

# 大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：2023 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 2023 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 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表.....	12
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.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	37
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	37
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.....	37

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	76
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	78
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.....	78
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.....	78
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.....	78
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.....	78
7.11 投资组合报告附注.....	78
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>79</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	79
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	80
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.....	80
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>80</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>80</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	80
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.....	80
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	80
10.4 基金投资策略的改变.....	81
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	81
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.....	81
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	81
10.8 其他重大事件.....	82
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>83</b>
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.....	83
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	83
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>83</b>
12.1 备查文件目录.....	83
12.2 存放地点.....	83
12.3 查阅方式.....	84

## § 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	170,287,624.62 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	许俊
	联系电话	0755-83183388	010-66596688
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		4008885558	95566
传真		0755-83199588	010-66594942
注册地址		广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、 27-33 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、 27-33 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518054	100818
法定代表人		吴庆斌	葛海蛟

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	5,416,342.63
本期利润	35,054,703.56
加权平均基金份额本期利润	0.2033
本期加权平均净值利润率	9.44%
本期基金份额净值增长率	9.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	115,427,959.34
期末可供分配基金份额利润	0.6778
期末基金资产净值	393,910,389.70
期末基金份额净值	2.313
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	199.75%

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，本基金份额总额包含人民币份额（份额代码：096001）及美元份额（份额代码：013404）。

### 3.2 基金净值表现

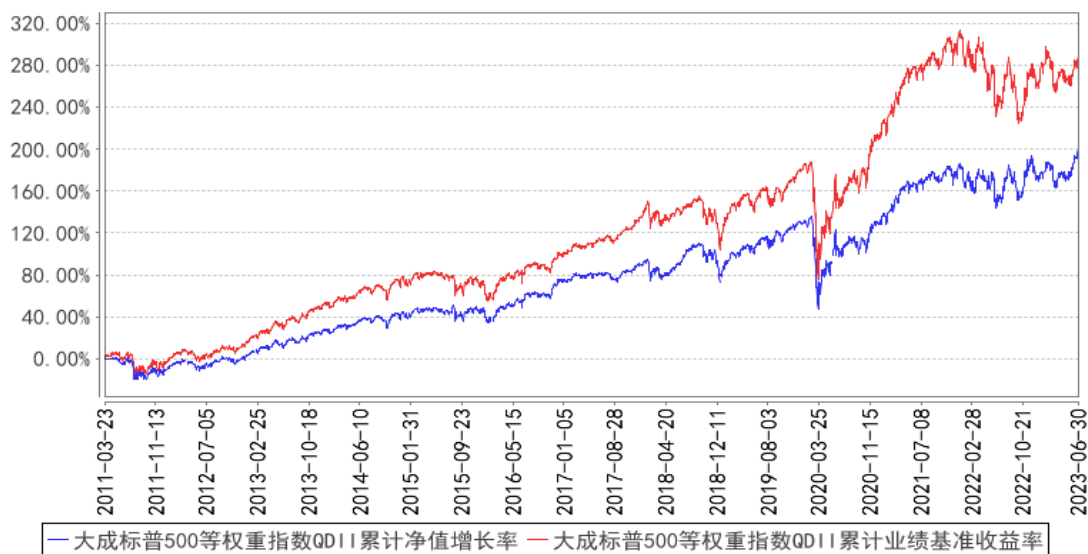
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	9.26%	0.70%	7.72%	0.75%	1.54%	-0.05%
过去三个月	8.54%	0.88%	3.99%	0.89%	4.55%	-0.01%
过去六个月	9.70%	0.99%	7.03%	1.02%	2.67%	-0.03%
过去一年	19.69%	1.17%	13.76%	1.20%	5.93%	-0.03%
过去三年	47.98%	1.11%	55.37%	1.15%	-7.39%	-0.04%
自基金合同生效起至今	199.75%	1.15%	288.37%	1.20%	-88.62%	-0.05%

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24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	-	20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日至2023年3月14日任大成恒生综合中小型股指数基金(QDII-LOF)基金经理。2016年12月29日至2020年7月7日任大成海外中国机会混合型证券投资基金(LOF)基金经理。2017年8月10日起任大成恒生指数证券投资基金(LOF)基金



					<p>经理。2019 年 3 月 20 日起任大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。2021 年 5 月 18 日起任大成恒生科技交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 基金经理。2021 年 9 月 9 日起任大成恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。2023 年 7 月 12 日起任大成纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国</p>
--	--	--	--	--	--

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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行了公平交易的原则和制度。公司运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合连续 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。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价，未发生成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5% 的股票同日反向交易；主动投资组合间债券交易存在 1 笔同日反向交易，原因为流动性需要。投资组合间相邻交易日反向

交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年，国际经济形势相对较为稳定，美股也取得了较好的涨势。在上半年，美股市场的主要焦点依然围绕着通货膨胀水平、美联储货币政策与经济增长预期展开。

从整体来看，上半年美国宏观经济韧性较强，并未陷入经济衰退，其 1 季度 GDP 环比增速折年率终值为 2.0%，2 季度 GDP 环比增速折年率为 2.4%，不仅没有出现负增长，而且还位于较好的增长水平区间。分项来看，个人消费是经济增长的较大支柱，企业固定资产投资也对经济增长起到了正面作用。值得注意的是，此前处于下行通道美国房地产市场在今年出现了边际修复的迹象，具体表现为房屋销售明显反弹、房贷利率高位回落，同时新屋开工也出现明显反弹，这也有效的支持了宏观经济的增长。

美国 CPI 增速下降趋势已经确定，最新的美国 6 月份 CPI 同比为 3.0%，较本轮高点有大幅下降。但是工资增速仍然保持在高位水平，这对核心通胀的进一步下降形成了一定的阻碍。

由于通胀水平的持续下降，美联储对未来加息态度有所软化，多次暗示本轮加息周期接近尾声，但由于核心通胀居高不下，降息可能要等至明年。

在 3 月份，美国出现了一次银行业风波。由于出现巨额挤兑风波，数家银行都被监管当局关闭并被联邦存款保险公司接管。为了防范系统性风险，美财政部、美联储、美国联邦存款保险公司快速采取行动，对所有符合条件的存款机构提供额外资金保障，解除金融市场流动性危机。因此这次美国中小银行流动性问题没有引发美国金融行业系统性危机。

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

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 2.313 元；本报告期基金份额净值增长率为 9.70%，业绩比较基准收益率为 7.03%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从美国宏观经济来看，长期看来，美国非政府部门资产负债表依然相对较为健康，这是保持经济长期增长的保障；短期看来，当前美国通胀下降的势头已经明显确定，美联储加息进程已经进入尾声，同时美国多项宏观经济数据表现尚可，市场也开始预期美国能够实现经济软着陆而不陷入经济衰退。

今年美股虽然出现了显著上涨，但标普 500 指数估值水平仍位于历史平均水平区间。如果上述宏观经济预测能够实现，即通胀缓解、加息结束且经济软着陆，则美股长期前景可期；如果美国还是会陷入短期经济衰退，则美股具有一定的短期波动风险。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、固定收益总部、混合资产投资部、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八名投资组合经理。

股票投资部、固定收益总部、混合资产投资部、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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内大成标普 500 等权重指数证券投资基金已分配利润 11,827,059.15 元（每十份基金份额分红 0.7190 元），符合基金

合同规定的分红比例。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	27,533,551.76	32,041,386.10
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	370,317,251.42	327,379,544.73
其中：股票投资		370,317,251.42	327,379,544.73
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		2,748,416.34	-
应收股利		466,467.83	492,356.13
应收申购款		1,224,360.72	1,467,159.69
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	134,342.84	-
资产总计		402,424,390.91	361,380,446.65
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
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		-	4,586,987.52
应付赎回款		8,006,686.80	1,129,909.94
应付管理人报酬		316,034.44	298,097.94
应付托管费		79,008.59	74,524.52
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	112,271.38	187,269.60
负债合计		8,514,001.21	6,276,789.52
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	170,287,624.62	162,940,929.31
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	223,622,765.08	192,162,727.82
净资产合计		393,910,389.70	355,103,657.13
负债和净资产总计		402,424,390.91	361,380,446.65

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.313 元，基金份额总额 170,287,624.62

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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		37,555,418.21	-43,361,250.11
1. 利息收入		28,727.54	18,159.07
其中：存款利息收入	6.4.7.13	28,727.54	18,159.07
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）		7,338,281.63	13,428,635.62
其中：股票投资收益	6.4.7.14	4,181,854.61	10,626,563.14
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	3,156,427.02	2,802,072.48
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	29,638,360.93	-57,246,988.05
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		478,460.24	332,974.77
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	71,587.87	105,968.48
<b>减：二、营业总支出</b>		2,500,714.65	2,412,723.42
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,841,206.01	1,772,793.35
2. 托管费	6.4.10.2.2	460,301.49	443,198.36
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-

4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.24	199,207.15	196,731.71
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		35,054,703.56	-45,773,973.53
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		35,054,703.56	-45,773,973.53
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		35,054,703.56	-45,773,973.53

### 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	162,940,929.31	-	192,162,727.82	355,103,657.13
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）	162,940,929.31	-	192,162,727.82	355,103,657.13
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	7,346,695.31	-	31,460,037.26	38,806,732.57
（一）、综合收益总额	-	-	35,054,703.56	35,054,703.56
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	7,346,695.31	-	8,232,392.85	15,579,088.16
其中：1. 基金申	43,277,947.47	-	50,121,201.43	93,399,148.90

购款				
2. 基金赎回款	-35,931,252.16	-	-41,888,808.58	-77,820,060.74
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-11,827,059.15	-11,827,059.15
(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)	170,287,624.62	-	223,622,765.08	393,910,389.70
项目	上年度可比期间 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	-	-	-10,809,800.32	-10,809,800.32



值减少以“-”号填列)				
(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

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

谭晓冈

范瑛

孙蕊

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

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

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

根据《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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	27,533,551.76
等于：本金	27,532,827.87
加：应计利息	723.89

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	27,533,551.76

注：于本期末，活期存款中包括的外币余额为美元活期存款 2,867,298.56 元，折合人民币 20,718,525.94 元。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	306,877,579.19	-	370,317,251.42	63,439,672.23
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	306,877,579.19	-	370,317,251.42	63,439,672.23

#### 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 2023年6月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	134,342.84
合计	134,342.84

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	19,053.66
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	3,957.57
预提费用	89,260.15
合计	112,271.38

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	162,940,929.31	162,940,929.31
本期申购	43,277,947.47	43,277,947.47
本期赎回（以“-”号填列）	-35,931,252.16	-35,931,252.16
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	170,287,624.62	170,287,624.62

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
上年度末	117,034,390.82	75,128,337.00	192,162,727.82
本期利润	5,416,342.63	29,638,360.93	35,054,703.56
本期基金份额交易产生的变动数	4,804,285.04	3,428,107.81	8,232,392.85
其中：基金申购款	28,216,512.74	21,904,688.69	50,121,201.43
基金赎回款	-23,412,227.70	-18,476,580.88	-41,888,808.58
本期已分配利润	-11,827,059.15	-	-11,827,059.15
本期末	115,427,959.34	108,194,805.74	223,622,765.08

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	28,727.54
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	28,727.54

#### 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 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	4,181,854.61
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	4,181,854.61

##### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	46,100,454.45
减：卖出股票成本总额	41,887,654.72
减：交易费用	30,945.12
买卖股票差价收入	4,181,854.61

##### 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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,156,427.02
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	3,156,427.02

#### 6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	29,638,360.93
股票投资	29,638,360.93
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	29,638,360.93

#### 6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	71,587.87
合计	71,587.87

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	105,679.76
银行划款手续费	4,267.24
合计	199,207.15

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（“中银香港”）	境外资产托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 6.4.10.1.4 基金交易

无。

###### 6.4.10.1.5 权证交易

无。

**6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金**

无。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,841,206.01	1,772,793.35
其中：支付销售机构的客户维护费	681,627.14	579,404.59

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	460,301.49	443,198.36

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。

**6.4.10.3 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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	9,047,647.51	28,727.54	16,705,341.92	18,081.25
中国银行（香港）有限公司	18,485,904.25	-	7,120,615.87	-

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

## 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

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	2023年1月13日	-	2023年1月13日	0.719	6,849,710.71	4,977,348.44	11,827,059.15	-
合计	-	-	-	0.719	6,849,710.71	4,977,348.44	11,827,059.15	-

## 6.4.12 期末（2023年6月30日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

## 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

## 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

手完成证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本期末，本基金无债券投资(上年度末：同)。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动

而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 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	9,047,647.51	-	-	18,485,904.25	27,533,551.76
交易性金融资产	-	-	-	370,317,251.42	370,317,251.42
应收股利	-	-	-	466,467.83	466,467.83
应收申购款	1,758.87	-	-	1,222,601.85	1,224,360.72
应收清算款	-	-	-	2,748,416.34	2,748,416.34
其他资产	-	-	-	134,342.84	134,342.84
资产总计	9,049,406.38	-	-	393,374,984.53	402,424,390.91
负债					
应付赎回款	-	-	-	8,006,686.80	8,006,686.80
应付管理人报酬	-	-	-	316,034.44	316,034.44
应付托管费	-	-	-	79,008.59	79,008.59
其他负债	-	-	-	112,271.38	112,271.38
负债总计	-	-	-	8,514,001.21	8,514,001.21
利率敏感度缺口	9,049,406.38	-	-	-384,860,983.32	393,910,389.70
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	32,041,386.10	-	-	-	32,041,386.10
交易性金融资产	-	-	-	327,379,544.73	327,379,544.73
应收股利	-	-	-	492,356.13	492,356.13
应收申购款	-	-	-	1,467,159.69	1,467,159.69
资产总计	32,041,386.10	-	-	329,339,060.55	361,380,446.65
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,129,909.94	1,129,909.94
应付管理人报酬	-	-	-	298,097.94	298,097.94

应付托管费	-	-	-	74,524.52	74,524.52
应付清算款	-	-	-	4,586,987.52	4,586,987.52
其他负债	-	-	-	187,269.60	187,269.60
负债总计	-	-	-	6,276,789.52	6,276,789.52
利率敏感度缺口	32,041,386.10	-	-	-323,062,271.03	355,103,657.13

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

于本期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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 2023年6月30日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
银行存款	20,718,53 2.44	-	-	20,718,532.44
交易性金融资 产	370,317,2 51.42	-	-	370,317,251.42
应收股利	466,467.8 3	-	-	466,467.83
应收清算款	2,748,416 .34	-	-	2,748,416.34
资产合计	394,250,6 68.03	-	-	394,250,668.03
以外币计价的				



负债				
其他负债	3,957.57	-	-	3,957.57
负债合计	3,957.57	-	-	3,957.57
资产负债表外 外汇风险敞口净 额	394,246,7 10.46	-	-	394,246,710.46
项目	上年度末 2022 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	7,295,068 .25	-	-	7,295,068.25
交易性金融资 产	327,379,5 44.73	-	-	327,379,544.73
应收股利	492,356.1 3	-	-	492,356.13
资产合计	335,166,9 69.11	-	-	335,166,969.11
以外币计价的 负债				
应付清算款	4,586,987 .52	-	-	4,586,987.52
其他负债	3,814.51	-	-	3,814.51
负债合计	4,590,802 .03	-	-	4,590,802.03
资产负债表外 外汇风险敞口净 额	330,576,1 67.08	-	-	330,576,167.08

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除市场汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变 动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月

			31 日 )
	市场汇率相对人民币升值 5%	19,712,731.24	16,528,808.35
	市场汇率相对人民币贬值 5%	-19,712,731.31	-16,528,808.35

#### 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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	370,317,251.42	94.01	327,379,544.73	92.19
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	370,317,251.42	94.01	327,379,544.73	92.19

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	17,980,081.56	16,792,934.21
业绩比较基准下降5%	-17,980,081.56	-16,792,934.21	

#### 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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	370,317,251.42	327,379,544.73
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	370,317,251.42	327,379,544.73

#### 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。

#### 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	370,317,251.42	92.02
	其中：普通股	370,317,251.42	92.02
	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	27,533,551.76	6.84
8	其他各项资产	4,573,587.73	1.14
9	合计	402,424,390.91	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	370,317,251.42	94.01
合计	370,317,251.42	94.01

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

### 7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
通讯	16,057,359.74	4.08
非必需消费品	40,289,179.77	10.23
必需消费品	26,916,330.08	6.83
能源	18,708,514.90	4.75
金融	42,474,709.50	10.78
房地产	21,640,547.12	5.49
医疗保健	48,501,116.96	12.31
工业	52,920,179.55	13.43
材料	21,582,743.11	5.48
科技	59,832,271.17	15.19
公用事业	21,394,299.52	5.43
政府	-	-
合计	370,317,251.42	94.01

注：以上分类采用彭博行业分类标准。

### 7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

无。

## 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	CARNIVAL CORP	嘉年华公司	CCL US	美国纽约证券交易所	美国	7,636	1,038,968.01	0.26
2	NORWEGIAN CRUISE	挪威邮轮控股有限公司	NCLH US	美国纽约证券交易所	美国	5,821	915,676.28	0.23

	LINE HOLDIN							
3	GENERAC HOLDING S INC	Generac 控股公司	GNRC US	美国纽约 证券交易 所	美国	838	903,015.02	0.23
4	OLD DOMINION FREIGHT LINE	Old Dominion Freight Line	ODFL US	纳斯达克 证券交易 所	美国	326	870,987.09	0.22
5	DELTA AIR LINES INC	达美航空 有限公司	DAL US	美国纽约 证券交易 所	美国	2,493	856,381.73	0.22
6	SOUTHWEST AIRLINE S CO	西南航空	LUV US	美国纽约 证券交易 所	美国	3,264	854,013.26	0.22
7	PALO ALTO NETWORKS INC	Palo Alto Networks 股份有限 公司	PANW US	纳斯达克 证券交易 所	美国	454	838,203.93	0.21
8	UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	Universal 保健服 务股份有 限公司	UHS US	美国纽约 证券交易 所	美国	732	834,490.59	0.21
9	POOL CORP	Pool 公 司	POOL US	纳斯达克 证券交易 所	美国	306	828,364.56	0.21
10	AMERICAN AIRLINES GROUP INC	美国航空 集团公司	AAL US	纳斯达克 证券交易 所	美国	6,374	826,267.05	0.21
11	UNITED RENTALS INC	联合租赁 公司	URI US	美国纽约 证券交易 所	美国	256	823,847.56	0.21
12	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	皇家加勒 比国际游 轮	RCL US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,095	820,816.92	0.21
13	DOMINO'	达美乐披	DPZ US	美国纽约	美国	335	815,732.48	0.21

	S PIZZA INC	萨公司		证券交易 所				
14	NUCOR CORP	纽柯公司	NUE US	美国纽约 证券交易 所	美国	686	812,832.27	0.21
15	EDWARDS LIFESCI ENCES CORP	爱德华生 命科学公 司	EW US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,188	809,752.34	0.21
16	NXP SEMICON DUCTORS NV	恩智浦半 导体公司	NXPI US	纳斯达克 证券交易 所	美国	546	807,521.30	0.21
17	CATALEN T INC	康泰伦特 股份有限 公司	CTLT US	美国纽约 证券交易 所	美国	2,575	806,775.02	0.20
18	LINCOLN NATIONA L CORP	林肯国民 公司	LNC US	美国纽约 证券交易 所	美国	4,327	805,413.10	0.20
19	ALIGN TECHNOL OGY INC	Align 科 技股份有 限公司	ALGN US	纳斯达克 证券交易 所	美国	315	804,929.55	0.20
20	HCA HEALTHC ARE INC	HCA 医疗 保健有限 公司	HCA US	美国纽约 证券交易 所	美国	367	804,789.08	0.20
21	ESTEE LAUDER COMPANI ES-CL A	雅诗兰黛	EL US	美国纽约 证券交易 所	美国	566	803,155.47	0.20
22	STANLEY BLACK & DECKER INC	史丹利百 得公司	SWK US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,185	802,398.72	0.20
23	FORTINE T INC	Fortinet 股份有限 公司	FTNT US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,469	802,365.19	0.20
24	FORTIVE CORP	福迪威公 司	FTV US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,485	802,305.50	0.20
25	COSTAR GROUP INC	CoStar 集团股份 有限公司	CSGP US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,247	801,940.96	0.20
26	TRANSDI GM GROUP	TransDig m 集团公 司	TDG US	美国纽约 证券交易 所	美国	124	801,175.60	0.20

	INC	司		所				
27	DOLLAR GENERAL CORP	达乐公司	DG US	美国纽约 证券交易 所	美国	653	801,098.00	0.20
28	LABORAT ORY CRP OF AMER HLDGS	美国实验 控股公司	LH US	美国纽约 证券交易 所	美国	459	800,405.26	0.20
29	WABTEC CORP	西屋制 动公司	WAB US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,009	799,585.57	0.20
30	ULTA BEAUTY INC	Ulta 美 容产品公 司	ULTA US	纳斯达克 证券交易 所	美国	235	799,099.99	0.20
31	FEDEX CORP	联邦快 递	FDX US	美国纽约 证券交易 所	美国	446	798,909.02	0.20
32	ADVANCE AUTO PARTS INC	领先汽 车配件 股份有 限公司	AAP US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,572	798,534.72	0.20
33	SHERWIN -WILLIA MS CO/THE	宣伟公 司	SHW US	美国纽约 证券交易 所	美国	415	796,216.68	0.20
34	STRYKER CORP	史赛克	SYK US	美国纽约 证券交易 所	美国	361	795,831.48	0.20
35	FORD MOTOR CO	福特汽 车	F US	美国纽约 证券交易 所	美国	7,275	795,349.23	0.20
36	AON PLC-CLA SS A	怡安集 团	AON US	美国纽约 证券交易 所	美国	318	793,202.08	0.20
37	WEST PHARMAC EUTICAL SERVICE S	西氏医 药服务 公司	WST US	美国纽约 证券交易 所	美国	287	793,168.05	0.20
38	STEEL DYNAMIC S INC	Steel Dynamics 股份有 限公司	STLD US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,007	792,616.14	0.20
39	NRG	NRG 能 源	NRG US	美国纽约	美国	2,933	792,416.42	0.20



