

# 嘉实美国成长股票型证券投资基金 2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 月 28 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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，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 2025 年 03 月 24 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。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 12 月 31 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 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</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                              | 9         |
| 3.3 其他指标                                | 12        |
| 3.4 过去三年基金的利润分配情况                       | 12        |
| <b>§4 管理人报告</b>                         | <b>12</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 12        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 13        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 13        |
| 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             | 14        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 15        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 16        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 17        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 17        |
| 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明        | 17        |
| 4.10 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      | 17        |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | <b>17</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 17        |
| 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 | 17        |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 18        |
| <b>§6 审计报告</b>                          | <b>18</b> |
| 6.1 审计报告基本信息                            | 18        |
| 6.2 审计报告的基本内容                           | 18        |
| <b>§7 年度财务报表</b>                        | <b>20</b> |
| 7.1 资产负债表                               | 20        |
| 7.2 利润表                                 | 21        |
| 7.3 净资产变动表                              | 22        |
| 7.4 报表附注                                | 24        |

|                                                   |            |
|---------------------------------------------------|------------|
| <b>§8 投资组合报告 .....</b>                            | <b>51</b>  |
| 8.1 期末基金资产组合情况.....                               | 51         |
| 8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....                   | 52         |
| 8.3 期末按行业分类的权益投资组合.....                           | 52         |
| 8.4 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 .....           | 53         |
| 8.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....                          | 101        |
| 8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....                       | 103        |
| 8.7 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 .....          | 103        |
| 8.8 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 .....       | 103        |
| 8.9 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 .....       | 103        |
| 8.10 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 .....         | 103        |
| 8.11 投资组合报告附注.....                                | 105        |
| <b>§9 基金份额持有人信息.....</b>                          | <b>105</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                        | 105        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....                    | 106        |
| 9.3 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 .....            | 106        |
| 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况..... | 107        |
| <b>§10 开放式基金份额变动.....</b>                         | <b>107</b> |
| <b>§11 重大事件揭示.....</b>                            | <b>107</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议.....                             | 107        |
| 11.2 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 .....            | 107        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....                 | 108        |
| 11.4 基金投资策略的改变.....                               | 108        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                        | 108        |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....               | 108        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....                       | 108        |
| 11.8 其他重大事件.....                                  | 111        |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>                            | <b>113</b> |
| 12.1 备查文件目录.....                                  | 113        |
| 12.2 存放地点.....                                    | 113        |
| 12.3 查阅方式.....                                    | 113        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                     |                      |
|-----------------|---------------------|----------------------|
| 基金名称            | 嘉实美国成长股票型证券投资基金     |                      |
| 基金简称            | 嘉实美国成长股票（QDII）      |                      |
| 基金主代码           | 000043              |                      |
| 基金运作方式          | 契约型开放式              |                      |
| 基金合同生效日         | 2013 年 6 月 14 日     |                      |
| 基金管理人           | 嘉实基金管理有限公司          |                      |
| 基金托管人           | 中国银行股份有限公司          |                      |
| 报告期末基金份额总额      | 1,345,012,185.36 份  |                      |
| 基金合同存续期         | 不定期                 |                      |
| 下属分级基金的基金简称     | 嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币 | 嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇 |
| 下属分级基金的交易代码     | 000043              | 000044               |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,340,845,658.20 份  | 4,166,527.16 份       |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金主要投资于美国大盘成长型股票，在股票选择及组合构建方面均运用量化投资方法并结合风险管理手段，力争获取长期资本增值。                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 投资策略   | <p>本基金不尝试进行择时操作。在正常的市场条件下，本基金将在基金合同以及法律法规所允许的投资范围内，最大程度的持有股票类资产。当基金经理认为足够审慎时，本基金亦可以将小部分资产配置于债券类和现金类等大类资产上。</p> <p>本基金采用主动的量化投资策略。本基金将依托内部自主研发的定量投资模型以及强大的数据库系统，构建投资组合。嘉实量化投资团队将根据市场外在与内在变化趋势，定期或不定期地对模型进行复核，并做出相应调整，以不断改善模型的适用性。</p> <p>本基金主要投资于市值超过 20 亿美元的美国大盘股票；在此基础上，本基金将通过成长性模型挑选出足够数量的最具成长性的股票作为股票选择的样本空间。</p> <p>具体投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、固定收益投资策略、衍生品投资策略。</p> |
| 业绩比较基准 | 95%×罗素 1000 成长指数收益率+5%×境内银行活期存款税后利率                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 风险收益特征 | 本基金主要投资于美国大盘成长型股票，属于主动投资的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金与混合型基金，为证券投资基金中的较高预期风险、较高预期收益的投资品种。                                                                                                                                                                                                                                                                             |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
|----|-------|-------|
|----|-------|-------|

