX UN	纽约证券交易所	美国	2,323	1,145,334.36	0.02
19 2	Colgate-Palmolive Co	高露洁棕榄	CL UN	纽约证券交易所	美国	1,789	1,117,093.31	0.02
19 3	SLB Ltd	斯伦贝谢有限公司	SLB UN	纽约证券交易所	美国	3,438	1,088,603.99	0.02
19 4	SharkNinja Inc	SharkNinja 股份有限公司	SN UN	纽约证券交易所	美国	983	1,019,465.12	0.02
19 5	Honeywell International Inc	霍尼韦尔国际公司	HON UW	纳斯达克证券交易所	美国	664	1,012,573.78	0.02
19 6	Honeywell Aerospace Inc	Honeywell Aerospace Inc	HONA UW	纳斯达克证券交易所	美国	664	999,820.50	0.02
19 7	Cummins Inc	康明斯	CMI UN	纽约证券交易所	美国	203	986,093.20	0.02
19 8	United Therapeutics Corp	联合治疗公司	UTHR UW	纳斯达克证券交易所	美国	266	981,633.09	0.02
19 9	Super Group SGHC Ltd	Super Group (SGHC) 有限公司	SGHC UN	纽约证券交易所	美国	10,516	970,497.40	0.02
20 0	DT Midstream Inc	DT Midstream Inc	DTM UN	纽约证券交易所	美国	952	951,458.76	0.02
20 1	Regeneron Pharmaceuticals Inc	再生元制药股份有限公司	REGN UW	纳斯达克证券交易所	美国	223	947,051.69	0.02
20 2	DuPont de Nemours Inc	杜邦公司	DD UN	纽约证券交易所	美国	1,016	938,611.76	0.02
20 3	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	646	936,506.24	0.02

		司						
204	PayPal Holdings Inc	贝宝	PYPL UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,177	934,338.74	0.02
205	AST SpaceMobile Inc	AST SpaceMobile 股份有限公司	ASTS UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,537	930,217.87	0.02
206	Fortinet Inc	飞塔信息	FTNT UW	纳斯达克证券交易所	美国	885	925,967.06	0.02
207	Philip Morris International Inc	菲利普莫里斯国际股份有限公司	PM UN	纽约证券交易所	美国	749	922,887.78	0.02
208	Teekay Corp Ltd	Teekay 有限公司	TK UN	纽约证券交易所	美国	13,256	902,852.90	0.02
209	Ubiquiti Inc	Ubiquiti 股份有限公司	UI UN	纽约证券交易所	美国	234	851,110.63	0.02
210	HEICO Corp	海科航空公司	HEI UN	纽约证券交易所	美国	225	545,844.26	0.01
210	HEICO Corp	海科航空公司	HEI/A UN	纽约证券交易所	美国	135	237,140.89	0.00
211	Travelers Cos Inc/The	旅行家集团	TRV UN	纽约证券交易所	美国	345	775,702.94	0.02
212	Airbnb Inc	爱彼迎股份有限公司	ABNB UW	纳斯达克证券交易所	美国	779	759,244.40	0.01
213	Ralph Lauren Corp	拉夫劳伦	RL UN	纽约证券交易所	美国	269	735,436.15	0.01
214	DoorDash Inc	DoorDash 股份有限公司	DASH UW	纳斯达克证券交易所	美国	552	693,762.09	0.01
21	WESCO	西科国	WCC UN	纽约证	美国	292	686,985.24	0.01