	ENERGY INC	股份有限 公司		证券交易 所				
40	LENNAR CORP-A	Lennar 公司	LEN US	美国纽约 证券交易 所	美国	875	792,281.87	0.20
41	TAKE-TW O INTERAC TIVE SOFTWARE	Take-Two 互动软件 股份有限 公司	TTWO US	纳斯达克 证券交易 所	美国	745	792,194.80	0.20
42	NETAPP INC	美国网域 存储技术 有限公司	NTAP US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,433	791,089.25	0.20
43	PENTAIR PLC	Pentair 公共有限 公司	PNR US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,689	788,402.70	0.20
44	INTUITI VE SURGICA L INC	直觉外科 手术公司	ISRG US	纳斯达克 证券交易 所	美国	319	788,182.03	0.20
45	IQVIA HOLDING S INC	艾昆纬	IQV US	美国纽约 证券交易 所	美国	485	787,709.39	0.20
46	CARDINA L HEALTH INC	嘉德诺健 康集团	CAH US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,152	787,212.18	0.20
47	VULCAN MATERIA LS CO	Vulcan 材料	VMC US	美国纽约 证券交易 所	美国	483	786,799.44	0.20
48	BEST BUY CO INC	百思买	BBY US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,328	786,380.92	0.20
49	WW GRAINGE R INC	固安捷股 份有限公 司	GWW US	美国纽约 证券交易 所	美国	138	786,350.72	0.20
50	DOLLAR TREE INC	美元树公 司	DLTR US	纳斯达克 证券交易 所	美国	758	785,971.94	0.20
51	NVIDIA CORP	英伟达	NVDA US	纳斯达克 证券交易 所	美国	257	785,561.08	0.20
52	IDEXX LABORAT	爱德士股 份有限公	IDXX US	纳斯达克 证券交易	美国	216	783,866.92	0.20

	ORIES INC	司		所				
53	AMPHENO L CORP-CL A	安费诺公 司	APH US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,277	783,863.09	0.20
54	BAXTER INTERNA TIONAL INC	百特	BAX US	美国纽约 证券交易 所	美国	2,381	783,842.93	0.20
55	GENUINE PARTS CO	原配部件	GPC US	美国纽约 证券交易 所	美国	641	783,828.99	0.20
56	TRANE TECHNOL OGIES PLC	特灵科技 公共有限 公司	TT US	美国纽约 证券交易 所	美国	567	783,597.69	0.20
57	STERIS PLC	思泰瑞医 疗公共有 限公司	STE US	美国纽约 证券交易 所	美国	482	783,568.35	0.20
58	EMERSON ELECTRI C CO	艾默生电 气	EMR US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,199	783,114.93	0.20
59	HENRY SCHEIN INC	亨利香恩 公司	HSIC US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,335	782,326.53	0.20
60	ORACLE CORP	甲骨文	ORCL US	美国纽约 证券交易 所	美国	909	782,213.15	0.20
61	MICROCH IP TECHNOL OGY INC	微芯科技 股份有限 公司	MCHP US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,208	782,010.18	0.20
62	META PLATFOR MS INC-CLA SS A	Meta 平 台股份有 限公司	META US	纳斯达克 证券交易 所	美国	377	781,769.85	0.20
63	MASTERC ARD INC - A	万事达股 份有限公 司	MA US	美国纽约 证券交易 所	美国	275	781,524.46	0.20
64	LIVE NATION ENTERTA	Live Nation 娱乐公司	LYV US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,187	781,452.71	0.20

	INMENT IN							
65	COOPER COS INC/THE	库柏股份 有限公司	COO US	美国纽约 证券交易 所	美国	282	781,305.96	0.20
66	CUMMINS INC	康明斯	CMI US	美国纽约 证券交易 所	美国	441	781,221.41	0.20
67	MCKESSO N CORP	McKesson 公司	MCK US	美国纽约 证券交易 所	美国	253	781,177.12	0.20
68	FISERV INC	Fiserv 公司	FI US	美国纽约 证券交易 所	美国	855	779,362.14	0.20
69	PULTEGR OUP INC	Pulte 集 团公司	PHM US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,388	779,084.60	0.20
70	RAYMOND JAMES FINANCI AL INC	Raymond James 金 融股份有 限公司	RJF US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,039	779,064.30	0.20
71	HOWMET AEROSPA CE INC	Howmet 航空航天 股份有限 公司	HWM US	美国纽约 证券交易 所	美国	2,175	778,890.66	0.20
72	AMERISO URCEBER GEN CORP	美源伯根	ABC US	美国纽约 证券交易 所	美国	560	778,657.99	0.20
73	DIGITAL REALTY TRUST INC	数字房地 产信托有 限公司	DLR US	美国纽约 证券交易 所	美国	946	778,370.55	0.20
74	AMETEK INC	阿美特克 股份有限 公司	AME US	美国纽约 证券交易 所	美国	665	777,858.82	0.20
75	TE CONNECT IVITY LTD	泰科电子 公司	TEL US	美国纽约 证券交易 所	美国	768	777,805.92	0.20
76	ADOBE INC	奥多比	ADBE US	纳斯达克 证券交易 所	美国	220	777,335.67	0.20
77	MARTIN MARIETT	Martin Marietta	MLM US	美国纽约 证券交易 所	美国	233	777,306.55	0.20

	A MATERIA LS	材料股份 有限公司		所				
78	BROADCO M INC	博通股份 有限公司	AVGO US	纳斯达克 证券交易 所	美国	124	777,216.59	0.20
79	CDW CORP/DE	特拉华 CDW 公司	CDW US	纳斯达克 证券交易 所	美国	586	776,997.50	0.20
80	SNAP-ON INC	实耐宝	SNA US	美国纽约 证券交易 所	美国	373	776,736.43	0.20
81	BROADRI DGE FINANCI AL SOLUTIO N	布罗德里 奇金融解 决公司	BR US	美国纽约 证券交易 所	美国	649	776,729.21	0.20
82	BROWN & BROWN INC	Brown & Brown 股 份有限公 司	BRO US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,561	776,478.98	0.20
83	WEYERHA EUSER CO	惠好	WY US	美国纽约 证券交易 所	美国	3,205	776,047.67	0.20
84	ZEBRA TECHNOL OGIES CORP-CL A	斑马技术 公司	ZBRA US	纳斯达克 证券交易 所	美国	363	775,951.85	0.20
85	TARGA RESOURC ES CORP	Targa 资 源公司	TRGP US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,411	775,885.45	0.20
86	CARRIER GLOBAL CORP	开利全球 公司	CARR US	美国纽约 证券交易 所	美国	2,159	775,500.96	0.20
87	HASBRO INC	孩之宝	HAS US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,657	775,500.96	0.20
88	QUANTA SERVICE S INC	Quanta 服务股份 有限公司	PWR US	美国纽约 证券交易 所	美国	546	775,051.59	0.20
89	EATON CORP PLC	伊顿	ETN US	美国纽约 证券交易 所	美国	533	774,506.77	0.20

				所				
90	APPLE INC	苹果公司	AAPL US	纳斯达克 证券交易 所	美国	552	773,676.81	0.20
91	TESLA INC	特斯拉公 司	TSLA US	纳斯达克 证券交易 所	美国	409	773,622.55	0.20
92	ALASKA AIR GROUP INC	阿拉斯加 航空集团	ALK US	美国纽约 证券交易 所	美国	2,013	773,531.57	0.20
93	TYLER TECHNOL OGIES INC	Tyler 科 技公司	TYL US	美国纽约 证券交易 所	美国	257	773,397.53	0.20
94	PARKER HANNIFI N CORP	派克汉尼 汾公司	PH US	美国纽约 证券交易 所	美国	274	772,228.18	0.20
95	ZIMMER BIOMET HOLDING S INC	捷迈邦美 控股股份 有限公司	ZBH US	美国纽约 证券交易 所	美国	734	772,224.14	0.20
96	CORNING INC	康宁公司	GLW US	美国纽约 证券交易 所	美国	3,049	771,982.51	0.20
97	ALLEGIO N PLC	安朗杰公 共有限公 司	ALLE US	美国纽约 证券交易 所	美国	890	771,844.06	0.20
98	REVVITY INC	Revvity 股份有限 公司	RVTY US	美国纽约 证券交易 所	美国	899	771,659.15	0.20
99	REPUBLI C SERVICE S INC	公共服务 公司	RSG US	美国纽约 证券交易 所	美国	697	771,422.72	0.20
100	GE HEALTHC ARE TECHNOL OGY	GE HealthCa re Technolo gy	GEHC US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,314	771,349.53	0.20
101	NORDSON CORP	诺信公司	NDSN US	纳斯达克 证券交易 所	美国	430	771,118.59	0.20
102	EQT CORP	EQT 公司	EQT US	美国纽约	美国	2,593	770,632.22	0.20

				证券交易 所				
103	INTEL CORP	英特尔	INTC US	纳斯达克 证券交易 所	美国	3,189	770,560.47	0.20
104	BORGWAR NER INC	博格华纳 股份有限 公司	BWA US	美国纽约 证券交易 所	美国	2,180	770,442.25	0.20
105	LEIDOS HOLDING S INC	Leidos 控股公司	LDOS US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,205	770,403.23	0.20
106	WATERS CORP	沃特世公 司	WAT US	美国纽约 证券交易 所	美国	400	770,385.89	0.20
107	DR HORTON INC	霍顿房屋 公司	DHI US	美国纽约 证券交易 所	美国	876	770,273.46	0.20
108	PACCAR INC	帕卡	PCAR US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,274	770,054.23	0.20
109	DEERE & CO	迪尔	DE US	美国纽约 证券交易 所	美国	263	770,017.16	0.20
110	CHARTER COMMUNI CATIONS INC-A	Charter 通信公司	CHTR US	纳斯达克 证券交易 所	美国	290	769,817.22	0.20
111	COGNIZA NT TECH SOLUTIO NS-A	高知特科 技公司	CTSH US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,632	769,814.77	0.20
112	WASTE MANAGEM ENT INC	废品管理	WM US	美国纽约 证券交易 所	美国	614	769,402.32	0.20
113	CHURCH & DWIGHT CO INC	切迟杜威 股份有限 公司	CHD US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,062	769,144.93	0.20
114	BOSTON PROPERTY S INC	波士顿地 产公司	BXP US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,847	768,599.17	0.20
115	VIATRIS INC	晖致	VTRS US	纳斯达克 证券交易 所	美国	10,656	768,441.29	0.20
116	HEWLETT	慧与	HPE US	美国纽约	美国	6,330	768,420.48	0.20

	PACKARD ENTERPR ISE			证券交易 所				
117	EPAM SYSTEMS INC	EPAM 系 统公司	EPAM US	美国纽约 证券交易 所	美国	473	768,151.31	0.20
118	COPART INC	Copart 股份有限 公司	CPRT US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,165	767,810.98	0.19
119	PRINCIP AL FINANCI AL GROUP	信安金融	PFG US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,400	767,206.54	0.19
120	CARMAX INC	CarMax 股份有限 公司	KMX US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,268	766,885.72	0.19
121	NORFOLK SOUTHER N CORP	诺福克南 方	NSC US	美国纽约 证券交易 所	美国	468	766,828.49	0.19
122	ON SEMICON DUCTOR	安森美半 导体公司	ON US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,122	766,792.94	0.19
123	JOHNSON CONTROL S INTERNA TION	江森自控 国际有限 公司	JCI US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,557	766,613.88	0.19
124	APPLIED MATERIA LS INC	应用材料	AMAT US	纳斯达克 证券交易 所	美国	734	766,602.17	0.19
125	ROSS STORES INC	罗斯百货 股份有限 公司	ROST US	纳斯达克 证券交易 所	美国	946	766,476.59	0.19
126	UNITED AIRLINE S HOLDING S INC	美国联合 航空控股 股份有限 公司	UAL US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,933	766,395.16	0.19
127	ARTHUR J GALLAGH ER & CO	亚瑟加拉 格尔有限 公司	AJG US	美国纽约 证券交易 所	美国	483	766,312.78	0.19
128	PPG INDUSTR IES INC	PPG 工业	PPG US	美国纽约 证券交易 所	美国	715	766,184.09	0.19

