

大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2022 年中期报告

2022 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：2022 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 2022 年 8 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 2022 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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	9
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	45
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	45

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	45
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	94
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	96
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	96
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	96
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	96
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	96
7.11 投资组合报告附注	96
§8 基金份额持有人信息	97
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	97
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	97
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	97
§9 开放式基金份额变动	98
§10 重大事件揭示	98
10.1 基金份额持有人大会决议	98
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	98
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	98
10.4 基金投资策略的改变	98
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	98
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	99
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	99
10.8 其他重大事件	100
§11 影响投资者决策的其他重要信息	101
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	101
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	101
§12 备查文件目录	101
12.1 备查文件目录	101
12.2 存放地点	101
12.3 查阅方式	101

§ 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	167,034,269.98 份
基金合同存续期	不定期

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）
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
	联系电话	0755-83183388
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn
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	刘连舸

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		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

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(2022年1月1日-2022年6月30日)
本期已实现收益	11,473,014.52
本期利润	-45,773,973.53
加权平均基金份额本期利润	-0.2763
本期加权平均净值利润率	-12.84%
本期基金份额净值增长率	-11.94%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)
期末可供分配利润	108,604,444.80
期末可供分配基金份额利润	0.6502
期末基金资产净值	333,520,962.42
期末基金份额净值	1.997
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)
基金份额累计净值增长率	150.44%

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。

4、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。截至本报告期末，本基金美元份额无份额持有人。

3.2 基金净值表现

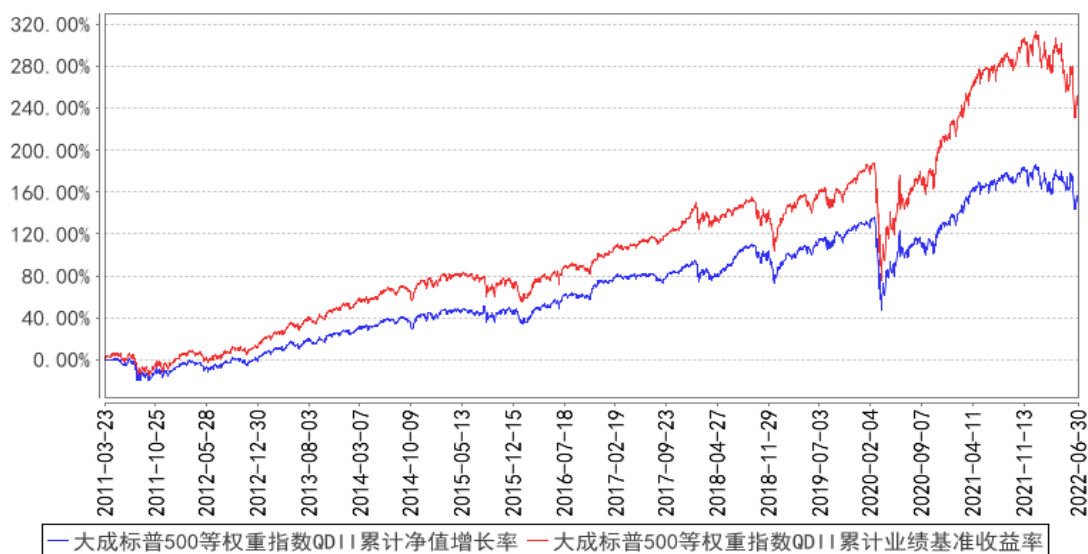
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-8.27%	1.71%	-9.40%	1.80%	1.13%	-0.09%
过去三个月	-9.06%	1.54%	-14.36%	1.62%	5.30%	-0.08%
过去六个月	-11.94%	1.39%	-16.68%	1.44%	4.74%	-0.05%
过去一年	-6.61%	1.13%	-9.38%	1.18%	2.77%	-0.05%
过去三年	17.76%	1.58%	32.14%	1.66%	-14.38%	-0.08%
自基金合同生效起至今	150.44%	1.14%	241.39%	1.20%	-90.95%	-0.06%

注：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

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、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经中国证监会证监基金字[1999]10号文批准，于1999年4月12日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本为2亿元人民币，注册地为深圳。目前公司由三家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。公司业务资质齐全，是全国同时具有境内、境外社保基金管理人资格和基本养老保险基金管理人资格的四家基金公司之一，全面涵盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理、私募股权投资等业务，旗下大成国际资产管理公司具备QFII、RQFII等资格。

历经23年的发展，大成基金形成了以长期投资能力为核心竞争优势，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。目前已形成权益、固定收益、量化投资、商品期货、境外投资、大类资产配置等六大投资团队，全面覆盖各类投资领域。

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	-	19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指数证券投资基金基金经理。2016年12月2日起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。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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

无。

4.3 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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 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，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大，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。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在 1 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，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股当日成交量 5% 的情形；主动投资组合间债券交易存在 2 笔同日反向交易，原因为流动性需要或合规比例调整。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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年上半年，全球资本市场都出现了较大幅度的波动，美股也不例外，美股在上半年出现了大幅震荡并录得了显著的负收益。导致美股上半年下跌的因素有很多，但主要有以下几个方面。

首先，由于美联储实行了较长时间的量化宽松政策，美国的通胀水平不仅居高不下，还有持续上升的势态。最新公布的美国 5 月份 CPI 同比升 8.6%，并创出了本轮通胀以来的新高。过高的通胀数据会引发美联储严厉的紧缩性货币政策走向，所以引发了股票市场的剧烈波动。

其次，为了应对较高的通胀水平，美联储采取了较为严厉的紧缩性货币政策。美联储通过数次的加息行为，已经将联邦基金目标利率区间抬升至 2.25-2.50%，同时还采取了缩减资产负债表的货币政策。美联储的行为表明，为了坚定地致力于将通胀恢复到 2% 的目标，美联储已经并将继续采取较为激进的紧缩性货币政策。

此外，上半年发生了俄罗斯及乌克兰地缘政治事件。由于俄乌冲突导致能源价格进一步上涨，

加剧了对通货膨胀的担忧，因此也导致美股出现过大幅波动。

6 月份以来，美股市场的关注焦点迅速从高通胀和快紧缩向弱增长切换，衰退担忧明显升温。这是因为高通胀一方面会导致消费者实际可支配收入的边际减少，损害居民支出能力，另一方面会提高企业的经营成本，损害企业盈利能力，此外，高通胀还导致利率水平的大幅提升，也对经济增长有损害。

今年一季度美国 GDP 增速环比折年率为-1.6%，二季度季度美国 GDP 增速环比折年率为-0.9%，已经出现连续两个季度的轻微负增长，表明美国经济面临的压力较大。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.997 元；本报告期基金份额净值增长率为-11.94%，业绩比较基准收益率为-16.68%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

最新公布的美国 PMI 数据表明，美国经济已经在开始走弱，但当前还尚未陷入深度衰退状态。美国经济是否会陷入衰退还需要进一步观察，但是当前美国非政府部门资产负债表依然相对较为健康，因此即便出现衰退，可能大概率也不会是深度衰退。

经过今年以来的下跌，美股估值水平得以大幅下降。来自彭博的一致预期数据显示，当前标普 500 指数的动态市盈率为 17.8 倍左右，基本位于历史平均水平区间。

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。

4.7 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。估值委员会由股票投资部、固定收益总部、研究部、指数与期货投资部、大类资产配置部、权益专户投资部、国际业务部、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七名投资组合经理。

股票投资部、固定收益总部、研究部、指数与期货投资部、大类资产配置部、权益专户投资部、国际业务部、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。

4.8 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 等权重指数证券投资基金已分配利润 10,809,800.32 元（每十份基金份额分红 0.6460 元），符合基金合同规定的分红比例。

4.9 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：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	23,825,957.79	25,789,733.91
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	310,100,456.34	371,193,451.91
其中：股票投资		310,100,456.34	371,193,451.91
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		-	-
应收股利		405,105.17	381,084.98
应收申购款		1,833,810.13	1,015,822.23
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	120,838.16	499.87
资产总计		336,286,167.59	398,380,592.90
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末

		2022 年 6 月 30 日	2021 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		2,319,437.57	4,499,883.43
应付管理人报酬		278,553.22	328,450.39
应付托管费		69,638.30	82,112.59
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	97,576.08	78,351.32
负债合计		2,765,205.17	4,988,797.73
净 资 产:			
实收基金	6.4.7.10	167,034,269.98	168,582,964.25
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	166,486,692.44	224,808,830.92
净资产合计		333,520,962.42	393,391,795.17
负债和净资产总计		336,286,167.59	398,380,592.90

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.997 元，基金份额总额 167,034,269.98 份。

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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本 期	上 年 度 可 比 期 间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-43,361,250.11	40,353,127.78
1. 利息收入		18,159.07	15,309.88
其中：存款利息收入	6.4.7.13	18,159.07	15,309.88
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-

其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		13,428,635.62	11,531,232.12
其中：股票投资收益	6.4.7.14	10,626,563.14	9,177,014.00
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	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	2,802,072.48	2,354,218.12
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-57,246,988.05	28,904,207.27
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		332,974.77	-271,754.61
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	105,968.48	174,133.12
减：二、营业总支出		2,412,723.42	2,073,136.11
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,772,793.35	1,444,707.51
2. 托管费	6.4.10.2.2	443,198.36	361,176.95
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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	196,731.71	267,251.65
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-45,773,973.53	38,279,991.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-45,773,973.53	38,279,991.67
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-45,773,973.53	38,279,991.67

6.3 净资产（基金净值）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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	168,582,964.25	-	224,808,830.92	393,391,795.17
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	168,582,964.25	-	224,808,830.92	393,391,795.17
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,548,694.27	-	-58,322,138.48	-59,870,832.75
(一)、综合收益总额	-	-	-45,773,973.53	-45,773,973.53
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-1,548,694.27	-	-1,738,364.63	-3,287,058.90
其中:1. 基金申购款	43,925,163.30	-	50,143,565.25	94,068,728.55
2. 基金赎回款	-45,473,857.57	-	-51,881,929.88	-97,355,787.45

(三)、 本期向 基金份额 持有人分 配利润产 生的基金 净值变动 (净值减少 以“-” 号填列)	-	-	-10,809,800.32	-10,809,800.32
(四)、 其他综合 收益结转 留存收益	-	-	-	-
四、本期 期末净 资产(基 金净值)	167,034,269.98	-	166,486,692.44	333,520,962.42
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期 期末净 资产(基 金净值)	112,448,859.42	-	107,614,530.59	220,063,390.01
加:会计 政策变 更	-	-	-	-
前期差 错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期 期初净 资产(基 金净值)	112,448,859.42	-	107,614,530.59	220,063,390.01
三、本期 增减变 动额(减 少以“-” 号填列)	49,621,471.70	-	87,067,190.97	136,688,662.67

(一)、综合收益总额	-	-	38,279,991.67	38,279,991.67
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	49,621,471.70	-	54,928,663.58	104,550,135.28
其中:1.基金申购款	117,974,210.85	-	129,314,843.40	247,289,054.25
2.基金赎回款	-68,352,739.15	-	-74,386,179.82	-142,738,918.97
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-6,141,464.28	-6,141,464.28
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	162,070,331.12	-	194,681,721.56	356,752,052.68