5	Internati onal Inc	际有限 公司		券交易 所				
21 6	Consensus Cloud Solutions Inc	Consen sus Cloud Soluti ons 股 份有限 公司	CCSI UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,521	655,046.14	0.01
21 7	Quest Diagnosti cs Inc	Quest Diagno stics 股份有 限公司	DGX UN	纽约证 券交易 所	美国	451	651,050.19	0.01
21 8	PulteGrou p Inc	Pulte 集团公 司	PHM UN	纽约证 券交易 所	美国	687	642,017.71	0.01
21 9	Wells Fargo & Co	富国集 团公司	WFC UN	纽约证 券交易 所	美国	1,131	636,586.49	0.01
22 0	Starbucks Corp	星巴克 公司	SBUX UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	878	611,093.15	0.01
22 1	Moody's Corp	穆迪	MCO UN	纽约证 券交易 所	美国	188	579,941.05	0.01
22 2	IES Holdings Inc	IES 控 股公司	IESC UQ	纳斯达 克证券 交易所	美国	115	575,425.02	0.01
22 3	Williams Cos Inc/The	威廉姆 斯公司	WMB UN	纽约证 券交易 所	美国	1,113	563,536.73	0.01
22 4	IMAX Corp	IMAX 公 司	IMAX UN	纽约证 券交易 所	美国	2,071	562,240.20	0.01
22 5	Synopsys Inc	新思科 技公司	SNPS UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	182	552,941.15	0.01
22 6	Cava Group Inc	Cava Group Inc	CAVA UN	纽约证 券交易 所	美国	1,021	545,744.34	0.01
22 7	Valvoline Inc	胜牌股 份有限 公司	VVV UN	纽约证 券交易 所	美国	2,006	540,221.79	0.01

228	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	144	519,405.77	0.01
229	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	868	500,025.22	0.01
230	Bridgebio Pharma Inc	Bridgebio 制药股份有限公司	BBIO UW	纳斯达克证券交易所	美国	892	452,490.04	0.01
231	Piper Sandler Cos	Piper Sandler 公司	PIPR UN	纽约证券交易所	美国	912	449,342.86	0.01
232	Pfizer Inc	辉瑞制药公司	PFE UN	纽约证券交易所	美国	2,725	446,917.64	0.01
233	Terawulf Inc	Terawulf 股份有限公司	WULF UR	纳斯达克证券交易所	美国	2,617	440,255.89	0.01
234	US Foods Holding Corp	美国食品控股公司	USFD UN	纽约证券交易所	美国	619	431,080.59	0.01
235	Leonardo DRS Inc	Leonardo DRS 股份有限公司	DRS UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,456	423,144.33	0.01
236	Burlington Stores Inc	伯灵顿商店股份有限公司	BURL UN	纽约证券交易所	美国	193	416,434.77	0.01
237	Chefs' Warehouse Inc/The	Chefs' Warehouse 股份有限公司	CHEF UW	纳斯达克证券交易所	美国	635	415,624.96	0.01
238	First Horizon Corp	第一地平线公司	FHN UN	纽约证券交易所	美国	2,379	415,448.28	0.01

239	Wintrust Financial Corp	Wintrust 金融公司	WTFC UW	纳斯达克证券交易所	美国	376	411,587.59	0.01
240	Reddit Inc	Reddit 股份有限公司	RDDT UN	纽约证券交易所	美国	338	399,595.78	0.01
241	Comcast Corp	康卡斯特公司	CMCSA UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,342	391,600.19	0.01
242	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	1,932	380,153.65	0.01
243	Guardant Health Inc	Guardant Health 股份有限公司	GH UW	纳斯达克证券交易所	美国	364	371,949.52	0.01
244	Popular Inc	Popular 股份有限公司	BPOP UW	纳斯达克证券交易所	美国	332	371,246.90	0.01
245	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	337	367,932.31	0.01
246	Penumbra Inc	Penumbra 股份有限公司	PEN UN	纽约证券交易所	美国	140	301,075.83	0.01
247	Enphase Energy Inc	Enphase 能源股份有限公司	ENPH UQ	纳斯达克证券交易所	美国	889	298,142.79	0.01
248	State Street Corp	道富集团	STT UN	纽约证券交易所	美国	245	283,006.52	0.01
249	East West Bancorp Inc	华美银行集团公司	EWBC UW	纳斯达克证券交易所	美国	315	276,954.01	0.01
250	Intuit Inc	财捷集团	INTU UW	纳斯达克证券交易所	美国	155	275,534.96	0.01
25	Northern	北美信	NTRS UW	纳斯达克	美国	226	267,585.55	0.01