129	BALL CORP	波尔	BALL US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,821	765,937.76	0.19
130	INTUIT INC	Intuit 股份有限 公司	INTU US	纳斯达克 证券交易 所	美国	231	764,792.33	0.19
131	SKYWORKS SOLUTIONS INC	思佳讯解 决方案公 司	SWKS US	纳斯达克 证券交易 所	美国	956	764,631.55	0.19
132	MOLINA HEALTHCARE INC	Molina Healthca re 股份 有限公司	MOH US	美国纽约 证券交易 所	美国	351	764,021.70	0.19
133	AVERY DENNISON CORP	艾利丹尼 森	AVY US	美国纽约 证券交易 所	美国	615	763,456.35	0.19
134	LOWE'S COS INC	劳氏	LOW US	美国纽约 证券交易 所	美国	468	763,243.91	0.19
135	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	霍尼韦尔	HON US	纳斯达克 证券交易 所	美国	509	763,170.93	0.19
136	T-MOBILE US INC	T-Mobile US 股份 有限公司	TMUS US	纳斯达克 证券交易 所	美国	760	762,784.35	0.19
137	CERIDIAN HCM HOLDING INC	Ceridian 人力资本 管理	CDAY US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,575	762,161.13	0.19
138	FASTENAL CO	法思诺公 司	FAST US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,788	762,134.90	0.19
139	CSX CORP	CSX 公司	CSX US	纳斯达克 证券交易 所	美国	3,093	762,114.52	0.19
140	AMAZON.COM INC	亚马逊公 司	AMZN US	纳斯达克 证券交易 所	美国	809	762,041.83	0.19
141	LAM RESEARCH CORP	泛林集团	LRCX US	纳斯达克 证券交易 所	美国	164	761,809.16	0.19



142	ROCKWELL AUTOMATION INC	罗克韦尔 自动化	ROK US	美国纽约 证券交易所	美国	320	761,772.74	0.19
143	BOSTON SCIENTIFIC CORP	波士顿科 学	BSX US	美国纽约 证券交易所	美国	1,949	761,754.02	0.19
144	PAYCOM SOFTWARE INC	Paycom 软件股份 有限公司	PAYC US	美国纽约 证券交易所	美国	328	761,358.85	0.19
145	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	芯源系统 有限公司	MPWR US	纳斯达克 证券交易所	美国	195	761,200.82	0.19
146	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	菲利普莫 里斯国际	PM US	美国纽约 证券交易所	美国	1,079	761,107.82	0.19
147	MARSH & MCLENNAN COS	Marsh & McLennan 股份有限 公司	MMC US	美国纽约 证券交易所	美国	560	761,055.94	0.19
148	AMERIPRISE FINANCIAL INC	阿默普莱 斯金融公 司	AMP US	美国纽约 证券交易所	美国	317	760,838.59	0.19
149	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	福泰制药	VRTX US	纳斯达克 证券交易所	美国	299	760,306.55	0.19
150	WILLIAMS COS INC	威廉姆斯 公司	WMB US	美国纽约 证券交易所	美国	3,222	759,676.25	0.19
151	ECOLAB INC	艺康集团	ECL US	美国纽约 证券交易所	美国	563	759,478.33	0.19
152	C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	罗宾逊全 球物流有 限公司	CHRW US	纳斯达克 证券交易所	美国	1,114	759,474.21	0.19
153	MEDTRONIC PLC	美敦力	MDT US	美国纽约 证券交易所	美国	1,193	759,455.43	0.19

154	SERVICE NOW INC	ServiceNow 公司	NOW US	美国纽约 证券交易 所	美国	187	759,347.69	0.19
155	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	O'Reilly 汽车股份 有限公司	ORLY US	纳斯达克 证券交易 所	美国	110	759,308.74	0.19
156	ELI LILLY & CO	礼来	LLY US	美国纽约 证券交易 所	美国	224	759,081.27	0.19
157	EQUINIX INC	Equinix 有限公司	EQIX US	纳斯达克 证券交易 所	美国	134	759,055.55	0.19
158	UNITED PARCEL SERVICE -CL B	联合包裹 服务股份 有限公司	UPS US	美国纽约 证券交易 所	美国	586	759,001.64	0.19
159	PAYPAL HOLDING S INC	Paypal 控股股份 有限公司	PYPL US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,574	758,947.60	0.19
160	ABBOTT LABORATORIES	雅培制药	ABT US	美国纽约 证券交易 所	美国	963	758,609.72	0.19
161	VISA INC-CLASS A SHARES	维萨公司	V US	美国纽约 证券交易 所	美国	442	758,464.48	0.19
162	EQUIFAX INC	Equifax 股份有限 公司	EFX US	美国纽约 证券交易 所	美国	446	758,302.91	0.19
163	ROLLINS INC	Rollins 公司	ROL US	美国纽约 证券交易 所	美国	2,450	758,228.48	0.19
164	ORGANON & CO	Organon & Co	OGN US	美国纽约 证券交易 所	美国	5,040	757,859.25	0.19
165	METLIFE INC	大都会集 团	MET US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,855	757,720.15	0.19
166	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	空气产品 公司	APD US	美国纽约 证券交易 所	美国	350	757,520.36	0.19

167	TELEDYN E TECHNOLOGIES INC	Teledyne 科技股份 有限公司	TDY US	美国纽约 证券交易 所	美国	255	757,502.65	0.19
168	ARCH CAPITAL GROUP LTD	阿契资本 集团	ACGL US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,399	756,650.73	0.19
169	FLEETCO R TECHNOLOGIES INC	FleetCor 技术股份 有限公司	FLT US	美国纽约 证券交易 所	美国	417	756,543.86	0.19
170	BIO-RAD LABORATORIES-A	伯乐生命 医学产品 有限公司	BIO US	美国纽约 证券交易 所	美国	276	756,086.90	0.19
171	TJX COMPANIES INC	TJX 公司	TJX US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,234	756,041.67	0.19
172	WHIRLPOOL CORP	惠而浦	WHR US	美国纽约 证券交易 所	美国	703	755,814.13	0.19
173	INGERSOLL-RAND INC	英格索兰 股份有限 公司	IR US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,600	755,645.26	0.19
174	CAESARS ENTERTAINMENT INC	凯撒娱乐 集团	CZR US	纳斯达克 证券交易 所	美国	2,051	755,381.30	0.19
175	NETFLIX INC	奈飞公司	NFLX US	纳斯达克 证券交易 所	美国	237	754,345.56	0.19
176	FAIR ISAAC CORP	费埃哲公 司	FICO US	美国纽约 证券交易 所	美国	129	754,287.46	0.19
177	VENTAS INC	Ventas 公司	VTR US	美国纽约 证券交易 所	美国	2,207	753,830.79	0.19
178	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	保德信金 融集团	PRU US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,182	753,477.81	0.19
179	JACK	Jack	JKHY US	纳斯达克	美国	623	753,265.01	0.19

	HENRY & ASSOCIATES INC	Henry & Associates		证券交易所				
180	S&P GLOBAL INC	标普全球	SPGI US	美国纽约证券交易所	美国	260	753,155.25	0.19
181	NIKE INC -CL B	耐克公司	NKE US	美国纽约证券交易所	美国	944	752,850.90	0.19
182	JPMORGAN CHASE & CO	摩根大通	JPM US	美国纽约证券交易所	美国	716	752,458.97	0.19
183	APTIV PLC	Aptiv 公共有限公司	APTIV US	美国纽约证券交易所	美国	1,020	752,435.56	0.19
184	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	Archer-Daniels-Midland	ADM US	美国纽约证券交易所	美国	1,378	752,362.44	0.19
185	WILLIS TOWERS WATSON PLC	韦莱韬睿惠悦公共有限公司	WTW US	纳斯达克证券交易所	美国	442	752,140.75	0.19
186	MASCO CORP	马斯可	MAS US	美国纽约证券交易所	美国	1,814	752,114.16	0.19
187	WR BERKLEY CORP	WR Berkley 公司	WRB US	美国纽约证券交易所	美国	1,747	751,854.03	0.19
188	GEN DIGITAL INC	Gen Digital 股份有限公司	GEN US	纳斯达克证券交易所	美国	5,609	751,822.45	0.19
189	BIO-TECHNE CORP	Bio-techn 公司	TECH US	纳斯达克证券交易所	美国	1,274	751,458.78	0.19
190	MOHAWK INDUSTRIES INC	Mohawk 工业股份有限公司	MHK US	美国纽约证券交易所	美国	1,008	751,376.84	0.19
191	IDEX CORP	艺达思集团	IEX US	美国纽约证券交易所	美国	483	751,270.62	0.19
192	FREEMONT-MCMOR	自由港迈克墨伦股	FCX US	美国纽约证券交易所	美国	2,598	750,905.14	0.19

	AN INC	份有限公司		所				
193	COSTCO WHOLESA LE CORP	开市客	COST US	纳斯达克 证券交易 所	美国	193	750,813.66	0.19
194	MICROSO FT CORP	微软公司	MSFT US	纳斯达克 证券交易 所	美国	305	750,505.55	0.19
195	ROPER TECHNOL OGIES INC	儒博技术 公司	ROP US	纳斯达克 证券交易 所	美国	216	750,419.56	0.19
196	TARGET CORP	塔吉特公 司	TGT US	美国纽约 证券交易 所	美国	787	750,076.34	0.19
197	KLA CORP	KLA 公司	KLAC US	纳斯达克 证券交易 所	美国	214	749,996.71	0.19
198	AGILENT TECHNOL OGIES INC	安捷伦	A US	美国纽约 证券交易 所	美国	863	749,862.81	0.19
199	TERADYN E INC	泰瑞达	TER US	纳斯达克 证券交易 所	美国	932	749,745.83	0.19
200	L3HARRI S TECHNOL OGIES INC	L3Harris Technolo gies	LHX US	美国纽约 证券交易 所	美国	530	749,735.28	0.19
201	JUNIPER NETWORK S INC	瞻博网络 股份有限 公司	JNPR US	美国纽约 证券交易 所	美国	3,311	749,558.46	0.19
202	CATERPI LLAR INC	卡特彼勒	CAT US	美国纽约 证券交易 所	美国	421	748,499.31	0.19
203	SMITH (A. O.) CORP	AO 史密 斯公司	AOS US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,423	748,346.77	0.19
204	TEXTRON INC	德事隆	TXT US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,531	748,170.39	0.19
205	SEALED AIR CORP	希悦尔公 司	SEE US	美国纽约 证券交易 所	美国	2,588	748,014.82	0.19