|             |                                           |                   |                           |
|-------------|-------------------------------------------|-------------------|---------------------------|
| 名称          | 嘉实基金管理有限公司                                |                   | 中国银行股份有限公司                |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名                                        | 郭松                | 许俊                        |
|             | 联系电话                                      | (010)65215588     | 010-66596688              |
|             | 电子邮箱                                      | service@jsfund.cn | fxjd_hq@bank-of-china.com |
| 客户服务电话      | 400-600-8800                              |                   | 95566                     |
| 传真          | (010)65215588                             |                   | 010-66594942              |
| 注册地址        | 中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 1806A 单元        |                   | 北京西城区复兴门内大街 1 号           |
| 办公地址        | 北京市朝阳区建国门外大街 21 号<br>北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层 |                   | 北京西城区复兴门内大街 1 号           |
| 邮政编码        | 100020                                    |                   | 100818                    |
| 法定代表人       | 经雷                                        |                   | 葛海蛟                       |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                                                         |
|---------------------|---------------------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《证券日报》                                                  |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a> |
| 基金年度报告备置地点          | 北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司         |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称               | 办公地址                                           |
|--------|------------------|------------------------------------------------|
| 会计师事务所 | 容诚会计师事务所（特殊普通合伙） | 北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层<br>1001-1 至 1001-26 |
| 注册登记机构 | 嘉实基金管理有限公司       | 北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层          |

# § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1<br>期间<br>数据<br>和<br>指标 | 报告期（2024 年 1 月 1 日<br>-2024 年 12 月 31 日） | 报告期（2023 年 1 月 1 日<br>-2023 年 12 月 31 日） | 报告期（2022 年 1 月 1 日<br>-2022 年 12 月 31 日） |
|------------------------------|------------------------------------------|------------------------------------------|------------------------------------------|
|                              | 嘉实美国成长<br>股票型证券投资<br>基金-人民<br>币          | 嘉实美国成<br>长股票型证<br>券投资基金<br>-美元现汇         | 嘉实美国成长<br>股票型证券投资<br>基金-人民<br>币          |
|                              | 嘉实美国成<br>长股票型证<br>券投资基金<br>-美元现汇         | 嘉实美国成长<br>股票型证券投资<br>基金-人民<br>币          | 嘉实美国成<br>长股票型证<br>券投资基金<br>-美元现汇         |
| 本期<br>已实                     | 101,350,294.56                           | 3,395,948.59                             | 63,793,999.43                            |
|                              |                                          |                                          | 5,053,609.48                             |
|                              |                                          |                                          | -14,819,682.18                           |
|                              |                                          |                                          | -1,033,428.96                            |

|                 |                |               |                |               |                 |                |
|-----------------|----------------|---------------|----------------|---------------|-----------------|----------------|
| 现收益             |                |               |                |               |                 |                |
| 本期利润            | 679,935,455.21 | 31,475,207.38 | 400,833,454.28 | 31,565,759.64 | -328,304,437.27 | -21,364,826.72 |
| 加权平均基金份额本期利润    | 0.8938         | 7.2463        | 1.0317         | 6.3451        | -0.7421         | -4.3011        |
| 本期加权平均净值利润率     | 19.86%         | 26.96%        | 32.02%         | 32.22%        | -25.68%         | -24.43%        |
| 本期基金份额净值增长率     | 32.68%         | 30.75%        | 38.83%         | 36.53%        | -20.82%         | -27.48%        |
| 3.1<br>.2<br>期末 | 2024 年末        |               | 2023 年末        |               | 2022 年末         |                |