1	Trust Corp	托		克证券交易所				
25 2	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	72	258,158.17	0.01
25 3	Ally Financial Inc	Ally 金融公司	ALLY UN	纽约证券交易所	美国	808	252,872.37	0.00
25 4	Simpson Manufacturing Co Inc	辛普森制造有限公司	SSD UN	纽约证券交易所	美国	174	248,099.97	0.00
25 5	Dycom Industries Inc	戴康工业公司	DY UN	纽约证券交易所	美国	71	244,490.13	0.00
25 6	RenaissanceRe Holdings Ltd	复兴再保险控股公司	RNR UN	纽约证券交易所	美国	113	243,896.29	0.00
25 7	Diamondback Energy Inc	戴蒙德巴克能源	FANG UW	纳斯达克证券交易所	美国	202	241,838.44	0.00
25 8	Constellation Energy Corp	美国联合能源公司	CEG UW	纳斯达克证券交易所	美国	141	238,518.88	0.00
25 9	TE Connectivity PLC	TE Connectivity 公共有限公司	TEL UN	纽约证券交易所	美国	164	225,195.87	0.00
26 0	Leidos Holdings Inc	Leidos 控股公司	LDOS UN	纽约证券交易所	美国	319	223,720.56	0.00
26 1	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	241	223,217.64	0.00
26 2	Axis Capital Holdings Ltd	阿克西斯资本控股有限公司	AXS UN	纽约证券交易所	美国	297	217,333.64	0.00
26	Teledyne	Teledy	TDY UN	纽约证	美国	47	213,482.89	0.00

3	Technologies Inc	ne 科技股份有限公司		券交易所				
264	Excele rate Energy Inc	Excele rate 能源股份有限公司	EE UN	纽约证券交易所	美国	813	210,360.57	0.00
265	Ameriprise Financial Inc	阿默普莱斯金融公司	AMP UN	纽约证券交易所	美国	65	203,096.95	0.00
266	Blackrock Inc	贝莱德股份有限公司	BLK UN	纽约证券交易所	美国	31	203,021.76	0.00
267	International Business Machines Corp	国际商业机器公司	IBM UN	纽约证券交易所	美国	103	197,275.20	0.00
268	Astera Labs Inc	Astera Labs 股份有限公司	ALAB UW	纳斯达克证券交易所	美国	57	187,518.65	0.00
269	ONEOK Inc	Oneok 股份有限公司	OKE UN	纽约证券交易所	美国	309	182,971.15	0.00
270	3M Co	3M 公司	MMM UN	纽约证券交易所	美国	150	165,412.92	0.00
271	US Bancorp	美国合众银行	USB UN	纽约证券交易所	美国	397	163,317.21	0.00
272	Talen Energy Corp	Talen 能源公司	TLN UW	纳斯达克证券交易所	美国	61	159,646.54	0.00
273	General Dynamics Corp	通用动力	GD UN	纽约证券交易所	美国	66	159,237.75	0.00
274	Tempus AI Inc	Tempus AI Inc	TEM UW	纳斯达克证券交易所	美国	393	155,060.29	0.00
275	Intercontinental	洲际交易所	ICE UN	纽约证券交易所	美国	182	152,605.16	0.00

	Exchange Inc	(ICE)		所				
276	Wayfair Inc	Wayfair 股份有限公司	W UN	纽约证券交易所	美国	234	147,294.43	0.00
277	Korn Ferry	光辉国际	KFY UN	纽约证券交易所	美国	322	146,017.25	0.00
278	Robinhood Markets Inc	罗宾汉市场股份公司	HOOD UW	纳斯达克证券交易所	美国	213	145,478.37	0.00
279	StepStone Group Inc	StepStone 集团股份有限公司	STEP UW	纳斯达克证券交易所	美国	512	144,229.80	0.00
280	Incyte Corp	因赛特公司	INCY UW	纳斯达克证券交易所	美国	184	142,063.39	0.00
281	Autodesk Inc	欧特克公司	ADSK UW	纳斯达克证券交易所	美国	107	141,686.74	0.00
282	CenterPoint Energy Inc	中点能源	CNP UN	纽约证券交易所	美国	463	138,877.79	0.00
283	Merit Medical Systems Inc	Merit 医疗系统股份有限公司	MMSI UW	纳斯达克证券交易所	美国	293	138,374.47	0.00
284	ROBLOX Corp	Roblox 公司	RBLX UN	纽约证券交易所	美国	370	137,039.39	0.00
285	Fair Isaac Corp	费埃哲公司	FICO UN	纽约证券交易所	美国	16	130,200.43	0.00
286	Yum China Holdings Inc	百胜中国控股有限公司	YUMC UN	纽约证券交易所	美国	458	127,489.56	0.00
287	Ionis Pharmaceuticals	Ionis 制药股份有限公司	IONS UW	纳斯达克证券交易所	美国	234	126,368.49	0.00