				所				
206	PROCTER & GAMBLE CO/THE	宝洁	PG US	美国纽约 证券交易 所	美国	682	747,774.05	0.19
207	TRIMBLE INC	天宝股份 有限公司	TRMB US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,954	747,471.15	0.19
208	ACTIVISION BLIZZARD INC	动视暴雪 股份有限 公司	ATVI US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,227	747,408.57	0.19
209	CINTAS CORP	CINTAS 公司	CTAS US	纳斯达克 证券交易 所	美国	208	747,094.54	0.19
210	SBA COMMUNI CATIONS CORP	SBA 通信 公司	SBAC US	纳斯达克 证券交易 所	美国	446	746,894.53	0.19
211	ROBERT HALF INC	罗致恒富	RHI US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,374	746,802.90	0.19
212	VALERO ENERGY CORP	Valero 能源	VLO US	美国纽约 证券交易 所	美国	881	746,723.57	0.19
213	HUNTING TON INGALLS INDUSTRI ES	Huntingt on Ingalls 工业公司	HII US	美国纽约 证券交易 所	美国	454	746,644.80	0.19
214	SCHLUMBERGER LTD	斯伦贝谢 公众有限 公司	SLB US	美国纽约 证券交易 所	美国	2,103	746,420.52	0.19
215	MOODY'S CORP	穆迪	MCO US	美国纽约 证券交易 所	美国	297	746,228.89	0.19
216	LINDE PLC	Linde PLC	LIN US	美国纽约 证券交易 所	美国	271	746,227.73	0.19
217	GENERAL ELECTRIC CO	通用电气	GE US	美国纽约 证券交易 所	美国	940	746,128.88	0.19
218	MOTOROLA SOLUTIONS	摩托罗拉 解决方案 股份有限	MSI US	美国纽约 证券交易 所	美国	352	745,952.28	0.19

	NS INC	公司						
219	COMCAST CORP-CL ASS A	康卡斯特 公司	CMCSA US	纳斯达克 证券交易 所	美国	2,484	745,776.26	0.19
220	DEXCOM INC	Dexcom 股份有限 公司	DXCM US	纳斯达克 证券交易 所	美国	803	745,655.81	0.19
221	WYNN RESORTS LTD	永利渡假 村有限公 司	WYNN US	纳斯达克 证券交易 所	美国	977	745,565.05	0.19
222	BAKER HUGHES CO	贝克休斯 公司	BKR US	纳斯达克 证券交易 所	美国	3,263	745,293.80	0.19
223	AES CORP	爱伊斯公 司	AES US	美国纽约 证券交易 所	美国	4,975	745,209.40	0.19
224	DARDEN RESTAUR ANTS INC	达登餐饮 公司	DRI US	美国纽约 证券交易 所	美国	617	744,895.87	0.19
225	MARATHO N PETROLE UM CORP	马拉松石 油公司	MPC US	美国纽约 证券交易 所	美国	884	744,795.00	0.19
226	ONEOK INC	Oneok 股 份有限公 司	OKE US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,670	744,780.55	0.19
227	ILLINOI S TOOL WORKS	伊利诺伊 工具股份 有限公司	ITW US	美国纽约 证券交易 所	美国	412	744,733.72	0.19
228	QUEST DIAGNOS TICS INC	Quest Diagnostics 股份有 限公司	DGX US	美国纽约 证券交易 所	美国	733	744,477.64	0.19
229	SCHWAB (CHARLE S) CORP	嘉信理财	SCHW US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,817	744,167.51	0.19
230	DAVITA INC	DaVita 股份有限 公司	DVA US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,025	744,125.53	0.19
231	EXTRA SPACE STORAGE INC	Extra Space Storage 有限公司	EXR US	美国纽约 证券交易 所	美国	691	743,212.19	0.19
232	ELECTRO	电子艺界	EA US	纳斯达克	美国	793	743,188.70	0.19

	NIC ARTS INC			证券交易 所				
233	DOW INC	陶氏公司	DOW US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,931	743,137.83	0.19
234	VERISK ANALYTICALS INC	Verisk 分析公司	VRSK US	纳斯达克 证券交易 所	美国	455	743,127.65	0.19
235	EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	华盛顿康 捷国际物 流	EXPD US	纳斯达克 证券交易 所	美国	849	743,096.72	0.19
236	RALPH LAUREN CORP	拉夫劳伦	RL US	美国纽约 证券交易 所	美国	834	743,044.91	0.19
237	INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	洲际交易 所(ICE)	ICE US	美国纽约 证券交易 所	美国	909	742,737.96	0.19
238	BECTON DICKINSON AND CO	碧迪	BDX US	美国纽约 证券交易 所	美国	389	742,088.87	0.19
239	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	Chipotle Mexican Grill	CMG US	美国纽约 证券交易 所	美国	48	741,887.34	0.19
240	HOLOGIC INC	豪洛捷公 司	HOLX US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,268	741,872.60	0.19
241	PTC INC	PTC 公司	PTC US	纳斯达克 证券交易 所	美国	721	741,354.80	0.19
242	XYLEM INC	赛莱默公 司	XYL US	美国纽约 证券交易 所	美国	911	741,344.10	0.19
243	KIMBERLY- CLARK CORP	金佰利	KMB US	美国纽约 证券交易 所	美国	743	741,212.30	0.19
244	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	Pioneer 自然资源 公司	PXD US	美国纽约 证券交易 所	美国	495	741,035.42	0.19



245	NEWELL BRANDS INC	纽威尔品牌公司	NWL US	纳斯达克 证券交易 所	美国	11,787	740,983.39	0.19
246	WALMART INC	沃尔玛股份有限公司	WMT US	美国纽约 证券交易 所	美国	652	740,509.81	0.19
247	ANALOG DEVICES INC	亚德诺半 导体	ADI US	纳斯达克 证券交易 所	美国	526	740,428.16	0.19
248	MERCK & CO. INC.	默克	MRK US	美国纽约 证券交易 所	美国	888	740,401.14	0.19
249	DUPONT DE NEMOURS INC	杜邦公司	DD US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,434	740,246.79	0.19
250	QORVO INC	Qorvo 股 份有限公 司	QRVO US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,004	740,197.37	0.19
251	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	Discover 金融服务 公司	DFS US	美国纽约 证券交易 所	美国	875	738,792.89	0.19
252	APA CORP	APA	APA US	纳斯达克 证券交易 所	美国	2,991	738,494.61	0.19
253	HOME DEPOT INC	家得宝	HD US	美国纽约 证券交易 所	美国	329	738,480.81	0.19
254	LKQ CORP	LKQ 公司	LKQ US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,753	738,096.03	0.19
255	VERISIGN INC	威瑞信股 份有限公 司	VRSN US	纳斯达克 证券交易 所	美国	452	738,031.94	0.19
256	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	CF 工业 控股股份 有限公司	CF US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,470	737,374.10	0.19
257	CADENCE DESIGN	Cadence 设计系统	CDNS US	纳斯达克 证券交易 所	美国	435	737,148.66	0.19

	SYS INC	股份有限公司		所				
258	DENTSPLY SIRONA INC	登士柏西诺德公司	XRAY US	纳斯达克 证券交易 所	美国	2,549	737,110.94	0.19
259	CISCO SYSTEMS INC	思科系统 股份有限 公司	CSCO US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,971	736,883.76	0.19
260	GENERAL MOTORS CO	通用汽车 公司	GM US	美国纽约 证券交易 所	美国	2,644	736,689.39	0.19
261	ZOETIS INC	硕腾股份 有限公司	ZTS US	美国纽约 证券交易 所	美国	592	736,658.17	0.19
262	HALLIBURTON CO	哈利伯顿	HAL US	美国纽约 证券交易 所	美国	3,090	736,591.55	0.19
263	INCYTE CORP	因赛特公 司	INCY US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,637	736,332.50	0.19
264	MCDONALD'S CORP	麦当劳	MCD US	美国纽约 证券交易 所	美国	341	735,281.58	0.19
265	KROGER CO	克罗格公 司	KR US	美国纽约 证券交易 所	美国	2,165	735,261.28	0.19
266	LYONDELLBASELL INDUSTRIES	利安德巴 塞尔工业 公司	LYB US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,108	735,208.10	0.19
267	OTIS WORLDWIDE CORP	奥的斯电 梯公司	OTIS US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,143	735,141.55	0.19
268	TRACTOR SUPPLY COMPANY	拖拉机供 应公司	TSCO US	纳斯达克 证券交易 所	美国	460	734,907.21	0.19
269	CONSTELLATION BRANDS INC-A	星座品牌 股份有限 公司	STZ US	美国纽约 证券交易 所	美国	413	734,514.78	0.19
270	BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	百富门公 司	BF/B US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,522	734,424.24	0.19

271	INTL FLAVORS & FRAGRAN CES	国际香料	IFF US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,277	734,404.52	0.19
272	BERKSHI RE HATHAWA Y INC-CL B	伯克希尔 哈撒韦公 司	BRK/B US	美国纽约 证券交易 所	美国	298	734,271.34	0.19
273	NVR INC	NVR 股份 有限公司	NVR US	美国纽约 证券交易 所	美国	16	734,212.96	0.19
274	GARTNER INC	Gartner 公司	IT US	美国纽约 证券交易 所	美国	290	734,068.30	0.19
275	YUM! BRANDS INC	百胜餐饮 集团	YUM US	美国纽约 证券交易 所	美国	733	733,831.65	0.19
276	GLOBE LIFE INC	Globe Life 股 份有限公 司	GL US	美国纽约 证券交易 所	美国	926	733,477.37	0.19
277	CORTEVA INC	科迪华公 司	CTVA US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,771	733,261.90	0.19
278	KEYSIGH T TECHNOL OGIES IN	是德科技 公司	KEYS US	美国纽约 证券交易 所	美国	606	733,235.89	0.19
279	MGM RESORTS INTERNA TIONAL	美高梅国 际酒店集 团	MGM US	美国纽约 证券交易 所	美国	2,309	732,777.63	0.19
280	ANSYS INC	ANSYS 股 份有限公 司	ANSS US	纳斯达克 证券交易 所	美国	307	732,644.74	0.19
281	RESMED INC	瑞思迈股 份有限公 司	RMD US	美国纽约 证券交易 所	美国	464	732,580.51	0.19
282	CME GROUP INC	芝加哥商 业交易所	CME US	纳斯达克 证券交易 所	美国	547	732,361.06	0.19
283	AUTOMAT	ADP 公司	ADP US	纳斯达克	美国	461	732,141.11	0.19