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

基金管理人负责人

范瑛

主管会计工作负责人

孙蕊

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《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)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年半年度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 2022 年 06 月 30 日的财务状况以及 2022 年半年度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

除下文中涉及的变更外，本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余

成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本

基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.2. 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风

险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则

按直线法计算。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”),财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外,中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》,本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表,对本基金财务报表的影响列示如下:

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定,本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额,2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日,本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(i) 于 2022 年 1 月 1 日,本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果对比表:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、应收利息、应收股利和应收申购款,金额分别为 25,789,733.91 元、499.87 元、381,084.98 元和 1,015,822.23 元。新金融工具

准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、其他资产-应收利息、应收股利和应收申购款，金额分别为 25,790,233.78 元、0.00 元、381,084.98 元和 1,015,822.23 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 371,193,451.91 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 371,193,451.91 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费和其他负债-其他应付款，金额分别为 4,499,883.43 元、328,450.39 元、82,112.59 元和 18,351.32 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费和其他负债-其他应付款，金额分别为 4,499,883.43 元、328,450.39 元、82,112.59 元和 18,351.32 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末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[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。

(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费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	23,825,957.79
等于：本金	23,824,552.65
加：应计利息	1,405.14
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	23,825,957.79
----	---------------

注：于本期末，活期存款中包括的外币余额为美元活期存款 1,060,973.25 元，折合人民币 7,120,615.87 元。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	296,503,008.15	-	310,100,456.34	13,597,448.19
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	296,503,008.15	-	310,100,456.34	13,597,448.19

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 2022年6月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	120,838.16
合计	120,838.16

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4,640.10

应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
其他	3,675.83
预提费用	89,260.15
合计	97,576.08

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	168,582,964.25	168,582,964.25
本期申购	43,925,163.30	43,925,163.30
本期赎回（以“-”号填列）	-45,473,857.57	-45,473,857.57
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	167,034,269.98	167,034,269.98

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	108,719,563.02	116,089,267.90	224,808,830.92
本期利润	11,473,014.52	-57,246,988.05	-45,773,973.53
本期基金份额交易产生的变动数	-778,332.42	-960,032.21	-1,738,364.63
其中：基金申购款	27,439,845.04	22,703,720.21	50,143,565.25
基金赎回款	-28,218,177.46	-23,663,752.42	-51,881,929.88
本期已分配利润	-10,809,800.32	-	-10,809,800.32
本期末	108,604,444.80	57,882,247.64	166,486,692.44

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	活期存款利息收入	18,081.25

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	77.82
合计	18,159.07

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 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	10,626,563.14
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	10,626,563.14

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 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	61,215,161.89
减：卖出股票成本总额	50,555,791.26
减：交易费用	32,807.49
买卖股票差价收入	10,626,563.14

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
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,802,072.48
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	2,802,072.48

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-57,246,988.05
股票投资	-57,246,988.05
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	-57,246,988.05

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	105,968.48
合计	105,968.48

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	106,067.46
银行划款手续费	1,404.10
合计	196,731.71

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数数据使用费及标的指数许可使用费，其中标的指数数据使用费按每年 8,400 美元收取，按年支付；标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按年支付，标的指数许可使用费的收取下限为每年 25,000.00 美元。以上指数使用费包含标的指数许可使用费。

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（“中国银行（香港）有限公司”）	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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,772,793.35	1,444,707.51
其中：支付销售机构的客户维护费	579,404.59	515,351.86

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
----	--	---

当期发生的基金应支付的托管费	443,198.36	361,176.95
----------------	------------	------------

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

无。

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	16,705,341.92	18,081.25	5,537,696.78	15,309.88
中国银行（香港）有限公司	7,120,615.87	-	19,514,438.81	-

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，存放于基金托管人的银行存款按银

行同业利率计息，存放于境外资产托管人的银行存款不计息。

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

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	2022 年 01 月 20 日	-	2022 年 1 月 19 日	0.646	6,885,645.16	3,924,155.16	10,809,800.32	-
合计	-	-	-	0.646	6,885,645.16	3,924,155.16	10,809,800.32	-

6.4.12 期末(2022 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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行 中国银行及境外次托管行中银香港，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在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，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。

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 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 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未来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 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	16,705,341.92	-	-	7,120,615.87	23,825,957.79
交易性金融资产	-	-	-	310,100,456.34	310,100,456.34
应收股利	-	-	-	405,105.17	405,105.17
应收申购款	11,300.00	-	-	1,822,510.13	1,833,810.13
其他资产	-	-	-	120,838.16	120,838.16
资产总计	16,716,641.92	-	-	319,569,525.67	336,286,167.59
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,319,437.57	2,319,437.57
应付管理人报酬	-	-	-	278,553.22	278,553.22
应付托管费	-	-	-	69,638.30	69,638.30
其他负债	-	-	-	97,576.08	97,576.08
负债总计	-	-	-	2,765,205.17	2,765,205.17

利率敏感度缺口	16,716,641.92	-	-	-316,804,320.50	333,520,962.42
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,335,222.05	-	-	21,454,511.86	25,789,733.91
交易性金融资产	-	-	-	-371,193,451.91	371,193,451.91
应收股利	-	-	-	381,084.98	381,084.98
应收申购款	-	-	-	1,015,822.23	1,015,822.23
其他资产	-	-	-	499.87	499.87
资产总计	4,335,222.05	-	-	-394,045,370.85	398,380,592.90
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,499,883.43	4,499,883.43
应付管理人报酬	-	-	-	328,450.39	328,450.39
应付托管费	-	-	-	82,112.59	82,112.59
其他负债	-	-	-	78,351.32	78,351.32
负债总计	-	-	-	4,988,797.73	4,988,797.73
利率敏感度缺口	4,335,222.05	-	-	-389,056,573.12	393,391,795.17

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资产净值无重大影响（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 2022 年 6 月 30 日			合计
	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	
以外币计价的 资产				
银行存款	7,121,048 .02	-	-	7,121,048.02
交易性金融资	310,100,4	-	-	310,100,456.34

产	56.34			
应收股利	405,105.17	-	-	405,105.17
资产合计	317,626,609.53	-	-	317,626,609.53
以外币计价的负债				
其他负债	3,675.83	-	-	3,675.83
负债合计	3,675.83	-	-	3,675.83
资产负债表外汇风险敞口净额	317,622,933.70	-	-	317,622,933.70
项目	上年度末 2021 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				
银行存款	21,454,922.39	-	-	21,454,922.39
交易性金融资产	371,193,451.91	-	-	371,193,451.91
应收股利	381,084.98	-	-	381,084.98
资产合计	393,029,459.28	-	-	393,029,459.28
以外币计价的负债				
其他负债	3,491.97	-	-	3,491.97
负债合计	3,491.97	-	-	3,491.97
资产负债表外汇风险敞口净额	393,025,967.31	-	-	393,025,967.31

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	美元相对人民币升值 5%	15,881,514.22	19,651,298.37
	美元相对人民币贬值 5%	-15,881,514.31	-19,651,298.37

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 2022年6月30日		上年度末 2021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	310,100,456.34	92.98	371,193,451.91	94.36
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	310,100,456.34	92.98	371,193,451.91	94.36

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		
	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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	15,871,120.19	18,714,551.54
	业绩比较基准下降5%	-15,871,120.19	-18,714,551.54

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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	310,100,456.34	371,193,451.91

第二层次		-
第三层次		-
合计	310,100,456.34	371,193,451.91

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、债券和基金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

无。

§ 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	310,100,456.34	92.21
	其中：普通股	310,100,456.34	92.21
	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	23,825,957.79	7.09
8	其他各项资产	2,359,753.46	0.70
9	合计	336,286,167.59	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	310,100,456.34	92.98
合计	310,100,456.34	92.98

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（%）
金融	41,743,508.11	12.52
通信服务	14,067,398.76	4.22
房地产	19,786,219.61	5.93
能源	10,862,014.33	3.26
公用事业	18,590,650.02	5.57
非日常生活消费品	34,795,745.43	10.43
工业	44,157,730.33	13.24
日常消费品	21,706,942.17	6.51
信息技术	46,629,886.98	13.98
医疗保健	41,259,270.10	12.37
原材料	16,501,090.50	4.95
合计	310,100,456.34	92.98

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）

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）	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（%）
----	---------	----------	------	--------	----------	-------	------	--------------

	文)							
1	FedEx Corp	联邦快递	FDX	美国纽约证券交易所	美国	491	747,076.87	0.22
2	Duke Realty Corp	杜克房地产公司	DRE	美国纽约证券交易所	美国	1,952	719,880.87	0.22
3	Clorox Co/Ther	高乐氏公司	CLX	美国纽约证券交易所	美国	760	719,091.61	0.22
4	Vertex Pharmaceuticals Inc	福泰制药	VRTX	纳斯达克证券交易所	美国	377	712,984.44	0.21
5	General Mills Inc	通用磨坊	GIS	美国纽约证券交易所	美国	1,408	712,976.18	0.21
6	Molson Coors Beverage Co	莫尔森库尔斯饮料公司	TAP	美国纽约证券交易所	美国	1,948	712,653.23	0.21
7	Globe Life Inc	Globe Life 股份有限公司	GL	美国纽约证券交易所	美国	1,081	707,147.13	0.21
8	UnitedHealth Group Inc	联合健康集团	UNH	美国纽约证券交易所	美国	205	706,671.16	0.21
9	AbbVie Inc	艾伯维公司	ABBV	美国纽约证券交易所	美国	687	706,179.68	0.21
10	Eli Lilly & Co	礼来	LLY	美国纽约证券交易所	美国	324	705,036.06	0.21
11	Republic Services	公共服务公司	RSG	美国纽约证券交易所	美国	800	702,656.73	0.21

	Inc							
12	Huntington Ingal ls Indus tries Inc	Huntin gton Ingall s 工业 公司	HII	美国纽 约证券 交易所	美国	480	701,701.03	0.21
13	CBOE GLOBA L MARKE TS INC	Cboe 环球市 场公司	CBOE	巴兹全 球市场	美国	918	697,370.97	0.21
14	Churc h & Dwigh t Co Inc	切迟杜 威股份 有限公司	CHD	美国纽 约证券 交易所	美国	1,121	697,125.60	0.21
15	Forti net Inc	Fortin et 股 份有限 公司	FTNT	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,834	696,426.68	0.21
16	Johns on & Johns on	强生	JNJ	美国纽 约证券 交易所	美国	584	695,742.92	0.21
17	Boein g Co/Th e	波音	BA	美国纽 约证券 交易所	美国	758	695,527.62	0.21
18	Lamb Westo n Holdi ngs Inc	蓝威斯 顿控股 股份有 限公司	LW	美国纽 约证券 交易所	美国	1,446	693,496.75	0.21
19	Arthu r J Galla gher & Co	亚瑟加 拉格尔 有限公司	AJG	美国纽 约证券 交易所	美国	629	688,268.57	0.21
20	Monst er Bever age	怪兽饮 料公司	MNST	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,106	688,094.34	0.21