	Inc	公司						
288	PJT Partners Inc	PJT 合伙股份有限公司	PJT UN	纽约证券交易所	美国	122	125,420.54	0.00
289	Alnylam Pharmaceuticals Inc	艾拉伦制药股份有限公司	ALNY UW	纳斯达克证券交易所	美国	58	118,916.54	0.00
290	Select Medical Holdings Corp	Select Medical 控股公司	SEM UN	纽约证券交易所	美国	1,047	117,733.01	0.00
291	TKO Group Holdings Inc	TKO 集团控股股份有限公司	TKO UN	纽约证券交易所	美国	83	113,801.49	0.00
292	Kinder Morgan Inc	特拉华州金德摩根公司	KMI UN	纽约证券交易所	美国	493	107,348.03	0.00
293	Alliant Energy Corp	Alliant 能源公司	LNT UW	纳斯达克证券交易所	美国	204	105,999.13	0.00
294	Fifth Third Bancorp	五三银行	FITB UN	纽约证券交易所	美国	264	101,357.63	0.00
295	FNB Corp/PA	FNB/宾州	FNB UN	纽约证券交易所	美国	778	101,102.63	0.00
296	Blackstone Inc	黑石集团股份有限公司	BX UN	纽约证券交易所	美国	124	99,378.39	0.00
297	Rockwell Automation Inc	罗克韦尔自动化	ROK UN	纽约证券交易所	美国	28	94,414.33	0.00
298	Rambus Inc	Rambus 股份有限公司	RMBS UW	纳斯达克证券交易所	美国	95	85,887.49	0.00
299	Rollins Inc	Rollins 公司	ROL UN	纽约证券交易所	美国	293	83,296.08	0.00
30	TopBuild	TopBui	BLD UN	纽约证	美国	34	82,098.72	0.00

0	Corp	ld 公司		券交易 所				
30 1	Somnigrou p Internati onal Inc	Somnig roup 国 际股份 有限公司	SGI UN	纽约证 券交易 所	美国	153	81,698.11	0.00
30 2	Occidenta l Petroleum Corp	西方石 油	OXY UN	纽约证 券交易 所	美国	217	71,784.77	0.00
30 3	Otter Tail Corp	Otter Tail 公 司	OTTR UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	90	55,156.03	0.00
30 4	Federated Hermes Inc	联邦赫 尔墨斯 股份有 限公司	FHI UN	纽约证 券交易 所	美国	141	53,029.80	0.00
30 5	Exelon Corp	爱克斯 龙公司	EXC UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	160	50,803.87	0.00
30 6	MSCI Inc	MSCI 明晟	MSCI UN	纽约证 券交易 所	美国	13	49,586.89	0.00
30 7	Allstate Corp/The	好事达 保险公 司	ALL UN	纽约证 券交易 所	美国	29	46,996.98	0.00
30 8	Mueller Industrie s Inc	美乐工 业有限 公司	MLI UN	纽约证 券交易 所	美国	54	45,212.25	0.00
30 9	Corteva Inc	科迪华 公司	CTVA UN	纽约证 券交易 所	美国	75	43,261.13	0.00
31 0	Community Health Systems Inc	美国社 区卫生 系统股 份有限 公司	CYH UN	纽约证 券交易 所	美国	1,819	41,379.35	0.00
31 1	Cognizant Technolog y Solutions Corp	高知特 科技解 决方案 公司	CTSH UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	117	30,862.98	0.00
31	S&P	标普全	SPGI UN	纽约证	美国	10	27,738.07	0.00