	IC DATA PROCESSING			证券交易所				
284	CLOROX COMPANY	高乐氏公司	CLX US	美国纽约证券交易所	美国	637	732,034.81	0.19
285	JOHNSON & JOHNSON	强生	JNJ US	美国纽约证券交易所	美国	612	731,960.82	0.19
286	TYSON FOODS INC-CL A	泰森食品公司	TSN US	美国纽约证券交易所	美国	1,984	731,708.79	0.19
287	IRON MOUNTAIN INC	美国铁山公司	IRM US	美国纽约证券交易所	美国	1,782	731,635.66	0.19
288	AMGEN INC	安进公司	AMGN US	纳斯达克证券交易所	美国	456	731,548.08	0.19
289	FRANKLIN RESOURCES INC	富兰克林资源	BEN US	美国纽约证券交易所	美国	3,790	731,474.24	0.19
290	INSULET CORP	Insulet 股份有限公司	PODD US	纳斯达克证券交易所	美国	351	731,304.00	0.19
291	HUNT (JB) TRANSPORT SVCS INC	JB Hunt 运输服务股份有限公司	JBHT US	纳斯达克证券交易所	美国	559	731,220.39	0.19
292	AFLAC INC	家庭人寿保险	AFL US	美国纽约证券交易所	美国	1,449	730,818.86	0.19
293	CHARLES RIVER LABORATORIES	查尔斯河实验室国际	CRL US	美国纽约证券交易所	美国	481	730,746.96	0.19
294	GENERAL DYNAMICS CORP	通用动力	GD US	美国纽约证券交易所	美国	470	730,676.51	0.19
295	AMERICAN INTERNATIONAL	美国国际集团	AIG US	美国纽约证券交易所	美国	1,757	730,512.34	0.19

	GROUP							
296	LAMB WESTON HOLDING S INC	蓝威斯顿 控股股份 有限公司	LW US	美国纽约 证券交易 所	美国	879	730,102.42	0.19
297	PROGRES SIVE CORP	前进保险 公司	PGR US	美国纽约 证券交易 所	美国	763	729,793.59	0.19
298	METTLER -TOLEDO INTERNA TIONAL	梅特勒- 托利多国 际股份有 限公司	MTD US	美国纽约 证券交易 所	美国	77	729,778.92	0.19
299	INVESCO LTD	景顺有限 公司	IVZ US	美国纽约 证券交易 所	美国	6,005	729,401.52	0.19
300	HP INC	惠普	HPQ US	美国纽约 证券交易 所	美国	3,286	729,177.59	0.19
301	AUTODES K INC	欧特克	ADSK US	纳斯达克 证券交易 所	美国	493	728,886.17	0.19
302	PUBLIC SERVICE ENTERPR ISE GP	公共服务 企业集团	PEG US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,610	728,375.81	0.18
303	COMERIC A INC	Comerica 公司	CMA US	美国纽约 证券交易 所	美国	2,375	726,951.61	0.18
304	FIRSTEN ERGY CORP	第一能源	FE US	美国纽约 证券交易 所	美国	2,587	726,789.46	0.18
305	OMNICOM GROUP	Omnicom 集团	OMC US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,057	726,724.36	0.18
306	MATCH GROUP INC	Match 集 团股份有 限公司	MTCH US	纳斯达克 证券交易 所	美国	2,403	726,666.55	0.18
307	AMERICA N ELECTRI C POWER	美国电力	AEP US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,194	726,444.36	0.18
308	US BANCORP	美国合众 银行	USB US	美国纽约 证券交易 所	美国	3,042	726,248.39	0.18

309	MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	万豪国际	MAR US	纳斯达克 证券交易 所	美国	547	726,037.04	0.18
310	BUNGE LTD	邦吉有限 公司	BG US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,064	725,386.50	0.18
311	INTERNATIONAL PAPER CO	国际纸业	IP US	美国纽约 证券交易 所	美国	3,155	725,185.26	0.18
312	EDISON INTERNATIONAL	爱迪生国 际	EIX US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,445	725,146.97	0.18
313	HESS CORP	赫斯公司	HES US	美国纽约 证券交易 所	美国	738	724,972.46	0.18
314	AVALONBAY COMMUNITIES INC	AvalonBay 社区股 份有限公司	AVB US	美国纽约 证券交易 所	美国	530	724,842.40	0.18
315	PROLOGIS INC	安博	PLD US	美国纽约 证券交易 所	美国	818	724,829.68	0.18
316	MONSTER BEVERAGE CORP	怪兽饮料 公司	MNST US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,746	724,677.22	0.18
317	INVITATION HOMES INC	邀请家园 公司	INVH US	美国纽约 证券交易 所	美国	2,915	724,574.32	0.18
318	TEXAS INSTRUMENTS INC	德州仪器	TXN US	纳斯达克 证券交易 所	美国	557	724,539.20	0.18
319	DXC TECHNOLOGY CO	DXC 技术 公司	DXC US	美国纽约 证券交易 所	美国	3,752	724,411.31	0.18
320	P G & E CORP	太平洋煤 气电力	PCG US	美国纽约 证券交易 所	美国	5,801	724,323.44	0.18
321	COCA-COLA CO/THE	可口可乐	KO US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,664	724,069.09	0.18
322	THERMO	Thermo	TMO US	美国纽约	美国	192	723,851.74	0.18

	FISHER SCIENTI FIC INC	Fisher Scientif ic 公司		证券交易 所				
323	THE CIGNA GROUP	信诺集团	CI US	美国纽约 证券交易 所	美国	357	723,838.73	0.18
324	NISOURC E INC	NiSource 公司	NI US	美国纽约 证券交易 所	美国	3,661	723,507.43	0.18
325	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	纽约梅隆 银行股份 有限公司	BK US	美国纽约 证券交易 所	美国	2,249	723,486.69	0.18
326	ALTRIA GROUP INC	高特利	MO US	美国纽约 证券交易 所	美国	2,210	723,396.52	0.18
327	AXON ENTERPR ISE INC	Axon Enterpri se 股份 有限公司	AXON US	纳斯达克 证券交易 所	美国	513	723,277.72	0.18
328	NEXTERA ENERGY INC	新纪元能 源公司	NEE US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,349	723,272.23	0.18
329	3M CO	3M 公司	MMM US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,000	723,230.32	0.18
330	SIMON PROPERTY GROUP INC	西蒙房地 产集团公 司	SPG US	美国纽约 证券交易 所	美国	866	722,621.04	0.18
331	FIDELIT Y NATIONA L INFO SERVICE	繁德信息 技术有限 公司	FIS US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,828	722,519.30	0.18
332	AT&T INC	美国电话 电报公司	T US	美国纽约 证券交易 所	美国	6,267	722,281.21	0.18
333	TELEFLE X INC	泰利福公 司	TFX US	美国纽约 证券交易 所	美国	413	722,279.33	0.18
334	SYSCO CORP	Sysco 公 司	SYU US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,347	722,199.92	0.18

335	CROWN CASTLE INC	冠城股份 有限公司	CCI US	美国纽约 证券交易 所	美国	877	722,040.81	0.18
336	RTX CORP	RTX 公司	RTX US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,020	721,996.16	0.18
337	BOOKING HOLDING S INC	Booking 控股股份 有限公司	BKNG US	纳斯达克 证券交易 所	美国	37	721,945.65	0.18
338	AMERICA N TOWER CORP	美国发射 塔公司	AMT US	美国纽约 证券交易 所	美国	515	721,706.40	0.18
339	MONDELE Z INTERNA TIONAL INC-A	亿滋国际	MDLZ US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,369	721,531.25	0.18
340	UNION PACIFIC CORP	联合太平 洋	UNP US	美国纽约 证券交易 所	美国	488	721,529.08	0.18
341	VF CORP	VF 公司	VFC US	美国纽约 证券交易 所	美国	5,230	721,428.93	0.18
342	KEURIG DR PEPPER INC	Keurig Dr Pepper 有限公司	KDP US	纳斯达克 证券交易 所	美国	3,192	721,234.85	0.18
343	ESSEX PROPERTY TRUST INC	埃塞克斯 房地产信 托	ESS US	美国纽约 证券交易 所	美国	426	721,220.10	0.18
344	REGENCY CENTERS CORP	Regency Centers 公司	REG US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,615	720,835.33	0.18
345	AUTOZON E INC	AutoZone 股份有限 公司	AZO US	美国纽约 证券交易 所	美国	40	720,660.83	0.18
346	MOSAIC CO/THE	Mosaic 公司	MOS US	美国纽约 证券交易 所	美国	2,849	720,520.65	0.18
347	VERIZON COMMUNI CATIONS INC	Verizon 通信股份 有限公司	VZ US	美国纽约 证券交易 所	美国	2,681	720,458.43	0.18



348	CELANES E CORP	塞拉尼斯 公司	CE US	美国纽约 证券交易 所	美国	861	720,439.72	0.18
349	NEWMONT CORP	纽蒙黄金 公司	NEM US	美国纽约 证券交易 所	美国	2,337	720,386.39	0.18
350	ACCENTU RE PLC-CL A	埃森哲公 司	ACN US	美国纽约 证券交易 所	美国	323	720,205.17	0.18
351	ARISTA NETWORK S INC	Arista 网络股份 有限公司	ANET US	美国纽约 证券交易 所	美国	615	720,173.09	0.18
352	DOVER CORP	都福	DOV US	美国纽约 证券交易 所	美国	675	720,150.32	0.18
353	AMCOR PLC	安姆科公 司	AMCR US	美国纽约 证券交易 所	美国	9,986	720,125.25	0.18
354	WELLTOW ER INC	Welltowe r Inc	WELL US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,232	720,097.79	0.18
355	CBOE GLOBAL MARKETS INC	Cboe 环 球市场公 司	CBOE US	巴兹全球 市场	美国	722	720,001.98	0.18
356	EQUITY RESIDEN TIAL	公寓物业 权益信托	EQR US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,510	719,795.90	0.18
357	WELLS FARGO & CO	富国银行	WFC US	美国纽约 证券交易 所	美国	2,333	719,490.54	0.18
358	KIMCO REALTY CORP	Kimco Realty Corp	KIM US	美国纽约 证券交易 所	美国	5,048	719,303.53	0.18
359	PEPSICO INC	百事可乐	PEP US	纳斯达克 证券交易 所	美国	537	718,700.76	0.18
360	COLGATE -PALMOL IVE CO	高露洁棕 榄	CL US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,291	718,668.24	0.18
361	LOCKHEE D MARTIN CORP	洛克希德 马丁	LMT US	美国纽约 证券交易 所	美国	216	718,548.58	0.18
362	SEMPRA	Sempra	SRE US	美国纽约	美国	683	718,518.88	0.18

				证券交易 所				
363	PPL CORP	PPL 公司	PPL US	美国纽约 证券交易 所	美国	3,754	717,744.78	0.18
364	AMERICAN EXPRESS CO	美国运通	AXP US	美国纽约 证券交易 所	美国	570	717,478.59	0.18
365	WEC ENERGY GROUP INC	WEC 能源 集团股份 有限公司	WEC US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,125	717,305.17	0.18
366	PUBLIC STORAGE	公共存储 公司	PSA US	美国纽约 证券交易 所	美国	340	717,082.61	0.18
367	AMEREN CORPORATION	Ameren 公司	AEE US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,215	717,009.27	0.18
368	EASTMAN CHEMICAL CO	伊士曼化 工	EMN US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,185	716,858.61	0.18
369	CAMPBELL SOUP CO	金宝汤	CPB US	美国纽约 证券交易 所	美国	2,170	716,732.16	0.18
370	FIFTH THIRD BANCORP	五三银行	FITB US	纳斯达克 证券交易 所	美国	3,784	716,645.02	0.18
371	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	希尔顿全 球控股股 份有限公司	HLT US	美国纽约 证券交易 所	美国	681	716,218.04	0.18
372	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	西方石油	OXY US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,685	715,917.81	0.18
373	LOEWS CORP	罗斯公司	L US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,668	715,685.43	0.18
374	MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	莫尔森库 尔斯饮料 公司	TAP US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,504	715,522.99	0.18