	Corp							
21	Cadence Design Systems Inc	Cadence 设计系统股份有限公司	CDNS	纳斯达克证券交易所	美国	683	687,720.45	0.21
22	Zoetis Inc	硕腾股份有限公司	ZTS	美国纽约证券交易所	美国	596	687,559.04	0.21
23	Moderna Inc	莫德纳公司	MRNA	纳斯达克证券交易所	美国	716	686,446.02	0.21
24	Aon PLC	怡安集团	AON	美国纽约证券交易所	美国	379	685,963.60	0.21
25	Ameren Corp	Ameren 公司	AEE	美国纽约证券交易所	美国	1,131	685,886.02	0.21
26	Everest Re Group Ltd	安富来集团有限公司	RE	美国纽约证券交易所	美国	364	684,709.91	0.21
27	Quest Diagnostics Inc	Quest Diagnostics 股份有限公司	DGX	美国纽约证券交易所	美国	767	684,533.67	0.21
28	FactSet Research Systems Inc	FactSet 研究系统股份有限公司	FDS	美国纽约证券交易所	美国	265	683,965.82	0.21
29	Kimberly-Clark Corp	金佰利	KMB	美国纽约证券交易所	美国	753	683,005.42	0.20
30	Incyte Corp	因赛特公司	INCY	纳斯达克证券交易所	美国	1,339	682,709.31	0.20
31	United Parcel	联合包裹股份有限公司	UPS	美国纽约证券交易所	美国	556	681,155.02	0.20

	Service Inc							
32	Activision Blizzard Inc	动视暴雪股份有限公司	ATVI	纳斯达克证券交易所	美国	1,303	680,882.13	0.20
33	Verisk Analytics Inc	Verisk 分析公司	VRSK	纳斯达克证券交易所	美国	586	680,742.27	0.20
34	CMS Energy Corp	CMS 能源	CMS	美国纽约证券交易所	美国	1,501	679,982.27	0.20
35	Conagra Brands Inc	康尼格拉品牌股份有限公司	CAG	美国纽约证券交易所	美国	2,957	679,513.68	0.20
36	Dollar General Corp	达乐公司	DG	美国纽约证券交易所	美国	412	678,665.36	0.20
37	Humana Inc	Humana 公司	HUM	美国纽约证券交易所	美国	216	678,543.48	0.20
38	Kraft Heinz Co/The	卡夫亨氏公司	KHC	纳斯达克证券交易所	美国	2,650	678,327.91	0.20
39	Pfizer Inc	辉瑞制药	PFE	美国纽约证券交易所	美国	1,927	678,070.26	0.20
40	Automatic Data Processing Inc	ADP 公司	ADP	纳斯达克证券交易所	美国	481	678,047.64	0.20
41	Danaher Corp	丹纳赫	DHR	美国纽约证券交易所	美国	398	677,186.70	0.20
42	Citrix	思杰系统	CTXS	纳斯达克证券交易所	美国	1,036	675,624.02	0.20

	Systems Inc			交易所				
43	Waste Management Inc	废品管理	WM	美国纽约证券交易所	美国	658	675,575.16	0.20
44	Colgate-Palmolive Co	高露洁棕榄	CL	美国纽约证券交易所	美国	1,256	675,541.60	0.20
45	Merck & Co Inc	默克	MRK	美国纽约证券交易所	美国	1,104	675,513.69	0.20
46	Assurant Inc	安信龙集团	AIZ	美国纽约证券交易所	美国	582	675,158.12	0.20
47	Quanta Services Inc	Quanta 服务股份有限公司	PWR	美国纽约证券交易所	美国	802	674,647.91	0.20
48	IQVIA Holdings Inc	IQVIA 控股股份有限公司	IQV	美国纽约证券交易所	美国	463	674,270.00	0.20
49	Centene Corp	Centene 公司	CNC	美国纽约证券交易所	美国	1,187	674,039.79	0.20
50	Laboratory Corp of America Holdings	美国实验控股	LH	美国纽约证券交易所	美国	428	673,194.23	0.20
51	Procter & Gamble Co/Ther	宝洁	PG	美国纽约证券交易所	美国	697	672,627.45	0.20
52	Visa Inc	维萨公司	V	美国纽约证券交易所	美国	509	672,596.44	0.20

53	Oracle Corp	甲骨文	ORCL	美国纽约证券交易所	美国	1,434	672,439.19	0.20
54	McKesson Corp	McKesson 公司	MCK	美国纽约证券交易所	美国	307	672,123.02	0.20
55	Cigna Corp	信诺集团	CI	美国纽约证券交易所	美国	380	672,063.49	0.20
56	McDonald's Corp	麦当劳	MCD	美国纽约证券交易所	美国	405	671,048.72	0.20
57	Duke Energy Corp	杜克能源	DUK	美国纽约证券交易所	美国	932	670,601.21	0.20
58	Mid-America Apartment Communities Inc	Mid-America Apartment Communities Inc	MAA	美国纽约证券交易所	美国	572	670,544.30	0.20
59	International Business Machines Corp	国际商业机器	IBM	美国纽约证券交易所	美国	707	669,940.87	0.20
60	O'Reilly Automotive Inc	O'Reilly 汽车股份有限公司	ORLY	纳斯达克证券交易所	美国	158	669,919.06	0.20
61	Dominio's Pizza Inc	达美乐披萨公司	DPZ	美国纽约证券交易所	美国	256	669,567.92	0.20
62	Abbott Laboratories	雅培制药	ABT	美国纽约证券交易所	美国	918	669,399.73	0.20

63	Old Dominion Freight Line Inc	Old Dominion Freight Line 股份有限公司	ODFL	纳斯达克证券交易所	美国	389	669,079.06	0.20
64	Realty Income Corp	Realty Income 公司	0	美国纽约证券交易所	美国	1,460	668,855.44	0.20
65	Xcel Energy Inc	Xcel 能源	XEL	纳斯达克证券交易所	美国	1,407	668,182.42	0.20
66	Sysco Corp	Sysco 公司	SY	美国纽约证券交易所	美国	1,175	668,014.17	0.20
67	Marsh & McLennan Cos Inc	Marsh & McLennan 股份有限公司	MMC	美国纽约证券交易所	美国	641	667,886.65	0.20
68	Hormel Foods Corp	荷美尔食品有限公司	HRL	美国纽约证券交易所	美国	2,101	667,806.85	0.20
69	Goldman Sachs Group Inc/The	高盛	GS	美国纽约证券交易所	美国	335	667,795.71	0.20
70	Bio-Techne Corp	Bio-technique 公司	TECH	纳斯达克证券交易所	美国	287	667,688.19	0.20
71	Truist Financial Corp	Truist 金融公司	TFC	美国纽约证券交易所	美国	2,096	667,202.29	0.20
72	American Electric	美国电力	AEP	纳斯达克证券交易所	美国	1,036	667,071.82	0.20

	Power Co Inc							
73	Biogen Inc	百健	BIIB	纳斯达克证券交易所	美国	487	666,568.06	0.20
74	Regeneron Pharmaceuticals Inc	再生元制药股份有限公司	REGN	纳斯达克证券交易所	美国	168	666,508.06	0.20
75	Costco Wholesale Corp	开市客	COST	纳斯达克证券交易所	美国	207	665,844.44	0.20
76	West Pharmaceutical Services Inc	西氏医药服务公司	WST	美国纽约证券交易所	美国	328	665,618.93	0.20
77	T-Mobile US Inc	T-Mobile US 股份有限公司	TMUS	纳斯达克证券交易所	美国	737	665,475.44	0.20
78	Rollins Inc	Rollins 公司	ROL	美国纽约证券交易所	美国	2,837	664,885.24	0.20
79	Northrop Grumman Corp	诺斯洛普格鲁门公司	NOC	美国纽约证券交易所	美国	207	664,858.06	0.20
80	American International Group Inc	美源伯根	ABC	美国纽约证券交易所	美国	700	664,670.21	0.20
81	UDR Inc	UDR 公司	UDR	美国纽约证券交易所	美国	2,151	664,643.63	0.20
82	Motorola Solutions Inc	摩托罗拉解决	MSI	美国纽约证券交易所	美国	472	663,966.86	0.20

	Solut ions Inc	方案股 份有限 公司		交易所				
83	Brown & Brown Inc	Brown & Brown 股份有 限公司	BRO	美国纽 约证券 交易所	美国	1,695	663,665.51	0.20
84	Therm o Fishe r Scien tific Inc	Thermo Fisher Scient ific 公司	TMO	美国纽 约证券 交易所	美国	182	663,602.83	0.20
85	AutoZ one Inc	AutoZo ne 股 份有限 公司	AZO	美国纽 约证券 交易所	美国	46	663,485.78	0.20
86	Crown Castl e Inter natio nal Corp	冠城国 际公司	CCI	美国纽 约证券 交易所	美国	587	663,348.47	0.20
87	DTE Energ y Co	DTE 能 源	DTE	美国纽 约证券 交易所	美国	779	662,671.89	0.20
88	Kello gg Co	家乐氏	K	美国纽 约证券 交易所	美国	1,384	662,647.13	0.20
89	Brown -Form an Corp	百富门 公司	BF/B	美国纽 约证券 交易所	美国	1,407	662,516.66	0.20
90	Brist ol-My ers Squib b Co	百时美 施贵宝 公司	BMV	美国纽 约证券 交易所	美国	1,282	662,509.14	0.20
91	Pepsi Co Inc	百事可 乐	PEP	纳斯达 克证券 交易所	美国	592	662,164.98	0.20
92	Coca-	可口可	KO	美国纽	美国	1,568	662,031.82	0.20

	Cola Co/Th e	乐		约 证 券 交 易 所				
93	Camp bell Soup Co	金宝汤	CPB	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,052	661,734.64	0.20
94	Progr essiv e Corp/ The	前进保 险公司	PGR	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	848	661,723.64	0.20
95	Equin ix Inc	Equini x 有限 公司	EQIX	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	150	661,428.60	0.20
96	CME Group Inc	芝加哥 商业交 易所	CME	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	481	660,809.14	0.20
97	Cardi nal Healt h Inc	嘉德诺 健康集 团	CAH	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,883	660,565.59	0.20
98	Monde lez Inter natio nal Inc	亿滋国 际	MDLZ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,584	660,069.95	0.20
99	J M Smuck er Co/Th e	JM 斯 马克公 司	SJM	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	768	659,809.01	0.20
100	Extra Space Stora ge Inc	额外空 间仓储 公司	EXR	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	577	658,785.92	0.20
101	Rayth eon Techn ologi es Corp	雷神技 术公司	RTX	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,021	658,578.34	0.20
102	Pinna cle	Pinnac le 西	PNW	美 国 纽 约 证 券	美国	1,342	658,569.82	0.20