2	Global Inc	球		券交易所				
313	Palomar Holdings Inc	Palomar 控股股份有限公司	PLMR UW	纳斯达克证券交易所	美国	32	27,546.55	0.00
314	Axon Enterprise Inc	Axon Enterprise 股份有限公司	AXON UW	纳斯达克证券交易所	美国	7	26,727.81	0.00
315	Garmin Ltd	佳明有限公司	GRMN UN	纽约证券交易所	美国	16	25,885.78	0.00
316	Hershey Co/The	好时公司	HSY UN	纽约证券交易所	美国	14	16,729.61	0.00
317	XPO Inc	XPO 股份有限公司	XPO UN	纽约证券交易所	美国	10	13,982.10	0.00
318	Steel Dynamics Inc	Steel Dynamics 股份有限公司	STLD UW	纳斯达克证券交易所	美国	8	12,502.63	0.00
319	McDonald's Corp	麦当劳	MCD UN	纽约证券交易所	美国	6	11,046.33	0.00
320	Berkshire Hathaway Inc	伯克希尔哈撒韦公司	BRK/B UN	纽约证券交易所	美国	3	10,224.32	0.00
321	Skyworks Solutions Inc	思佳讯解决方案公司	SWKS UW	纳斯达克证券交易所	美国	19	8,773.80	0.00
322	Trimble Inc	天宝股份有限公司	TRMB UW	纳斯达克证券交易所	美国	13	4,531.56	0.00
323	Karman Holdings Inc	Karman Holdings Inc	KRMN UN	纽约证券交易所	美国	13	4,420.00	0.00
324	Cargurus Inc	Cargurus 股份有限公司	CARG UW	纳斯达克证券交易所	美国	15	3,482.75	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	Lumentum Holdings Inc	LITE UW	46,313,544.89	0.90
2	QUALCOMM Inc	QCOM UW	40,725,233.05	0.80
3	Alphabet Inc	GOOGL UW	30,928,590.67	0.60
4	Broadcom Inc	AVGO UW	25,844,029.00	0.50
5	Costco Wholesale Corp	COST UW	24,879,507.19	0.49
6	Advanced Micro Devices Inc	AMD UW	23,951,802.06	0.47
7	Amazon.com Inc	AMZN UW	22,628,142.62	0.44
8	Micron Technology Inc	MU UW	21,244,746.39	0.41
9	Netflix Inc	NFLX UW	17,898,673.06	0.35
10	Texas Instruments Inc	TXN UW	15,596,786.53	0.30
11	GE Vernova Inc	GEV UN	14,515,667.83	0.28
12	Lockheed Martin Corp	LMT UN	14,408,605.64	0.28
13	Comfort Systems USA Inc	FIX UN	13,313,444.97	0.26
14	Meta Platforms Inc	META UW	13,281,411.17	0.26
15	ASML Holding NV	ASML UW	12,759,853.77	0.25
16	Amphenol Corp	APH UN	11,917,258.74	0.23
17	Palantir Technologies Inc	PLTR UW	11,406,937.35	0.22
18	Microsoft Corp	MSFT UW	9,782,448.75	0.19
19	Caterpillar Inc	CAT UN	9,142,504.78	0.18
20	AT&T Inc	T UN	8,526,805.77	0.17

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	Alphabet Inc	GOOGL UW	83,433,000.22	1.63
1	Alphabet Inc	GOOG UW	64,470,830.45	1.26
2	NVIDIA Corp	NVDA UW	103,402,685.96	2.02
3	Microsoft Corp	MSFT UW	84,960,324.36	1.66