|                 |                      |                    |                      |                    |                      |                   |
|-----------------|----------------------|--------------------|----------------------|--------------------|----------------------|-------------------|
| 数据和指标           |                      |                    |                      |                    |                      |                   |
| 期末可供分配利润        | 1,257,564,39<br>1.08 | 26,993,612<br>.92  | 300,978,556.<br>95   | 25,302,250<br>.25  | 282,208,317.<br>53   | 23,808,345<br>.96 |
| 期末可供分配基金份额利润    | 0.9379               | 6.4787             | 0.8054               | 5.6723             | 0.6377               | 4.6482            |
| 期末基金资产净值        | 6,615,004,83<br>2.55 | 125,419,53<br>1.28 | 1,389,620,51<br>1.46 | 101,206,95<br>1.23 | 1,185,382,06<br>2.47 | 83,685,753<br>.71 |
| 期末基金份额净值        | 4.933                | 4.188              | 3.718                | 3.203              | 2.678                | 2.346             |
| 3.1<br>.3<br>累计 | 2024 年末              |                    | 2023 年末              |                    | 2022 年末              |                   |

| 期<br>末<br>指<br>标                                    |         |         |         |         |         |         |
|-----------------------------------------------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 基<br>金<br>份<br>额<br>累<br>计<br>净<br>值<br>增<br>长<br>率 | 393.30% | 318.80% | 271.80% | 220.30% | 167.80% | 134.60% |

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

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

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

（4）嘉实美国成长股票(QDII)美元现汇的期末基金份额净值为美元。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币

| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值增<br>长率标准差<br>② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①－③     | ②－④   |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|---------|-------|
| 过去三个月          | 8.58%        | 1.06%               | 6.57%              | 0.97%                 | 2.01%   | 0.09% |
| 过去六个月          | 8.94%        | 1.29%               | 9.68%              | 1.17%                 | -0.74%  | 0.12% |
| 过去一年           | 32.68%       | 1.17%               | 30.73%             | 1.05%                 | 1.95%   | 0.12% |
| 过去三年           | 45.86%       | 1.32%               | 30.16%             | 1.30%                 | 15.70%  | 0.02% |
| 过去五年           | 126.70%      | 1.48%               | 120.78%            | 1.46%                 | 5.92%   | 0.02% |
| 自基金合同生效<br>起至今 | 393.30%      | 1.18%               | 405.35%            | 1.15%                 | -12.05% | 0.03% |

嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇

| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值增<br>长率标准差<br>② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③     | ②—④   |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|---------|-------|
| 过去三个月          | 5.86%        | 1.02%               | 6.57%              | 0.97%                 | -0.71%  | 0.05% |
| 过去六个月          | 8.02%        | 1.26%               | 9.68%              | 1.17%                 | -1.66%  | 0.09% |
| 过去一年           | 30.75%       | 1.15%               | 30.73%             | 1.05%                 | 0.02%   | 0.10% |
| 过去三年           | 29.46%       | 1.30%               | 30.16%             | 1.30%                 | -0.70%  | 0.00% |
| 过去五年           | 120.19%      | 1.46%               | 120.78%            | 1.46%                 | -0.59%  | 0.00% |
| 自基金合同生效<br>起至今 | 318.80%      | 1.16%               | 405.35%            | 1.15%                 | -86.55% | 0.01% |