	West Capital Corp	部资本		交易所				
103	First Republic Bank/CA	第一共和银行/加州旧金山	FRC	美国纽约证券交易所	美国	680	658,093.04	0.20
104	NiSource Inc	NiSource 公司	NI	美国纽约证券交易所	美国	3,323	657,685.46	0.20
105	Gilead Sciences Inc	吉利德科学	GILD	纳斯达克证券交易所	美国	1,585	657,508.14	0.20
106	Allstate Corp/The	全州保险	ALL	美国纽约证券交易所	美国	773	657,464.11	0.20
107	American Tower Corp	美国发射塔公司	AMT	美国纽约证券交易所	美国	383	656,985.46	0.20
108	Public Storage	公共存储公司	PSA	美国纽约证券交易所	美国	313	656,815.93	0.20
109	Leidos Holdings Inc	Leidos 控股公司	LDOS	美国纽约证券交易所	美国	971	656,303.85	0.20
110	NextEra Energy Inc	新纪元能源公司	NEE	美国纽约证券交易所	美国	1,262	656,069.69	0.20
111	Charles Schwab Corp/The	嘉信理财	SCHW	美国纽约证券交易所	美国	1,547	655,968.61	0.20
112	Dexco	Dexcom	DXCM	纳斯达克	美国	1,311	655,763.04	0.20

	m Inc	股份有限公司		克 证 券 交 易 所				
113	Micro soft Corp	微软	MSFT	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	380	655,001.77	0.20
114	AT&T Inc	美国电 话电报 公司	T	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	4,655	654,823.24	0.20
115	Amgen Inc	AMGEN- T	AMGN	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	401	654,786.33	0.20
116	Atmos Energy Corp	美国阿 特摩斯 能源公 司	ATO	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	870	654,542.71	0.20
117	WEC Energy Group Inc	WEC 能 源集团 股份有 限公司	WEC	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	969	654,496.80	0.20
118	Broad ridge Financial Solutions Inc	布罗德 里奇金 融解决 方案股 份有	BR	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	684	654,389.69	0.20
119	IDEXX Laboratories Inc	爱德士 股份有 限公司	IDXX	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	278	654,381.23	0.20
120	S&P Global Inc	标普全 球	SPGI	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	289	653,759.76	0.20
121	Healthpeak Properties Inc	Health peak 物 业股 份有 限公 司	PEAK	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,757	653,313.65	0.20
122	Molina Healthcare Inc	Molina Health care 股 份有 限公	MOH	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	348	653,047.94	0.20
123	Union	联合太	UNP	美 国 纽	美国	456	652,721.77	0.20

	Pacific Corp	平洋		约 证 券 交 易 所				
124	Camden Property Trust	Camden 房地产 信托公 司	CPT	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	723	652,542.98	0.20
125	Tyson Foods Inc	泰 森 食 品 公 司	TSN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,129	652,091.30	0.20
126	Intuit Inc	Intuit 公 司	INTU	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	252	651,884.19	0.20
127	Hershey Co/The	好 时 公 司	HSY	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	451	651,255.20	0.20
128	Jack Henry & Associates Inc	Jack Henry & Associates 公 司	JKHY	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	539	651,212.38	0.20
129	Principal Financial Group Inc	信 安 金 融	PFGB	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,452	650,865.40	0.20
130	Expeditors International of Washington Inc	华 盛 顿 康 捷 国 际 物 流 公 司	EXPD	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	994	650,168.49	0.19
131	Nasdaq Inc	纳 斯 达 克 股 份 有 限 公 司	NDAQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	635	650,085.67	0.19
132	Fastenal Co	快 扣 公 司	FAST	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,940	649,964.19	0.19

133	Catalent Inc	康泰伦特股份有限公司	CTLT	美国纽约证券交易所	美国	902	649,499.63	0.19
134	M&T Bank Corp	M&T 银行	MTB	美国纽约证券交易所	美国	607	649,326.14	0.19
135	Lockheed Martin Corp	洛克希德马丁	LMT	美国纽约证券交易所	美国	225	649,267.55	0.19
136	Cincinnati Financial Corp	辛辛那提金融	CINF	纳斯达克证券交易所	美国	813	649,198.69	0.19
137	Hartford Financial Services Group Inc/The	哈特福德金融服务	HIG	美国纽约证券交易所	美国	1,478	649,029.56	0.19
138	Ball Corp	波尔	BALL	美国纽约证券交易所	美国	1,406	648,929.43	0.19
139	CBRE Group Inc	世邦魏理仕	CBRE	美国纽约证券交易所	美国	1,313	648,656.34	0.19
140	Waters Corp	沃特世公司	WAT	美国纽约证券交易所	美国	292	648,631.04	0.19
141	ResMed Inc	瑞思迈股份有限公司	RMD	美国纽约证券交易所	美国	461	648,585.87	0.19
142	Yum! Brands Inc	百胜餐饮集团	YUM	美国纽约证券交易所	美国	851	648,301.17	0.19
143	Welltower Inc	Welltower 股份有限公司	WELL	美国纽约证券交易所	美国	1,173	648,298.09	0.19
144	Prolo	安博	PLD	美国纽	美国	821	648,258.49	0.19

	gis Inc			约 证 券 交 易 所				
145	American Water Works Co Inc	美国自来水股份有限公司	AWK	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	649	647,997.28	0.19
146	Sempra Energy	桑普拉能源	SRE	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	642	647,471.17	0.19
147	MSCI Inc	MSCI 明晟	MSCI	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	234	647,268.22	0.19
148	PerkinElmer Inc	珀金埃尔默	PKI	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	678	647,147.82	0.19
149	Boston Scientific Corp	波士顿科学	BSX	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,587	647,096.34	0.19
150	Loews Corp	罗斯公司	L	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,626	646,688.76	0.19
151	Chubb Ltd	邱博保险集团	CB	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	490	646,470.24	0.19
152	Alliant Energy Corp	Alliant 能源公司	LNT	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,643	646,282.52	0.19
153	Equity Residential	公寓物业权益信托	EQR	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,333	646,101.51	0.19
154	WR Berkley Corp	WR Berkley 公司	WRB	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,410	645,949.43	0.19
155	Consolidated Edison	联合爱迪生	ED	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,012	645,913.19	0.19

	n Inc							
156	Travelers Cos Inc/The	旅行家集团	TRV	美国纽约证券交易所	美国	569	645,871.38	0.19
157	Edwards Lifesciences Corp	爱德华生命科学公司	EW	美国纽约证券交易所	美国	1,012	645,845.27	0.19
158	Walmart Inc	沃尔玛股份有限公司	WMT	美国纽约证券交易所	美国	791	645,433.86	0.19
159	Dollar Tree Inc	Dollar Tree 公司	DLTR	纳斯达克证券交易所	美国	617	645,364.53	0.19
160	AvalonBay Communities Inc	Avalon Bay 社区股份有限公司	AVB	美国纽约证券交易所	美国	495	645,326.28	0.19
161	Elevance Health Inc	Elevance 健康股份有限公司	ELV	美国纽约证券交易所	美国	199	644,518.69	0.19
162	Keurig Dr Pepper Inc	Keurig 澎泉思蓝宝公司	KDP	纳斯达克证券交易所	美国	2,713	644,382.12	0.19
163	Dominion Energy Inc	Dominion 能源股份有限公司	D	美国纽约证券交易所	美国	1,203	644,371.11	0.19
164	Cintas Corp	CINTAS 公司	CTAS	纳斯达克证券交易所	美国	257	644,275.68	0.19
165	Trane Technologies PLC	特灵科技公共有限公司	TT	美国纽约证券交易所	美国	739	644,119.43	0.19
166	Equifax	Equifax	EFX	美国纽	美国	525	644,022.59	0.19

	ax Inc	x 股份 有限公司		约 证 券 交易 所				
167	PNC Finan cial Servi ces Group Inc/T he	PNC 财 务服务	PNC	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	608	643,785.41	0.19
168	CH Robin son World wide Inc	罗 宾 逊 全 球 物 流 有 限 公 司	CHRW	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	946	643,596.55	0.19
169	Newel l Brand s Inc	纽 威 尔 品 牌 公 司	NWL	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	5,032	643,014.40	0.19
170	VICI Prope rties Inc	VICI Proper ties 股份有 限公司	VICI	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	3,216	642,983.26	0.19
171	Ecola b Inc	艺 康 集 团	ECL	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	623	642,901.65	0.19
172	Moody 's Corp	穆 迪	MCO	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	352	642,505.41	0.19
173	CVS Healt h Corp	CVS 保 健公司	CVS	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	1,033	642,400.31	0.19
174	L3Har ris Techn ologi es Inc	L3Harr is Techno logies 股份有	LHX	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	396	642,369.57	0.19
175	Enpha se Energy Inc	Enphas e 能源 股份有 限公司	ENPH	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	490	642,063.53	0.19
176	Synop	新 思 科	SNPS	纳 斯 达	美国	315	642,049.44	0.19

	sys Inc	技公司		克 证 券 交 易 所				
177	Tractor Supply Co	拖拉机供应公司	TSCO	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	493	641,395.41	0.19
178	Chipotle Mexican Grill Inc	Chipotle Mexican Grill 股份	CMG	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	73	640,468.77	0.19
179	Alexandria Real Estate Equities Inc	亚历山大房地产股份有限公司	ARE	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	658	640,467.16	0.19
180	Iron Mountain Inc	美国铁山公司	IRM	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,959	640,158.23	0.19
181	LKQ Corp	LKQ 公司	LKQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,943	640,145.88	0.19
182	Agilent Technologies Inc	安捷伦	A	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	803	640,081.72	0.19
183	Public Service Enterprise Group Inc	公共服务企业集团	PEG	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,506	639,594.27	0.19
184	MetLife Inc	大都会集团	MET	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,517	639,277.16	0.19
185	Estee Lauder	雅诗兰黛	EL	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	374	639,237.90	0.19

	r Cos Inc/The			交易所				
186	ANSYS Inc	ANSYS 股份有 限公司	ANSS	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	398	639,176.42	0.19
187	Norfo lk South ern Corp	诺福克 南方	NSC	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	419	639,156.89	0.19
188	VeriS ign Inc	威瑞信 股份有 限公司	VRSN	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	569	638,997.56	0.19
189	T Rowe Price Group Inc	普徠仕	TROW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	838	638,960.05	0.19
190	South ern Co/The	南方公 司	SO	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,335	638,917.56	0.19
191	Becto n Dicki nson and Co	碧迪	BDX	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	386	638,660.72	0.19
192	Willi s Tower s Watso n PLC	韦莱韬 睿惠悦 公共有 限公司	WTW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	482	638,535.88	0.19
193	Chart er Commu nicat ions Inc	查特通 信公司	CHTR	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	203	638,331.93	0.19
194	Arist a Netwo rks Inc	Arista 网络股 份有限 公司	ANET	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,014	637,934.41	0.19
195	ABIOM	Abiome	ABMD	纳 斯 达	美国	384	637,877.23	0.19

	ED Inc	d 股份 有限公司		克 证 券 交易 所				
196	Parke r-Han nifin Corp	派克汉 尼汾	PH	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美 国	386	637,417.23	0.19
197	Teled yne Techn ologi es Inc	Teled yne 科 技股份 有限公 司	TDY	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美 国	253	636,930.85	0.19
198	Exelo n Corp	Exelon 公司	EXC	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美 国	2,093	636,608.24	0.19
199	Jacob s Engin eerin g Group Inc	雅各布 工程集 团	J	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美 国	746	636,502.33	0.19
200	Tyler Techn ologi es Inc	Tyler 科技公 司	TYL	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美 国	285	635,950.79	0.19
201	Roper Techn ologi es Inc	儒博技 术公司	ROP	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美 国	240	635,676.96	0.19
202	Veriz on Commu nicat ions Inc	Verizo n 通信 股份有 限公司	VZ	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美 国	1,866	635,566.22	0.19
203	Digit al Realt y Trust Inc	数字房 地产信 托有限 公司	DLR	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美 国	729	635,207.63	0.19
204	Cente rPoin t	中点能 源	CNP	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美 国	3,197	634,678.71	0.19