4	Apple Inc	AAPL UW	78,367,104.69	1.53
5	General Electric Co	GE UN	66,996,758.83	1.31
6	Broadcom Inc	AVGO UW	63,555,218.60	1.24
7	Meta Platforms Inc	META UW	61,909,725.09	1.21
8	AppLovin Corp	APP UW	47,106,591.06	0.92
9	Tesla Inc	TSLA UW	40,087,440.01	0.78
10	Visa Inc	V UN	37,053,800.44	0.72
11	Mastercard Inc	MA UN	32,516,656.87	0.63
12	Palantir Technologies Inc	PLTR UW	25,656,060.75	0.50
13	Netflix Inc	NFLX UW	23,319,574.93	0.46
14	Amazon.com Inc	AMZN UW	19,502,160.27	0.38
15	NRG Energy Inc	NRG UN	13,384,118.28	0.26
16	Capital One Financial Corp	COF UN	13,298,051.13	0.26
17	IDEXX Laboratories Inc	IDXX UW	12,750,168.38	0.25
18	AbbVie Inc	ABBV UN	12,454,664.75	0.24
19	Oracle Corp	ORCL UN	12,429,129.22	0.24
20	Micron Technology Inc	MU UW	12,109,742.00	0.24

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	831,707,417.93
卖出收入（成交）总额	1,478,530,563.64

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	SPDR Gold Shares	ETF	交易型开放式	State Street Global Advisors Inc	5,354,204.60	0.11
2	VanEck Gold Miners ETF/USA	ETF	交易型开放式	Van Eck Associates Corp	3,948,672.40	0.08
3	GraniteShares 2x Long NVDA Daily ETF	ETF	交易型开放式	Graniteshares Advisors LLC	1,580,002.25	0.03
4	Invesco Golden Dragon China ETF	ETF	交易型开放式	Invesco Capital Management LLC	575,381.49	0.01
5	iShares 20+ Year Treasury Bond ETF	ETF	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	252,508.53	—
6	iMGP DBi Managed Futures Strategy ETF	ETF	交易型开放式	iM Global Partner Fund Management LLC	219,531.18	—
7	iShares Russell 1000 Value ETF	ETF	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	34,674.50	—
8	Global X Robotics & Artificial Intelligence ETF	ETF	交易型开放式	Global X Management Co LLC	25,323.74	—

注：报告期末，本基金仅持有上述 8 只基金。

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约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同约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	765,910.69
4	应收利息	—
5	应收申购款	18,636,746.46
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	19,402,657.15

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（QDII）—	438,877	1,751.82	38,453,734.27	5.00	730,381,908.56	95.00

人民币						
嘉实美国成长股票（QDII）美元现汇	1,160	2,350.92	-	-	2,727,063.04	100.00
合计	439,677	1,754.84	38,453,734.27	4.98	733,108,971.60	95.02

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，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）。

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	87.87

注：盈利投资者数量占比=盈利投资者数量/投资者总数

其中，投资者指指标计算期间持有过基金份额的投资者，盈利投资者指投资者区间净收益不小于零的投资者。

投资者区间净收益=投资者区间收益-基金交易手续费（认申购费、赎回费、转换费等）。其中，区间收益=持有期末市值-持有期初市值+（赎回+转出+非交易过户出）-（认购+申购+定投+转入+非交易过户入）+现金分红

该指标计算时剔除持有期限不满 7 日的交易。

8.3 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（QDII）-人民币	448,306.51	0.06
	嘉实美国成长股票（QDII）美元现汇	130.06	0.00
	合计	448,436.57	0.06

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	嘉实美国成长股票（QDII）-人民币	0~10
	嘉实美国成长股票（QDII）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（QDII）-人民币	0

	嘉实美国成长股票（QDII） 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（QDII）-人 民币	嘉实美国成长股票（QDII）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	878,768,426.26	3,129,197.11
本报告期基金总申购份额	137,383,283.11	30,917.26
减：本报告期基金总赎回份额	247,316,066.54	433,051.33
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	768,835,642.83	2,727,063.04

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 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

2026 年 6 月 26 日本基金管理人发布公告，程剑先生离任公司副总经理。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

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，会计师事务所为容诚会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况 1	内容
受到调查或处罚等措施的主体	管理人
受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 2 月 12 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	人员管理
受到处罚的依据	《证券投资基金管理公司管理办法》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已从制度建设、流程机制等方面整改完毕。
其他	-