375	ATMOS ENERGY CORP	Atmos 能源公司	ATO US	美国纽约证券交易所	美国	851	715,392.79	0.18
376	MORGAN STANLEY	摩根士丹利	MS US	美国纽约证券交易所	美国	1,159	715,199.57	0.18
377	NORTHERN TRUST CORP	北美信托	NTRS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,335	715,187.28	0.18
378	STATE STREET CORP	道富集团	STT US	美国纽约证券交易所	美国	1,352	714,916.03	0.18
379	EXPEDIA GROUP INC	亿客行集团股份有限公司	EXPE US	纳斯达克证券交易所	美国	904	714,548.96	0.18
380	GARMIN LTD	佳明有限公司	GRMN US	美国纽约证券交易所	美国	948	714,392.59	0.18
381	UDR INC	UDR 公司	UDR US	美国纽约证券交易所	美国	2,301	714,277.27	0.18
382	FIRST SOLAR INC	福思第一太阳能公司	FSLR US	纳斯达克证券交易所	美国	520	714,247.21	0.18
383	SYNOPSIS INC	新思科技公司	SNPS US	纳斯达克证券交易所	美国	227	714,184.13	0.18
384	BLACKROCK INC	贝莱德有限公司	BLK US	美国纽约证券交易所	美国	143	714,147.64	0.18
385	QUALCOMM INC	高通公司	QCOM US	纳斯达克证券交易所	美国	830	713,932.16	0.18
386	FEDERAL REALTY INVS TRUST	联邦房地产投资信托	FRT US	美国纽约证券交易所	美国	1,021	713,924.72	0.18
387	JACOBS SOLUTIONS INC	Jacobs Solutions Inc	J US	美国纽约证券交易所	美国	831	713,891.63	0.18
388	PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	派拉蒙全球	PARA US	纳斯达克证券交易所	美国	6,208	713,687.06	0.18

389	INTL BUSINES S MACHINE S CORP	国际商业 机器	IBM US	美国纽约 证券交易 所	美国	738	713,560.61	0.18
390	SEAGATE TECHNOL OGY HOLDING S	Seagate Technolo gy 控股 公司	STX US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,596	713,508.15	0.18
391	PINNACL E WEST CAPITAL	Pinnacle 西部资本	PNW US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,212	713,399.77	0.18
392	FMC CORP	FMC 公司	FMC US	美国纽约 证券交易 所	美国	946	713,227.21	0.18
393	DTE ENERGY COMPANY	DTE 能源	DTE US	美国纽约 证券交易 所	美国	897	713,099.32	0.18
394	DANAHER CORP	丹纳赫	DHR US	美国纽约 证券交易 所	美国	411	712,752.91	0.18
395	CENTERP OINT ENERGY INC	中点能源	CNP US	美国纽约 证券交易 所	美国	3,382	712,357.66	0.18
396	SYNCHRO NY FINANCI AL	同步金融 公司	SYF US	美国纽约 证券交易 所	美国	2,906	712,258.09	0.18
397	MSCI INC	MSCI 明 晟	MSCI US	美国纽约 证券交易 所	美国	210	712,109.09	0.18
398	CBRE GROUP INC - A	世邦魏理 仕	CBRE US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,221	712,080.26	0.18
399	SOUTHER N CO/THE	南方公司	SO US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,402	711,672.65	0.18
400	COTERRA ENERGY INC	Coterra 能源股份 有限公司	CTRA US	美国纽约 证券交易 所	美国	3,892	711,507.18	0.18
401	MODERNA INC	莫德纳公 司	MRNA US	纳斯达克 证券交易 所	美国	810	711,127.11	0.18

				所				
402	HUNTING TON BANCSHA RES INC	俄亥俄州 亨廷顿银 行	HBAN US	纳斯达克 证券交易 所	美国	9,128	711,017.56	0.18
403	KINDER MORGAN INC	特拉华州 金德摩根 公司	KMI US	美国纽约 证券交易 所	美国	5,707	710,112.17	0.18
404	KELLOGG CO	家乐氏	K US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,458	710,073.59	0.18
405	TAPESTR Y INC	TAPESTRY INC	TPR US	美国纽约 证券交易 所	美国	2,294	709,452.17	0.18
406	HARTFOR D FINANCI AL SVCS GRP	哈特福德 金融服务	HIG US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,363	709,308.08	0.18
407	ASSURAN T INC	安信龙集 团	AIZ US	美国纽约 证券交易 所	美国	780	708,573.51	0.18
408	CONSTEL LATION ENERGY	美国联合 能源公司	CEG US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,071	708,490.05	0.18
409	EXXON MOBIL CORP	埃克森美 孚石油公 司	XOM US	美国纽约 证券交易 所	美国	914	708,319.88	0.18
410	SALESFO RCE INC	Salesfor ce 股份 有限公司	CRM US	美国纽约 证券交易 所	美国	464	708,306.44	0.18
411	PAYCHEX INC	Paychex 公司	PAYX US	纳斯达克 证券交易 所	美国	876	708,114.82	0.18
412	CAPITAL ONE FINANCI AL CORP	第一资本 金融	COF US	美国纽约 证券交易 所	美国	896	708,096.03	0.18
413	T ROWE PRICE GROUP INC	普徕仕	TROW US	纳斯达克 证券交易 所	美国	873	706,635.98	0.18
414	PNC FINANCI	PNC 财务 服务	PNC US	美国纽约 证券交易	美国	775	705,319.37	0.18

	AL SERVICE GROUP			所				
415	STARBUCKS CORP	星巴克公司	SBUX US	纳斯达克 证券交易 所	美国	985	705,050.93	0.18
416	F5 INC	F5 股份有限公司	FFIV US	纳斯达克 证券交易 所	美国	667	704,915.95	0.18
417	NORTHROP GRUMMAN CORP	诺斯洛普格鲁门公司	NOC US	美国纽约 证券交易 所	美国	214	704,813.20	0.18
418	ALBEMARLE CORP	雅保公司	ALB US	美国纽约 证券交易 所	美国	437	704,445.63	0.18
419	ABBVIE INC	艾伯维公司	ABBV US	美国纽约 证券交易 所	美国	723	703,863.66	0.18
420	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	Interpublic 集团	IPG US	美国纽约 证券交易 所	美国	2,522	703,061.38	0.18
421	ALLSTATE CORP	好事达保险公司	ALL US	美国纽约 证券交易 所	美国	892	702,807.90	0.18
422	AMERICAN WATERWORKS CO INC	美国自来水股份有限公司	AWK US	美国纽约 证券交易 所	美国	681	702,439.89	0.18
423	VICI PROPERTIES INC	VICI Properties 股份有限公司	VICI US	美国纽约 证券交易 所	美国	3,091	701,987.41	0.18
424	LAS VEGAS SANDS CORP	拉斯维加斯金沙集团	LVS US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,674	701,567.37	0.18
425	CHEVRON CORP	雪佛龙	CVX US	美国纽约 证券交易 所	美国	617	701,516.43	0.18
426	AKAMAI TECHNOLOGIES	阿卡迈技术公司	AKAM US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,080	701,333.26	0.18

	INC							
427	WALT DISNEY CO/THE	华特迪士 尼公司	DIS US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,087	701,244.81	0.18
428	EXELON CORP	Exelon 公司	EXC US	纳斯达克 证券交易 所	美国	2,382	701,211.00	0.18
429	BOEING CO/THE	波音	BA US	美国纽约 证券交易 所	美国	459	700,342.17	0.18
430	PACKAGI NG CORP OF AMERICA	美国包装 公司	PKG US	美国纽约 证券交易 所	美国	733	699,986.95	0.18
431	XCEL ENERGY INC	Xcel 能 源	XEL US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,558	699,897.20	0.18
432	GOLDMAN SACHS GROUP INC	高盛	GS US	美国纽约 证券交易 所	美国	300	699,182.86	0.18
433	JM SMUCKER CO/THE	JM 斯马 克公司	SJM US	美国纽约 证券交易 所	美国	654	697,840.16	0.18
434	FACTSET RESEARC H SYSTEMS INC	FactSet 研究系统 股份有限 公司	FDS US	美国纽约 证券交易 所	美国	241	697,699.04	0.18
435	ALLIANT ENERGY CORP	Alliant 能源公司	LNT US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,839	697,367.16	0.18
436	REGIONS FINANCI AL CORP	地区金融 公司	RF US	美国纽约 证券交易 所	美国	5,412	696,869.45	0.18
437	MICRON TECHNOL OGY INC	美光科技 股份有限 公司	MU US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,527	696,342.90	0.18
438	HORMEL FOODS CORP	荷美尔食 品有限公 司	HRL US	美国纽约 证券交易 所	美国	2,396	696,329.54	0.18
439	EOG RESOURC ES INC	EOG 资源	EOG US	美国纽约 证券交易 所	美国	842	696,267.10	0.18

440	MID-AMERICA APARTMENT COMM	Mid-America Apartment	MAA US	美国纽约证券交易所	美国	634	695,694.53	0.18
441	EVERGY INC	Evergy 股份有限公司	EVRG US	纳斯达克证券交易所	美国	1,648	695,672.28	0.18
442	CVS HEALTH CORP	CVS 健康公司	CVS US	美国纽约证券交易所	美国	1,392	695,331.22	0.18
443	KRAFT HEINZ CO/THE	卡夫亨氏公司	KHC US	纳斯达克证券交易所	美国	2,710	695,158.09	0.18
444	MCCORMICK & CO-NONVTG SHRS	味好美股份有限公司	MKC US	美国纽约证券交易所	美国	1,102	694,597.80	0.18
445	WESTROCK CO	WestRock 公司	WRK US	美国纽约证券交易所	美国	3,306	694,438.54	0.18
446	DOMINION ENERGY INC	Dominion 能源股份有限公司	D US	美国纽约证券交易所	美国	1,852	693,063.19	0.18
447	EVERSOURCE ENERGY	Eversource 能源公司	ES US	美国纽约证券交易所	美国	1,352	692,837.45	0.18
448	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	百时美施贵宝公司	BMY US	美国纽约证券交易所	美国	1,499	692,672.78	0.18
449	ENPHASE ENERGY INC	Enphase 能源股份有限公司	ENPH US	纳斯达克证券交易所	美国	572	692,221.23	0.18
450	CENTENE CORP	Centene 公司	CNC US	美国纽约证券交易所	美国	1,419	691,592.52	0.18
451	CHUBB LTD	邱博保险集团	CB US	美国纽约证券交易所	美国	496	690,134.42	0.18
452	EBAY INC	eBay 公司	EBAY US	纳斯达克证券交易所	美国	2,137	690,082.18	0.18
453	GILEAD SCIENCE	吉利德科学	GILD US	纳斯达克证券交易所	美国	1,239	689,989.69	0.18