	Energ y Inc							
205	SBA Commu nicat ions Corp	SBA 通 信公司	SBAC	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	295	633,655.15	0.19
206	Cisco Syste ms Inc	思科系 统股份 有限公 司	CSCO	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,214	633,589.45	0.19
207	Black Rock Inc	贝莱德 有限公 司	BLK	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	155	633,564.21	0.19
208	Honey well Inter natio nal Inc	霍尼韦 尔	HON	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	543	633,414.08	0.19
209	Texas Instr ument s Inc	德州仪 器	TXN	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	614	633,160.86	0.19
210	IDEX Corp	艺达思 集团	IEX	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	519	632,656.63	0.19
211	Genui ne Parts Co	原配部 件	GPC	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	708	631,972.27	0.19
212	Nords on Corp	诺信公 司	NDSN	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	465	631,774.95	0.19
213	Intui tive Surgi cal Inc	直觉外 科手术 公司	ISRG	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	469	631,764.15	0.19
214	Wells Fargo & Co	富国银 行	WFC	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,403	631,713.95	0.19
215	Venta s Inc	Ventas 公司	VTR	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,830	631,656.16	0.19

216	PPG Industries Inc	PPG 工业	PPG	美国纽约证券交易所	美国	823	631,554.95	0.19
217	Evergy Inc	Evergy 股份有限公司	EVRG	美国纽约证券交易所	美国	1,442	631,478.98	0.19
218	CF Industries Holdings Inc	CF 工业控股股份有限公司	CF	美国纽约证券交易所	美国	1,097	631,179.05	0.19
219	General Dynamics Corp	通用动力	GD	美国纽约证券交易所	美国	425	631,081.33	0.19
220	NetApp Inc	美国网域存储技术有限公司	NTAP	纳斯达克证券交易所	美国	1,441	630,944.35	0.19
221	F5 Inc	F5 股份有限公司	FFIV	纳斯达克证券交易所	美国	614	630,647.17	0.19
222	Citizens Financial Group Inc	公民金融集团	CFG	美国纽约证券交易所	美国	2,632	630,442.61	0.19
223	American International Group Inc	美国国际集团	AIG	美国纽约证券交易所	美国	1,837	630,373.68	0.19
224	Comerica Inc	Comerica 公司	CMA	美国纽约证券交易所	美国	1,279	629,885.16	0.19
225	Bank of New York Mellon	纽约梅隆银行股份有限公司	BK	美国纽约证券交易所	美国	2,250	629,848.11	0.19

	n Corp/ The							
226	Amcor PLC	安姆科 公司	AMCR	美国纽 约证券 交易所	美国	7,548	629,674.55	0.19
227	PTC Inc	PTC 公 司	PTC	纳斯达 克证券 交易所	美国	882	629,474.82	0.19
228	Charl es River Labor atori es Inter natio nal Inc	查理斯 河实验 室国际 有限公司	CRL	美国纽 约证券 交易所	美国	438	628,984.76	0.19
229	Const ellation Brand s Inc	星座公 司	STZ	美国纽 约证券 交易所	美国	402	628,791.87	0.19
230	Mohaw k Indus tries Inc	Mohawk 工业股 份有限 公司	MHK	美国纽 约证券 交易所	美国	755	628,777.31	0.19
231	Garmin Ltd	佳明有 限公司	GRMN	美国纽 约证券 交易所	美国	953	628,403.48	0.19
232	Illin ois Tool Works Inc	伊利诺 伊工具	ITW	美国纽 约证券 交易所	美国	513	627,477.31	0.19
233	Enter gy Corp	Entergy 公司	ETR	美国纽 约证券 交易所	美国	830	627,456.84	0.19
234	Paych ex Inc	Payche x 公司	PAYX	纳斯达 克证券 交易所	美国	821	627,430.46	0.19
235	Morga n	摩根士 丹利	MS	美国纽 约证券	美国	1,229	627,366.50	0.19

	Stanley			交易所				
236	Keyight Technologies Inc	是德科技公司	KEYS	美国纽约证券交易所	美国	678	627,262.88	0.19
237	EPAM Systems Inc	EPAM 系统公司	EPAM	美国纽约证券交易所	美国	317	627,148.52	0.19
238	KeyCorp	KeyCorp 公司	KEY	美国纽约证券交易所	美国	5,420	626,754.83	0.19
239	Air Products and Chemicals Inc	空气产品公司	APD	美国纽约证券交易所	美国	388	626,215.50	0.19
240	Accenture PLC	埃森哲公司	ACN	美国纽约证券交易所	美国	336	626,109.19	0.19
241	AES Corp/The	爱伊斯科公司	AES	美国纽约证券交易所	美国	4,439	625,927.92	0.19
242	Amazon.com Inc	亚马逊公司	AMZN	纳斯达克证券交易所	美国	878	625,854.02	0.19
243	Lumen Technologies Inc	Lumen 科技股份有限公司	LUMN	美国纽约证券交易所	美国	8,546	625,749.86	0.19
244	Masco Corp	马斯可	MAS	美国纽约证券交易所	美国	1,842	625,537.38	0.19
245	Medtronic PLC	美敦力	MDT	美国纽约证券交易所	美国	1,038	625,237.38	0.19
246	PACCAR Inc	帕卡	PCAR	纳斯达克证券交易所	美国	1,131	625,009.46	0.19
247	Copart Inc	Copart 股份有	CPRT	纳斯达克证券交易所	美国	857	624,976.44	0.19

		限公司		交易所				
248	Huntington Bancshares Inc/OH	杭庭顿银行	HBAN	纳斯达克证券交易所	美国	7,736	624,590.27	0.19
249	Hologic Inc	豪洛捷公司	HOLX	纳斯达克证券交易所	美国	1,342	624,164.23	0.19
250	Cognizant Technology Solutions Corp	高知特科技公司	CTSH	纳斯达克证券交易所	美国	1,377	623,715.44	0.19
251	Tesla Inc	特斯拉公司	TSLA	纳斯达克证券交易所	美国	138	623,703.56	0.19
252	Philip Morris International Inc	菲利普莫里斯国际集团公司	PM	美国纽约证券交易所	美国	941	623,585.30	0.19
253	Etsy Inc	Etsy 股份有限公司	ETSY	纳斯达克证券交易所	美国	1,269	623,512.48	0.19
254	Otis Worldwide Corp	奥的斯电梯公司	OTIS	美国纽约证券交易所	美国	1,314	623,223.15	0.19
255	Hasbro Inc	孩之宝	HAS	纳斯达克证券交易所	美国	1,134	623,166.38	0.19
256	Zions Bancorp NA	锡安银行	ZION	纳斯达克证券交易所	美国	1,824	623,097.11	0.19
257	Essex Property Trust	埃塞克斯房地产信托公司	ESS	美国纽约证券交易所	美国	355	623,059.87	0.19

	Inc							
258	North ern Trust Corp	北美信 托	NTRS	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	962	622,910.27	0.19
259	Inter conti nenta l Excha nge Inc	洲 际 交 易 所 (ICE)	ICE	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	985	621,672.96	0.19
260	Zebra Techn ologi es Corp	斑 马 技 术 公 司	ZBRA	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	315	621,437.05	0.19
261	JB Hunt Trans port Servi ces Inc	JB Hunt 运 输 服 务 股 份 有 限 公 司	JBHT	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	588	621,424.36	0.19
262	Xylem Inc/N Y	赛 莱 默 公 司	XYL	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,184	621,241.55	0.19
263	Solar Edge Techn ologi es Inc	SolarE dge 科 技 股 份 有 限 公 司	SEDG	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	338	620,830.27	0.19
264	Apple Inc	苹 果 公 司	AAPL	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	676	620,285.84	0.19
265	Evers ource Ener gy	Evers ource 能 源 公 司	ES	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,094	620,201.68	0.19
266	QUALC OMM Inc	高 通 公 司	QCOM	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	723	619,838.19	0.19
267	Twitt er Inc	推 特 公 司	TWTR	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,470	619,819.94	0.19

268	CSX Corp	CSX 公司	CSX	纳斯达克证券交易所	美国	3,178	619,815.78	0.19
269	Howmet Aerospace Inc	Howmet 航空航天股份有限公司	HWM	美国纽约证券交易所	美国	2,935	619,500.81	0.19
270	Textron Inc	德事隆	TXT	美国纽约证券交易所	美国	1,511	619,306.31	0.19
271	Avery Dennison Corp	艾利丹尼森	AVY	美国纽约证券交易所	美国	570	619,233.36	0.19
272	Regency Centers Corp	Regency Centers 公司	REG	纳斯达克证券交易所	美国	1,555	618,972.62	0.19
273	PPL Corp	PPL 公司	PPL	美国纽约证券交易所	美国	3,399	618,890.88	0.19
274	Kimco Realty Corp	Kimco 房地产公司	KIM	美国纽约证券交易所	美国	4,664	618,839.94	0.19
275	Constellation Energy Corp	美国联合能源公司	CEG	纳斯达克证券交易所	美国	1,610	618,714.57	0.19
276	NortonLifeLock Inc	诺顿LifeLock 股份有限公司	NLOK	纳斯达克证券交易所	美国	4,196	618,416.32	0.19
277	Take-Two Interactive Software Inc	Take-Two 互动软件股份有限公司	TTWO	纳斯达克证券交易所	美国	752	618,405.58	0.19
278	Raymond	Raymond	RJF	美国纽	美国	1,030	618,068.26	0.19

	nd James Finan cial Inc	d James 金融股 份有限 公司		约 证 券 交 易 所				
279	Bio-R ad Labor atori es Inc	伯乐生 命医学 产品有 限公司	BIO	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	186	617,918.60	0.19
280	Penta ir PLC	Pentai r 公共 有限公 司	PNR	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,011	617,740.54	0.19
281	Alleg ion plc	安朗杰 公共有 限公司	ALLE	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	940	617,623.30	0.19
282	Netfl ix Inc	奈飞公 司	NFLX	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	526	617,325.44	0.19
283	Carri er Globa l Corp	开利全 球公司	CARR	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,579	617,228.26	0.19
284	Intel Corp	英特尔	INTC	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,458	617,138.60	0.19
285	Mettl er-To ledo Inter natio nal Inc	梅特勒 -托利 多国际 股份有 限公 司	MTD	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	80	616,788.40	0.18
286	KLA Corp	KLA 公 司	KLAC	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	288	616,744.37	0.18
287	Rockw ell Autom ation Inc	罗克韦 尔自动 化	ROK	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	461	616,656.25	0.18
288	Arche r-Dan iels-	Archer -Danie ls-Mid	ADM	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,184	616,632.69	0.18