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

管理人相关从业人员受调查或处罚等情况 1	内容
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员
受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 1 月 5 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	监管谈话
受到调查或处罚等措施的原因	合规内控、投资运作
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《开放式证券投资基金销售费用管理规定》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已从加强制度建设、完善流程机制、优化系统功能、加强人员培训等方面整改完毕，已通过整改验收。
其他	-

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	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 (%)	
瑞银集团 Union Bank of Switzerland	—	678,967,601.09	29.48	205,807.81	34.54	—
野村证券 NOMURA	—	418,608,299.03	18.18	23,803.73	4.00	—
摩根士丹利亚洲有限公司 Morgan Stanley Asia Limited	—	296,106,524.49	12.86	88,831.63	14.91	—
摩根大通证券（亚太）有限公司 J.P.Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	—	267,953,825.72	11.64	80,386.23	13.49	—
里昂证券有限公司 CLSA Limited	—	241,804,238.13	10.50	72,541.20	12.18	—
花旗环球金融亚洲有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited	—	174,585,092.14	7.58	54,827.67	9.20	—
高盛（亚洲）有限责任公司 Goldman Sachs (Asia)	—	97,596,262.74	4.24	30,097.14	5.05	—

L. L. C						
招商证券 (香港)有 限公司 China Me rchants Securitie s (HK) Co. , Ltd.	-	86,823,038.00	3.77	26,046.93	4.37	-
美林证券 公司 Bank of America Merrill Lynch	-	40,478,073.04	1.76	13,477.39	2.26	-
Wolfe Research Securitie s	-	-	-	-	-	-
德意志银 行股份有 限公司 Deutsche Bank	-	-	-	-	-	-
金贝塔证 券有限公 司 iGoldenbe ta Secur ities Co mpany Limited	-	-	-	-	-	-
麦格理资 本证券股 份有限公 司 Macquarie Securitie s Group	-	-	-	-	-	-
瑞士信贷 (香港)有 限公司 Credit S uisse	-	-	-	-	-	-

(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.	-	-	-	-	-	-

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) 合规风控能力较强；
- (4) 研究、交易等服务能力较强。

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 基金租用或者通过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	成交金额	占当期债	成交金额	占当期权	成交金额	占当期基金成交总

		券 成 交 总 额 的 比 例 (%)		券 回 购 成 交 总 额 的 比 例 (%)		证 成 交 总 额 的 比 例 (%)		额 的 比 例 (%)
瑞银集团 Union Bank of Switzerland	-	-	-	-	-	-	7,057,558 .29	30.0 9
野村证券 NOMURA	-	-	-	-	-	-	1,046,995 .46	4.46
摩根士丹利亚洲有限公司 Morgan Stanley Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券（亚太）有限公司 J.P.Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
里昂证券有限公司 CLSA Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
花旗环球金融亚洲有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited	-	-	-	-	-	-	8,173,715 .40	34.8 5
高盛（亚洲）有限责任公司 Goldman Sachs (Asia) L.L.C	-	-	-	-	-	-	2,727,576 .67	11.6 3
招商证券（香港）有限公司 China Merchants Securities (HK) Co., Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
美林证券公司 Bank of America Merrill Lynch	-	-	-	-	-	-	4,446,618 .73	18.9 6
Wolfe Research Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
德意志银行股份有限公司 Deutsche Bank	-	-	-	-	-	-	-	-
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 Macquaire 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型证券投资基金 2026 年 1 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	2026 年 1 月 15 日
2	关于嘉实美国成长股票型证券投资基金 2026 年 4 月 3 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	2026 年 4 月 1 日
3	关于嘉实美国成长股票（QDII）基金经理变更的公告	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	2026 年 4 月 11 日
4	关于嘉实美国成长股票（QDII）基金经理变更的公告	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	2026 年 5 月 13 日
5	关于嘉实美国成长股票型证券投资基金 2026 年 5 月 25 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	2026 年 5 月 21 日
6	关于嘉实美国成长股票型证券投资基金增聘境外托管人的公告	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	2026 年 6 月 6 日
7	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 6 月 26 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

本基金本报告期无需要披露的单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

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

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

嘉实基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日