	S INC			所				
454	CONSOLIDATED EDISON INC	联合爱迪生	ED US	美国纽约证券交易所	美国	1,056	689,792.21	0.18
455	HERSHEY CO/THE	好时公司	HSY US	美国纽约证券交易所	美国	382	689,235.82	0.17
456	CINCINNATI FINANCIAL CORP	辛辛那提金融	CINF US	纳斯达克证券交易所	美国	980	689,150.56	0.17
457	ENTERGY CORP	Entergy 公司	ETR US	美国纽约证券交易所	美国	979	688,801.05	0.17
458	WESTERN DIGITAL CORP	西部数据公司	WDC US	纳斯达克证券交易所	美国	2,512	688,475.38	0.17
459	SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	SolarEdge 科技股份有限公司	SEDG US	纳斯达克证券交易所	美国	354	688,211.93	0.17
460	DIAMOND BACK ENERGY INC	Diamondback 能源股份有限公司	FANG US	纳斯达克证券交易所	美国	725	688,156.29	0.17
461	DUKE ENERGY CORP	杜克能源	DUK US	美国纽约证券交易所	美国	1,061	687,998.33	0.17
462	UNITEDHEALTH GROUP INC	联合健康集团	UNH US	美国纽约证券交易所	美国	198	687,655.69	0.17
463	CONOCOPHILLIPS	康菲石油	COP US	美国纽约证券交易所	美国	918	687,274.60	0.17
464	CONAGRA BRANDS INC	康尼格拉品牌股份有限公司	CAG US	美国纽约证券交易所	美国	2,815	685,885.94	0.17
465	HOST HOTELS & RESORTS INC	Host 酒店及度假股份有限公司	HST US	纳斯达克证券交易所	美国	5,637	685,516.78	0.17

466	REGENERON PHARMACEUTICALS	再生元制药股份有限公司	REGN US	纳斯达克 证券交易 所	美国	132	685,347.48	0.17
467	CMS ENERGY CORP	CMS 能源	CMS US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,613	684,743.90	0.17
468	MARATHON OIL CORP	Marathon 石油公司	MRO US	美国纽约 证券交易 所	美国	4,111	683,815.17	0.17
469	TRAVELERS COS INC/THE	旅行家集团	TRV US	美国纽约 证券交易 所	美国	544	682,628.84	0.17
470	MARKETAXESS HOLDINGS INC	MarketAxess 控股公司	MKTX US	纳斯达克 证券交易 所	美国	361	681,917.68	0.17
471	EVEREST RE GROUP LTD	安富来集团有限公司	RE US	美国纽约 证券交易 所	美国	276	681,778.51	0.17
472	GLOBAL PAYMENTS INC	环汇有限公司	GPN US	美国纽约 证券交易 所	美国	957	681,274.73	0.17
473	CAMDEN PROPERTY TRUST	Camden 房地产信托公司	CPT US	美国纽约 证券交易 所	美国	864	679,685.34	0.17
474	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITY	亚历山大房地产股份有限公司	ARE US	美国纽约 证券交易 所	美国	828	679,006.40	0.17
475	CITIGROUP INC	花旗集团	C US	美国纽约 证券交易 所	美国	2,038	677,993.35	0.17
476	BANK OF AMERICA CORP	美国银行公司	BAC US	美国纽约 证券交易 所	美国	3,255	674,788.20	0.17
477	REALTY INCOME CORP	Realty Income 公司	O US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,559	673,535.68	0.17
478	TRUIST FINANCIAL CORP	Truist 金融公司	TFC US	美国纽约 证券交易 所	美国	3,063	671,725.18	0.17
479	PHILLIPS	Phillips	PSX US	美国纽约	美国	973	670,588.49	0.17

	S 66	66		证券交易 所				
480	ETSY INC	Etsy 股 份有限公 司	ETSY US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,095	669,455.56	0.17
481	M & T BANK CORP	M&T 银行	MTB US	美国纽约 证券交易 所	美国	748	668,910.23	0.17
482	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	Healthpeak Properties	PEAK US	美国纽约 证券交易 所	美国	4,601	668,242.71	0.17
483	ELEVANCE HEALTH INC	Elevance 健康股份 有限公司	ELV US	美国纽约 证券交易 所	美国	208	667,752.94	0.17
484	DEVON ENERGY CORP	戴文能源	DVN US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,904	665,058.01	0.17
485	BIOGEN INC	渤健公司	BIIB US	纳斯达克 证券交易 所	美国	323	664,820.93	0.17
486	CITIZENS FINANCIAL GROUP	公民金融 集团股份 有限公司	CFG US	美国纽约 证券交易 所	美国	3,527	664,659.14	0.17
487	PFIZER INC	辉瑞制药	PFE US	美国纽约 证券交易 所	美国	2,502	663,135.94	0.17
488	ILLUMINA INC	Illumina 公司	ILMN US	纳斯达克 证券交易 所	美国	488	661,125.44	0.17
489	GENERAL MILLS INC	通用磨坊	GIS US	美国纽约 证券交易 所	美国	1,189	658,966.22	0.17
490	ADVANCED MICRO DEVICES	AMD 公司	AMD US	纳斯达克 证券交易 所	美国	800	658,472.70	0.17
491	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	沃博联股 份有限公 司	WBA US	纳斯达克 证券交易 所	美国	3,181	654,850.34	0.17
492	BATH & BODY WORKS	Bath & Body Works 股	BBWI US	美国纽约 证券交易 所	美国	2,367	641,380.07	0.16

	INC	份有限公司						
493	ZIONS BANCORP NA	锡安银行	ZION US	纳斯达克 证券交易 所	美国	3,238	628,447.19	0.16
494	HUMANA INC	Humana 股份有限 公司	HUM US	美国纽约 证券交易 所	美国	194	626,789.16	0.16
495	KEYCORP	KeyCorp 公司	KEY US	美国纽约 证券交易 所	美国	9,359	624,866.66	0.16
496	NASDAQ INC	纳斯达克 股份有限 公司	NDAQ US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,728	622,436.19	0.16
497	WARNER BROS DISCOVE RY INC	华纳兄弟 探索股份 有限公司	WBD US	纳斯达克 证券交易 所	美国	6,868	622,320.00	0.16
498	NEWS CORP - CLASS A	新闻集团	NWSA US	纳斯达克 证券交易 所	美国	3,967	558,962.60	0.14
499	FOX CORP - CLASS A	福克斯公 司	FOXA US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,979	486,195.18	0.12
500	ALPHABE T INC-CL A	Alphabet 公司	GOOGL US	纳斯达克 证券交易 所	美国	438	378,838.58	0.10
501	ALPHABE T INC-CL C	Alphabet 公司	GOOG US	纳斯达克 证券交易 所	美国	377	329,537.59	0.08
502	FOX CORP - CLASS B	福克斯公 司	FOX US	纳斯达克 证券交易 所	美国	961	221,443.96	0.06
503	NEWS CORP - CLASS B	新闻集团	NWS US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,222	174,126.17	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	STEEL DYNAMICS INC	STLD US	866,913.38	0.24
2	PALO ALTO NETWORKS INC	PANW US	806,095.73	0.23
3	INSULET CORP	PODD US	761,671.72	0.21
4	AXON ENTERPRISE INC	AXON US	698,578.60	0.20
5	BUNGE LTD	BG US	694,859.59	0.20
6	FAIR ISAAC CORP	FICO US	655,958.80	0.18
7	ADVANCE AUTO PARTS INC	AAP US	540,688.83	0.15
8	GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	GEHC US	535,125.02	0.15
9	CATALENT INC	CTLT US	448,522.53	0.13
10	NEWELL BRANDS INC	NWL US	357,175.09	0.10
11	COMERICA INC	CMA US	344,480.69	0.10
12	EPAM SYSTEMS INC	EPAM US	342,348.92	0.10
13	ENPHASE ENERGY INC	ENPH US	337,752.69	0.10
14	DOLLAR GENERAL CORP	DG US	332,857.13	0.09
15	VF CORP	VFC US	325,713.65	0.09
16	ZIONS BANCORP NA	ZION US	314,142.77	0.09
17	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	EL US	301,142.92	0.08
18	ORGANON & CO	OGN US	288,790.84	0.08
19	US BANCORP	USB US	287,027.76	0.08
20	CITIZENS FINANCIAL GROUP	CFG US	285,244.08	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	NVIDIA CORP	NVDA US	795,129.53	0.22
2	META PLATFORMS INC-CLASS A	META US	788,930.31	0.22
3	VORNADO REALTY TRUST	VNO US	624,995.61	0.18
4	ALIGN TECHNOLOGY INC	ALGN US	525,253.23	0.15
5	ADVANCED MICRO DEVICES	AMD US	485,948.70	0.14
6	GENERAL ELECTRIC CO	GE US	469,865.58	0.13
7	PULTEGROUP INC	PHM US	466,848.44	0.13
8	SALESFORCE INC	CRM US	451,313.88	0.13

9	DISH NETWORK CORP-A	DISH US	442,812.85	0.12
10	CATALENT INC	CTLT US	408,290.38	0.11
11	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	RCL US	402,259.38	0.11
12	CARNIVAL CORP	CCL US	380,559.31	0.11
13	LUMEN TECHNOLOGIES INC	LUMN US	359,964.05	0.10
14	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	WST US	351,951.10	0.10
15	ELI LILLY & CO	LLY US	331,680.65	0.09
16	ORACLE CORP	ORCL US	318,842.34	0.09
17	BROADCOM INC	AVGO US	305,338.08	0.09
18	SERVICENOW INC	NOW US	296,892.40	0.08
19	NETFLIX INC	NFLX US	295,645.65	0.08
20	AMAZON.COM INC	AMZN US	295,095.64	0.08

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	55,187,000.48
卖出收入（成交）总额	46,100,454.45

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前

一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	2,748,416.34
3	应收股利	466,467.83
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,224,360.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	134,342.84
8	其他	-
9	合计	4,573,587.73

### 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 (%)
43,490	3,915.56	20,414,429.19	11.99	149,873,195.43	88.01

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	14,126.85	0.0083

**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	162,940,929.31
本报告期基金总申购份额	43,277,947.47
减：本报告期基金总赎回份额	35,931,252.16
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	170,287,624.62

注：大成标普 500 等权重指数证券投资基金份额变动包含人民币份额及美元份额。

**§ 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**

经大成基金管理有限公司第八届董事会第二次会议审议通过，自 2023 年 3 月 25 日起，温智敏先生不再担任公司副总经理职务；聘请石国武先生担任公司副总经理，任期自 2023 年 3 月 25 日起，至公司第八届董事会任期届满之日止。具体详见我司发布的《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

**二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动**

本报告期内，基金托管人的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，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。



#### 10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

#### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

##### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

##### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

#### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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	101,287,454.93	100.00	30,945.12	100.00	-
大和资本	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	2023 年 6 月 30 日
2	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 4 月 27 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	2023 年 4 月 22 日
4	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2023 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	2023 年 4 月 21 日
5	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2022 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	2023 年 3 月 30 日
6	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海中欧财富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	2023 年 3 月 27 日
7	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	2023 年 3 月 27 日
8	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	2023 年 3 月 27 日
9	大成基金管理有限公司关于养老金客	中国证监会基金电子披	2023 年 3 月 24 日

	户通过直销柜台申购旗下基金费率优惠的公告	露网站、规定报刊及本公司网站	
10	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 3 月 16 日
11	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加深圳前海微众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	2023 年 2 月 23 日
12	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2022 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	2023 年 1 月 18 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 2022 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	2023 年 1 月 13 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	2023 年 1 月 12 日
15	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金 2023 年境外（地区）主要市场节假日（含非港股通交易日）暂停申购赎回安排的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 1 月 6 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

2023 年 8 月 30 日