	Midland Co	land 公司						
289	International Flavors & Fragrances Inc	国际香料	IFF	美国纽约证券交易所	美国	771	616,385.18	0.18
290	ServiceNow Inc	ServiceNow 公司	NOW	美国纽约证券交易所	美国	193	615,941.15	0.18
291	Stanley Black & Decker Inc	史丹利百得公司	SWK	美国纽约证券交易所	美国	875	615,787.73	0.18
292	Darden Restaurants Inc	达登饭店	DRI	美国纽约证券交易所	美国	811	615,705.98	0.18
293	Packaging Corp of America	美国包装公司	PKG	美国纽约证券交易所	美国	667	615,519.27	0.18
294	Organon & Co	Organon & Co	OGN	美国纽约证券交易所	美国	2,716	615,200.48	0.18
295	Nielsen Holdings PLC	尼尔森控股公开有限公司	NLSN	美国纽约证券交易所	美国	3,947	615,095.38	0.18
296	Discover Financial Services	Discover 金融服务公司	DFS	美国纽约证券交易所	美国	969	615,086.52	0.18
297	Regio	地区金	RF	美国纽	美国	4,876	613,589.75	0.18

	ns Finan cial Corp	融公司		约 证 券 交 易 所				
298	Frank lin Resou rces Inc	富兰克 林资源	BEN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,921	613,411.96	0.18
299	Walt Disne y Co/Th e	华特迪 士尼公 司	DIS	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	968	613,282.36	0.18
300	Starb ucks Corp	星巴克	SBUX	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,196	613,169.88	0.18
301	Aflac Inc	家庭人 寿保险	AFL	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,651	613,085.25	0.18
302	Payco m Softw are Inc	Paycom 软件股 份有限 公司	PAYC	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	326	612,879.14	0.18
303	Las Vegas Sands Corp	拉斯维 加斯金 沙集团	LVS	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,718	612,734.85	0.18
304	Westi nghou se Air Brake Techn ologi es Corp	西屋制 动公司	WAB	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,112	612,569.34	0.18
305	Lennar Corp	Lennar 公司	LEN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,293	612,395.18	0.18
306	McCor mick & Co Inc/M D	味好美 股份有 限公司 /马里 兰州	MKC	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,094	611,244.11	0.18

307	Home Depot Inc/The	家得宝	HD	美国纽约证券交易所	美国	332	611,124.25	0.18
308	Penn National Gaming Inc	佩恩国民博彩	PENN	纳斯达克证券交易所	美国	2,992	610,849.08	0.18
309	State Street Corp	道富集团	STT	美国纽约证券交易所	美国	1,476	610,706.53	0.18
310	Dover Corp	都福	DOV	美国纽约证券交易所	美国	750	610,670.29	0.18
311	Ulta Beauty Inc	Ulta 美容产品公司	ULTA	纳斯达克证券交易所	美国	236	610,558.07	0.18
312	Edison International	爱迪生国际	EIX	美国纽约证券交易所	美国	1,437	609,904.38	0.18
313	Pulte Group Inc	Pulte 集团公司	PHM	美国纽约证券交易所	美国	2,293	609,875.59	0.18
314	Juniper Networks Inc	瞻博网络股份有限公司	JNPR	美国纽约证券交易所	美国	3,188	609,784.38	0.18
315	3M Co	3M 公司	MMM	美国纽约证券交易所	美国	702	609,702.64	0.18
316	Corning Inc	康宁公司	GLW	美国纽约证券交易所	美国	2,882	609,474.45	0.18
317	Target Corp	塔吉特公司	TGT	美国纽约证券交易所	美国	643	609,468.21	0.18
318	Fiserv Inc	Fiserv 公司	FISV	纳斯达克证券交易所	美国	1,020	609,055.52	0.18
319	Fifth	五三银	FITB	纳斯达克	美国	2,699	608,632.70	0.18

	Third Bancorp	行		克 证 券 交 易 所				
320	A O Smith Corp	A0 史 密斯公 司	AOS	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,658	608,451.77	0.18
321	Snap-on Inc	实耐宝	SNA	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	460	608,279.69	0.18
322	eBay Inc	eBay 公 司	EBAY	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,175	608,269.28	0.18
323	CDW Corp/DE	特 拉 华 CDW 公 司	CDW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	575	608,032.71	0.18
324	Cummins Inc	康 明 斯	CMI	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	468	607,865.19	0.18
325	Ameriprise Financial Inc	阿 默 普 莱 斯 金 融 公 司	AMP	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	381	607,758.08	0.18
326	DR Horton Inc	霍 顿 房 屋 公 司	DHI	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,368	607,703.31	0.18
327	Mastercard Inc	万 事 达 股 份 有 限 公 司	MA	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	287	607,668.68	0.18
328	Cooper Cos Inc/The	库 柏 股 份 有 限 公 司	COO	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	289	607,325.86	0.18
329	Gartner Inc	Gartner 公 司	IT	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	374	607,008.68	0.18
330	Federal Realty INVESTMENT TRUST	联 邦 房 地 产 投 资 信 托 公 司	FRT	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	944	606,566.67	0.18
331	Bank	美 国 银	BAC	美 国 纽	美 国	2,903	606,511.84	0.18

	of Ameri ca Corp	行公司		约 证 券 交 易 所				
332	CarMa x Inc	CarMax 股份有 限公司	KMX	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	998	606,032.98	0.18
333	Simon Prope rty Group Inc	西蒙房 地产集 团公司	SPG	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	951	605,830.83	0.18
334	Henry Schei n Inc	亨利香 恩公司	HSIC	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,176	605,678.62	0.18
335	Fidel ity Natio nal Infor matio n Servi ces Inc	繁德信 息技术 有限公 司	FIS	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	984	605,390.29	0.18
336	Lowe' s Cos Inc	劳氏	LOW	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	516	604,896.60	0.18
337	Berks hire Hatha way Inc	伯克希 尔哈撒 韦公司	BRK/B	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	330	604,674.32	0.18
338	Omnico m Group Inc	Omnico m 集团	OMC	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,416	604,507.61	0.18
339	Viatris Inc	晖致	VTRS	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	8,599	604,237.61	0.18
340	DENTS PLY SIRON A Inc	登士柏 西诺德 公司	XRAY	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,519	604,051.97	0.18
341	TJX	TJX 公	TJX	美 国 纽	美国	1,611	603,853.85	0.18

	Cos Inc/The	司		约 证 券 交 易 所				
342	VF Corp	VF 公 司	VFC	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	2,036	603,557.01	0.18
343	Corte va Inc	科迪华 公司	CTVA	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,661	603,532.98	0.18
344	Inves co Ltd	景顺有 限公司	IVZ	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	5,573	603,304.46	0.18
345	STERI S PLC	思泰瑞 医疗公 共有限 公司	STE	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	436	603,230.03	0.18
346	Marke tAxes s Holdi ngs Inc	Market Axess 控股公 司	MKTX	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	351	603,083.12	0.18
347	Hewle tt Packa rd Enter prise Co	慧与	HPE	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	6,768	602,305.73	0.18
348	Eaton Corp PLC	伊顿	ETN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	712	602,045.33	0.18
349	Qorvo Inc	Qorvo 股份有 限公司	QRVO	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	951	602,001.30	0.18
350	Analo g Devic es Inc	亚德诺 半导体	ADI	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	613	601,027.15	0.18
351	WW Grain ger Inc	固安捷 公司	GWW	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	197	600,822.72	0.18
352	Inter natio	国际纸 业	IP	美 国 纽 约 证 券	美 国	2,140	600,779.02	0.18

	nal Paper Co			交易所				
353	HP Inc	惠普	HPQ	美国纽约证券交易所	美国	2,728	600,159.16	0.18
354	Prudential Financial Inc	保德信 金融集团	PRU	美国纽约证券交易所	美国	933	599,122.92	0.18
355	Kroger Co/Ther	克罗格 公司	KR	美国纽约证券交易所	美国	1,885	598,771.31	0.18
356	DXC Technology Co	DXC 技 术公司	DXC	美国纽约证券交易所	美国	2,941	598,265.67	0.18
357	Eastman Chemical Co	伊士曼 化工	EMN	美国纽约证券交易所	美国	993	598,265.00	0.18
358	Weyerhaeuser Co	惠好	WY	美国纽约证券交易所	美国	2,688	597,492.85	0.18
359	Salesforce Inc	Salesforce 股份有限公司	CRM	美国纽约证券交易所	美国	539	597,023.06	0.18
360	Skyworks Solutions Inc	思佳讯 解决方案公司	SWKS	纳斯达克证券交易所	美国	960	596,874.33	0.18
361	Teradyne Inc	泰瑞达	TER	纳斯达克证券交易所	美国	993	596,798.83	0.18
362	Citigroup Inc	花旗集团	C	美国纽约证券交易所	美国	1,933	596,634.53	0.18
363	Southwest Airlines Co	西南航空	LUV	美国纽约证券交易所	美国	2,460	596,342.79	0.18

364	Linde PLC	林德公共有限公司	LIN	美国纽约证券交易所	美国	309	596,286.21	0.18
365	Johnson Controls International plc	江森自控国际有限公司	JCI	美国纽约证券交易所	美国	1,855	596,089.10	0.18
366	Advance Auto Parts Inc	领先汽车配件股份有限公司	AAP	美国纽约证券交易所	美国	513	595,939.90	0.18
367	Occidental Petroleum Corp	西方石油	OXY	美国纽约证券交易所	美国	1,507	595,517.02	0.18
368	Fortive Corp	福迪威公司	FTV	美国纽约证券交易所	美国	1,628	594,164.54	0.18
369	Stryker Corp	史赛克	SYK	美国纽约证券交易所	美国	445	594,118.97	0.18
370	Align Technology Inc	Align 科技股份有限公司	ALGN	纳斯达克证券交易所	美国	374	594,056.75	0.18
371	Fortune Brands Home & Security Inc	Fortune Brands 家居与安全有限公司	FBHS	美国纽约证券交易所	美国	1,477	593,574.74	0.18
372	Autodesk Inc	欧特克	ADSK	纳斯达克证券交易所	美国	514	593,203.46	0.18
373	Boston Properties	波士顿地产公司	BXP	美国纽约证券交易所	美国	993	593,000.11	0.18

	rties Inc							
374	Teleflex Inc	泰利福 公司	TFX	美国纽约 证券交易 所	美国	359	592,349.17	0.18
375	Sealed Air Corp	希悦尔 公司	SEE	美国纽约 证券交易 所	美国	1,528	591,919.71	0.18
376	Lincoln National Corp	林肯国 民	LNC	美国纽约 证券交易 所	美国	1,884	591,372.86	0.18
377	NVR Inc	NVR 股 份有限公 司	NVR	美国纽约 证券交易 所	美国	22	591,214.47	0.18
377	Wynn Resor ts Ltd	永利渡 假村有限 公司	WYNN	纳斯达 克证券交 易所	美国	1,546	591,214.47	0.18
378	Trimble Inc	天宝股 份有限公 司	TRMB	纳斯达 克证券交 易所	美国	1,512	590,896.89	0.18
379	Vornado Realty Trust	沃那多 房地产信 托	VNO	美国纽约 证券交易 所	美国	3,079	590,795.21	0.18
380	Tapestry Inc	TPR-DR S-RS	TPR	美国纽约 证券交易 所	美国	2,882	590,325.62	0.18
381	TE Conne ctivity Ltd	泰科电 子公司	TEL	美国纽约 证券交易 所	美国	777	590,049.85	0.18
382	Pool Corp	Pool 公 司	POOL	纳斯达 克证券交 易所	美国	250	589,311.26	0.18
383	Comcast Corp	康卡斯 特	CMCSA	纳斯达 克证券交 易所	美国	2,237	589,125.89	0.18
384	MGM Resor ts Inter	美高梅 国际酒店 集团	MGM	美国纽约 证券交易 所	美国	3,030	588,713.94	0.18

	natio nal							
385	Elect ronic Arts Inc	电子艺 界	EA	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	721	588,654.55	0.18
386	AMETE K Inc	阿美特 克股份 有限公 司	AME	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	798	588,537.57	0.18
387	Akama i Techn ologi es Inc	阿卡迈 技术公 司	AKAM	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	959	587,821.12	0.18
388	Ross Store s Inc	Ross 商店有 限公司	ROST	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,247	587,763.00	0.18
389	Match Group Inc	Match Group 股份有 限公司	MTCH	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,256	587,453.14	0.18
390	Inger soll Rand Inc	英格索 兰股份 有限公 司	IR	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,080	587,424.68	0.18
391	Zimme r Biome t Holdi ngs Inc	捷迈邦 美控股 股份有 限公司	ZBH	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	833	587,348.04	0.18
392	Gener al Motor s Co	通用汽 车公司	GM	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,751	586,386.83	0.18
393	Inter publi c Group of Cos Inc/The	Interp ublic 集团	IPG	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,173	586,258.84	0.18
394	Whirl	惠而浦	WHR	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	564	586,218.51	0.18

	pool Corp			约 证 券 交 易 所				
395	Ralph Lauren Corp	拉夫劳伦	RL	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	973	585,431.73	0.18
396	Monolithic Power Systems Inc	芯源系统有限公司	MPWR	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	227	585,080.25	0.18
397	Sherwin-Williams Co/The	宣伟	SHW	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	389	584,569.58	0.18
398	Amphe nol Corp	安费诺公司	APH	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,352	584,172.07	0.18
399	Warner Bros Discovery Inc	华纳兄弟探索公司	WBD	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	6,481	583,724.15	0.18
400	Broadcom Inc	博通股份有限公司	AVGO	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	179	583,623.28	0.17
401	Lam Research Corp	泛林集团	LRCX	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	204	583,452.87	0.17
402	Illumina Inc	Illumina 公司	ILMN	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	471	582,774.75	0.17
403	LyondellBasell Industries NV	利安德巴塞尔工业公司	LYB	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	992	582,283.21	0.17
404	Adobe Inc	奥多比	ADBE	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	237	582,255.69	0.17
405	Altria	高特利	MO	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	2,074	581,415.16	0.17

	Group Inc			交易所				
406	Ceridian HCM Holding Inc	Ceridian 人力资本管理控股股份	CDAY	美国纽约证券交易所	美国	1,839	581,073.82	0.17
407	JPMorgan Chase & Co	摩根大通	JPM	美国纽约证券交易所	美国	768	580,431.94	0.17
408	Best Buy Co Inc	百思买	BBY	美国纽约证券交易所	美国	1,326	580,146.44	0.17
409	First Energy Corp	第一能源	FE	美国纽约证券交易所	美国	2,251	579,971.60	0.17
410	US Bancorp	美国合众银行	USB	美国纽约证券交易所	美国	1,876	579,418.79	0.17
411	Global Payments Inc	环汇有限公司	GPN	美国纽约证券交易所	美国	779	578,445.90	0.17
412	Williams Cos Inc/The	威廉姆斯公司	WMB	美国纽约证券交易所	美国	2,760	578,117.31	0.17
413	Live Nation Entertainment Inc	Live Nation 娱乐公司	LYV	美国纽约证券交易所	美国	1,043	578,059.19	0.17
414	General Electric Co	通用电气	GE	美国纽约证券交易所	美国	1,352	577,729.66	0.17
415	DISH Network Corp	DISH 网络公司	DISH	纳斯达克证券交易所	美国	4,796	577,128.59	0.17

416	Applied Materials Inc	应用材料	AMAT	纳斯达克证券交易所	美国	945	577,020.00	0.17
417	NVIDIA Corp	英伟达	NVDA	纳斯达克证券交易所	美国	567	576,855.10	0.17
418	Deere & Co	迪尔	DE	美国纽约证券交易所	美国	287	576,830.67	0.17
419	FMC Corp	FMC 公司	FMC	美国纽约证券交易所	美国	803	576,704.09	0.17
420	Newmont Corp	纽蒙黄金公司	NEM	美国纽约证券交易所	美国	1,440	576,675.70	0.17
421	SVB Financial Group	硅谷银行金融集团	SIVB	纳斯达克证券交易所	美国	217	575,253.09	0.17
422	BorgWarner Inc	博格华纳股份有限公司	BWA	美国纽约证券交易所	美国	2,568	575,127.79	0.17
423	Seagate Technology Holdings PLC	Seagate Technology 控股公司共有	STX	纳斯达克证券交易所	美国	1,199	574,875.44	0.17
424	Signature Bank/ New York NY	Signature 银行/纽约	SBNY	纳斯达克证券交易所	美国	477	573,711.75	0.17
425	FleetCor Technologies Inc	FleetCor 技术股份有限公司	FLT	美国纽约证券交易所	美国	406	572,513.70	0.17
426	Robert Half	罗致恒富国际	RHI	美国纽约证券交易所	美国	1,138	571,977.86	0.17

	International Inc	公司		交易所				
427	Mosaic Co/Ther	Mosaic 公司	MOS	美国纽约证券交易所	美国	1,804	571,830.88	0.17
428	Micro Technology Inc	美光科技股份有限公司	MU	纳斯达克证券交易所	美国	1,538	570,607.52	0.17
429	Westrock Co	WestRock 公司	WRK	美国纽约证券交易所	美国	2,134	570,593.56	0.17
430	Meta Platforms Inc	Meta 平台股份有限公司	META	纳斯达克证券交易所	美国	527	570,326.38	0.17
431	Albemarle Corp	雅保公司	ALB	美国纽约证券交易所	美国	406	569,434.64	0.17
432	Vulcan Materials Co	Vulcan 材料	VMC	美国纽约证券交易所	美国	597	569,352.89	0.17
433	Kinder Morgan Inc	特拉华州金德摩根公司	KMI	美国纽约证券交易所	美国	5,061	569,276.79	0.17
434	TransDigm Group Inc	TransDigm 集团公司	TDG	美国纽约证券交易所	美国	158	569,085.51	0.17
435	PayPal Holdings Inc	Paypal 控股股份有限公司	PYPL	纳斯达克证券交易所	美国	1,214	569,031.15	0.17
436	Walgreens Boots Allia	沃博联公司	WBA	纳斯达克证券交易所	美国	2,237	569,007.93	0.17

	nce Inc							
437	Emers on Elect ric Co	艾默生 电气	EMR	美国纽 约证券 交易所	美国	1,064	567,989.54	0.17
438	Param ount Globa l	派拉蒙 全球	PARA	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,428	567,804.84	0.17
439	Unive rsal Healt h Servi ces Inc	Univer sal 保 健服务 股份有 限公 司	UHS	美国纽 约证券 交易所	美国	839	567,084.37	0.17
440	Synch rony Finan cial	同步金 融公司	SYF	美国纽 约证券 交易所	美国	3,056	566,487.26	0.17
441	Marti n Marie tta Mater ials Inc	Martin Mariet ta 材 料股份 有限 公司	MLM	美国纽 约证券 交易所	美国	282	566,346.05	0.17
442	DuPon t de Nemou rs Inc	杜邦公 司	DD	美国纽 约证券 交易所	美国	1,516	565,497.73	0.17
443	Ford Motor Co	福特汽 车	F	美国纽 约证券 交易所	美国	7,554	564,267.80	0.17
444	Alask a Air Group Inc	阿拉斯 加航空 集团公 司	ALK	美国纽 约证券 交易所	美国	2,098	563,924.71	0.17
445	Dow Inc	陶氏公 司	DOW	美国纽 约证券 交易所	美国	1,625	562,859.95	0.17
446	Chevr on Corp	雪佛龙	CVX	美国纽 约证券 交易所	美国	579	562,600.69	0.17

447	Capital One Financial Corp	第一资本金融	COF	美国纽约证券交易所	美国	804	562,205.66	0.17
448	Nucor Corp	纽柯公司	NUE	美国纽约证券交易所	美国	801	561,290.56	0.17
449	NRG Energy Inc	NRG 能源股份有限公司	NRG	美国纽约证券交易所	美国	2,188	560,509.01	0.17
450	PVH Corp	PVH 公司	PVH	美国纽约证券交易所	美国	1,467	560,215.99	0.17
451	Microchip Technology Inc	微芯科技股份有限公司	MCHP	纳斯达克证券交易所	美国	1,434	558,970.49	0.17
452	Marriott International Inc/MD	万豪国际	MAR	纳斯达克证券交易所	美国	612	558,644.32	0.17
453	ONEOK Inc	Oneok 股份有限公司	OKE	美国纽约证券交易所	美国	1,498	557,979.08	0.17
454	American Airlines Group Inc	美国航空集团公司	AAL	纳斯达克证券交易所	美国	6,547	557,153.31	0.17
455	Aptiv PLC	Aptiv 公共有限公司	APTIV	美国纽约证券交易所	美国	932	557,135.06	0.17
456	United Airlines Holdings	美国联合航空控股股份有限公司	UAL	纳斯达克证券交易所	美国	2,339	556,021.91	0.17

	Inc							
457	Baxter International Inc	百特	BAX	美国纽约证券交易所	美国	1,288	555,222.31	0.17
458	DaVita Inc	DaVita 股份有限公司	DVA	美国纽约证券交易所	美国	1,033	554,352.78	0.17
459	Hilton Worldwide Holdings Inc	希尔顿全球控股股份有限公司	HLT	美国纽约证券交易所	美国	741	554,207.55	0.17
460	NIKE Inc	耐克公司	NKE	美国纽约证券交易所	美国	807	553,525.40	0.17
461	Caterpillar Inc	卡特彼勒	CAT	美国纽约证券交易所	美国	460	551,875.74	0.17
462	HCA Healthcare Inc	HCA 医疗保健有限公司	HCA	美国纽约证券交易所	美国	489	551,551.85	0.17
463	Exxon Mobil Corp	埃克森美孚石油	XOM	美国纽约证券交易所	美国	958	550,624.20	0.17
464	NXP Semiconductors NV	恩智浦半导体公司	NXPI	纳斯达克证券交易所	美国	554	550,392.65	0.17
465	American Express Co	美国运通	AXP	美国纽约证券交易所	美国	589	547,966.88	0.16
466	Norwegian Cruise Line Holdings	挪威邮轮控股有限公司	NCLH	美国纽约证券交易所	美国	7,318	546,147.96	0.16

	Ltd							
467	Caesars Entertainment Inc	凯撒娱乐集团	CZR	纳斯达克证券交易所	美国	2,116	543,910.65	0.16
468	Host Hotels & Resorts Inc	Host 酒店及度假股份有限公司	HST	纳斯达克证券交易所	美国	5,167	543,747.96	0.16
469	ON Semiconductor Corp	安森美半导体公司	ON	纳斯达克证券交易所	美国	1,601	540,578.50	0.16
470	Western Digital Corp	西部数据公司	WDC	纳斯达克证券交易所	美国	1,782	536,154.01	0.16
471	Hess Corp	赫斯公司	HES	美国纽约证券交易所	美国	754	536,098.31	0.16
472	Delta Air Lines Inc	达美航空有限公司	DAL	美国纽约证券交易所	美国	2,742	533,125.03	0.16
473	Expedia Group Inc	亿客行集团股份有限公司	EXPE	纳斯达克证券交易所	美国	836	532,065.56	0.16
474	Pioneer Natural Resources Co	Pioneer 自然资源公司	PXD	美国纽约证券交易所	美国	355	531,498.58	0.16
475	Booking Holdings Inc	Booking 控股有限公司	BKNG	纳斯达克证券交易所	美国	45	528,217.72	0.16

476	United Rentals Inc	联合租赁公司	URI	美国纽约证券交易所	美国	324	528,206.24	0.16
477	Generac Holdings Inc	Generac 控股公司	GNRC	美国纽约证券交易所	美国	371	524,329.33	0.16
478	Celanese Corp	塞拉尼斯公司	CE	美国纽约证券交易所	美国	660	520,956.32	0.16
479	Advanced Micro Devices Inc	AMD 公司	AMD	纳斯达克证券交易所	美国	1,015	520,919.07	0.16
480	Bath & Body Works Inc	Bath & Body Works 股份有限公司	BBWI	美国纽约证券交易所	美国	2,842	513,466.66	0.15
481	Baker Hughes Co	贝克休斯公司	BKR	纳斯达克证券交易所	美国	2,630	509,583.85	0.15
482	Carnival Corp	嘉年华公司	CCL	美国纽约证券交易所	美国	8,716	505,995.26	0.15
483	Diamondback Energy Inc	Diamondback 能源股份有限公司	FANG	纳斯达克证券交易所	美国	619	503,300.30	0.15
484	Halliburton Co	哈利伯顿	HAL	美国纽约证券交易所	美国	2,378	500,496.48	0.15
485	Phillips 66	Phillips 66	PSX	美国纽约证券交易所	美国	905	497,992.26	0.15
486	ConocoPhillips	康菲石油	COP	美国纽约证券交易所	美国	824	496,666.69	0.15
487	EOG Resources	EOG 资源	EOG	美国纽约证券交易所	美国	668	495,126.29	0.15

	Inc							
488	Royal Caribbean Cruises Ltd	皇家加勒比国际游轮有限公司	RCL	美国纽约证券交易所	美国	2,105	493,190.92	0.15
489	Marathon Petroleum Corp	马拉松石油公司	MPC	美国纽约证券交易所	美国	889	490,500.59	0.15
490	Schlumberger NV	斯伦贝谢公众有限公司	SLB	美国纽约证券交易所	美国	2,040	489,599.31	0.15
491	Valero Energy Corp	Valero 能源	VLO	美国纽约证券交易所	美国	685	488,602.00	0.15
492	Coterra Energy Inc	Coterra 能源股份有限公司	CTRA	美国纽约证券交易所	美国	2,807	485,855.23	0.15
493	Devon Energy Corp	戴文能源	DVN	美国纽约证券交易所	美国	1,300	480,824.83	0.14
494	Marathon Oil Corp	Marathon 石油公司	MRO	美国纽约证券交易所	美国	3,179	479,622.95	0.14
495	Freeport-McMoRan Inc	自由港迈克墨伦股份有限公司	FCX	美国纽约证券交易所	美国	2,395	470,319.48	0.14
496	News Corp	新闻集团	NWSA	纳斯达克证券交易所	美国	4,422	462,380.29	0.14
497	APA Corp	APA	APA	纳斯达克证券交易所	美国	1,973	462,131.57	0.14
498	Fox Corp	福克斯公司	FOXA	纳斯达克证券交易所	美国	2,082	449,376.02	0.13

499	Alpha bet Inc	Alphab et 公 司	GOOGL	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	22	321,769.48	0.10
500	Alpha bet Inc	Alphab et 公 司	GOOG	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	20	293,617.04	0.09
501	Fox Corp	福 克 斯 公 司	FOX	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	961	191,554.77	0.06
502	News Corp	新 闻 集 团	NWS	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,369	145,995.84	0.04

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	Warner Bros Discovery Inc	WBD UQ	854,989.42	0.22
2	Molina Healthcare Inc	MOH UN	739,055.31	0.19
3	Camden Property Trust	CPT UN	735,779.56	0.19
4	Nordson Corp	NDSN UQ	674,612.48	0.17
5	VICI Properties Inc	VICI UN	640,803.27	0.16
6	Keurig Dr Pepper Inc	KDP UQ	633,430.67	0.16
7	EPAM Systems Inc	EPAM UN	599,710.43	0.15
8	ON Semiconductor Corp	ON UQ	563,256.51	0.14
9	Etsy Inc	ETSY UQ	528,870.44	0.13
10	Netflix Inc	NFLX UQ	524,362.40	0.13
11	M&T Bank Corp	MTB UN	490,649.34	0.12
12	Constellation Energy Corp	CEG UQ	442,710.79	0.11
13	Align Technology Inc	ALGN UQ	434,650.71	0.11
14	PayPal Holdings Inc	PYPL UQ	402,390.58	0.10
15	Bath & Body Works	BBWI UN	350,060.50	0.09

	Inc			
16	Carnival Corp	CCL UN	345,810.53	0.09
17	Royal Caribbean Cruises Ltd	RCL UN	329,462.16	0.08
18	Dexcom Inc	DXCM UQ	317,627.53	0.08
19	Zebra Technologies Corp	ZBRA UQ	313,596.73	0.08
20	Moderna Inc	MRNA UQ	308,206.49	0.08

注：本期累计买入金额指买入成交金额（成交单价乘以成交数量），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	Cerner Corp	CERN UQ	927,689.78	0.24
2	Occidental Petroleum Corp	OXY UN	772,361.18	0.20
3	M&T Bank Corp	MTB UN	729,724.23	0.19
4	People's United Financial Inc	PBCT UQ	707,229.93	0.18
5	Advanced Micro Devices Inc	AMD UQ	624,721.60	0.16
6	GAP INC/THE	GPS UN	617,666.13	0.16
7	Valero Energy Corp	VLO UN	605,794.50	0.15
8	IPG Photonics Corp	IPGP UQ	579,729.21	0.15
9	S&P Global Inc	SPGI UN	574,806.76	0.15
10	Canadian Pacific Railway Limited	CP UN	573,853.17	0.15
11	Mosaic Co/The	MOS UN	566,478.84	0.14
12	APA Corp	APA UQ	561,954.16	0.14
13	Marathon Oil Corp	MRO UN	561,861.48	0.14
14	Discovery Inc	DISCK UQ	532,767.71	0.14
15	Halliburton Co	HAL UN	523,510.33	0.13
16	CF Industries Holdings Inc	CF UN	510,871.92	0.13
17	Phillips 66	PSX UN	485,279.58	0.12
18	Marathon Petroleum Corp	MPC UN	476,663.12	0.12
19	Devon Energy Corp	DVN UN	447,011.14	0.11
20	ConocoPhillips	COP UN	442,525.09	0.11

注：本期累计卖出金额指卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），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	46,709,783.68
卖出收入（成交）总额	61,215,161.89

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），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

基金投资的前十名证券的发行主体本期未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	405,105.17
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,833,810.13

6	其他应收款	-
7	待摊费用	120,838.16
8	其他	-
9	合计	2,359,753.46

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

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 (%)
43,611	3,830.09	32,916,086.38	19.71	134,118,183.60	80.29

注：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	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	9,015.00	0.0054

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	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

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	168,582,964.25
本报告期基金总申购份额	43,925,163.30
减：本报告期基金总赎回份额	45,473,857.57
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	167,034,269.98

§ 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

1. 根据我司发布的《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第七届董事会第十四次会议审议通过并履行必要程序，自 2022 年 4 月 15 日起，周立新先生因工作安排离任公司副总经理。具体事宜详见公司公告。

2. 根据我司发布的《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第七届董事会第十五次会议审议通过并履行必要程序，自 2022 年 6 月 1 日起，赵冰女士担任公司副总经理，段皓静女士担任公司督察长。自同日起赵冰女士离任公司督察长。具体事宜详见公司公告。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

无

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

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

本报告期内，基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
摩根士丹利	1	107,237,560.75	100.00	32,807.49	100.00	-
-	1	-	-	-	-	-

注：1、公司作为管理人负责选择代理各投资组合证券买卖的境外券商，具体选择标准如下：

- (一) 具备该机构所在国家或地区政府、监管机构核发的营业执照、业务许可证明文件；
- (二) 资历雄厚，信誉良好；
- (三) 财务状况良好，经营行为规范；
- (四) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度(包括但不限于公平交易制度及保密制度)，能满足各投资组合运作高度保密的要求；
- (五) 证券研究或市场研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为各投资组合提供宏观经济、行业情况、个股分析、市场研究等各方面研究报告及周到的信息服务，并能根据各投资组合投资的特定要求，提供专题研究报告；
- (六) 具备各投资组合运作所需的交易执行能力。能够准确、及时、高质量完成各投资组合下达的交易指令。
- (七) 具备各投资组合运作所需的后台清算执行能力。能及时、高效处理交易清算、证券交收等后台清算业务。
- (八) 能提供各投资组合运作、管理所需的其他服务。
- (九) 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。

交易管理部在每半年 15 个交易日内，汇总上半年境外券商综合服务评价结果，作为当次境外券商交易量分配依据。并依此制作交易量分配计划，报部门及公司分管领导批准；

交易量分配计划获批后，作为选择交易券商的依据，供交易员在交易时进行券商选择。

券商服务出现重大失误或其他异常情况时，及时报公司监察稽核部及相关领导。可暂停与该券商的合作，并对其失误所造成的损失进行追偿。

2、本报告期内本基金无新增或退租境外交易单元。

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	关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 06 月 30 日
2	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 06 月 02 日
3	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	2022 年 04 月 23 日
4	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2022 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	2022 年 04 月 22 日
5	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 04 月 16 日
6	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行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	2022 年 03 月 29 日
7	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2021 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	2022 年 03 月 29 日
8	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京中植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	2022 年 03 月 25 日
9	大成基金管理有限公司关于公司固有资金拟申购旗下偏股型公募基金的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 01 月 27 日
10	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信百信银行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	2022 年 01 月 25 日
11	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	2022 年 01 月 21 日
12	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2021 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	2022 年 01 月 21 日

13	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 2021 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	2022 年 01 月 18 日
14	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	2022 年 01 月 13 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

无。

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

2022 年 8 月 30 日