注：本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

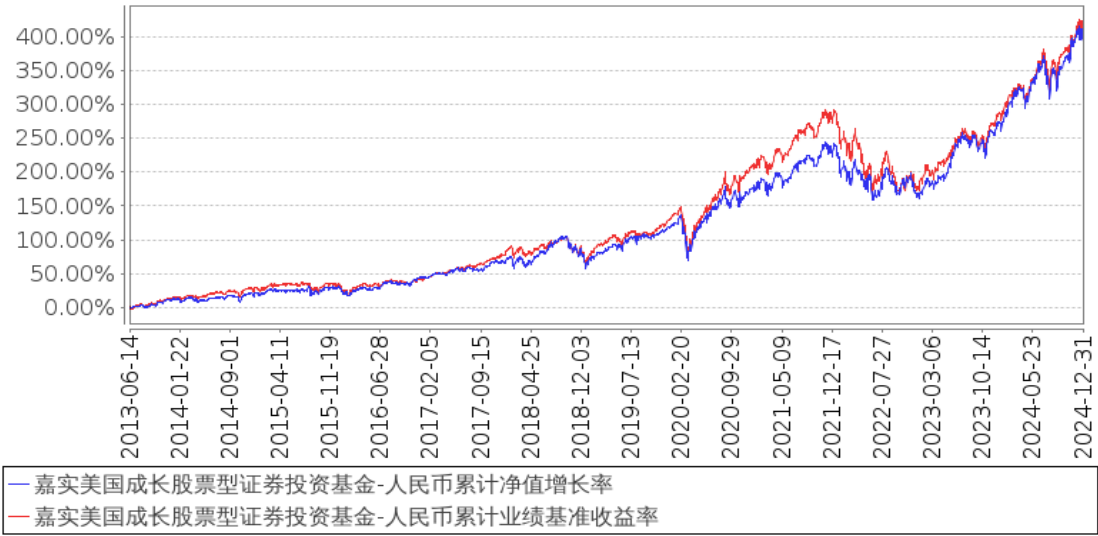
$$\text{Return}(t) = 95\% \times \text{罗素 1000 成长指数收益率}(t) + 5\% \times ((1 + \text{境内银行活期存款税后利率})^{1/365} - 1)$$

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

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

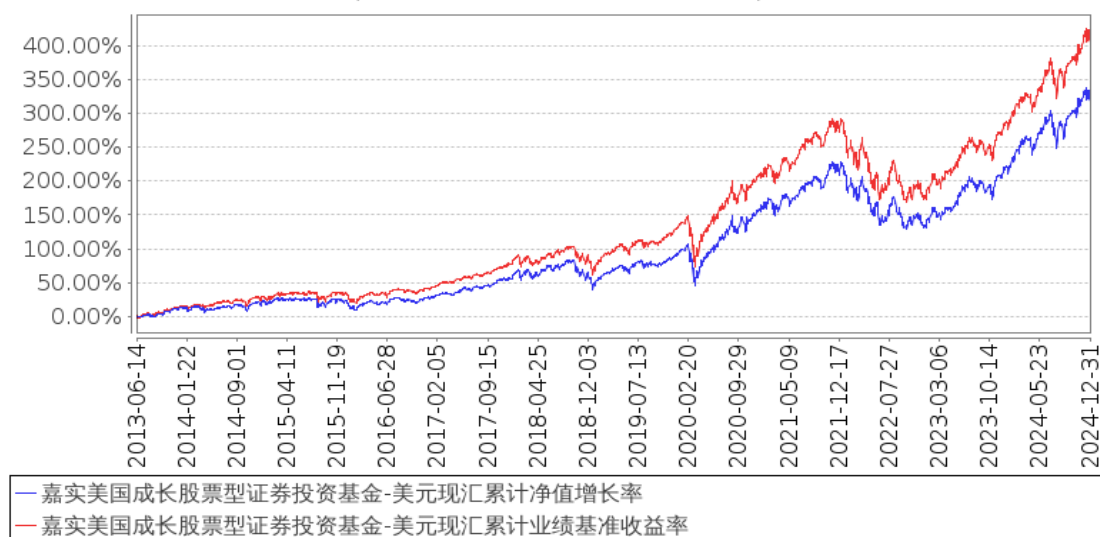
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2013年06月14日至2024年12月31日)



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

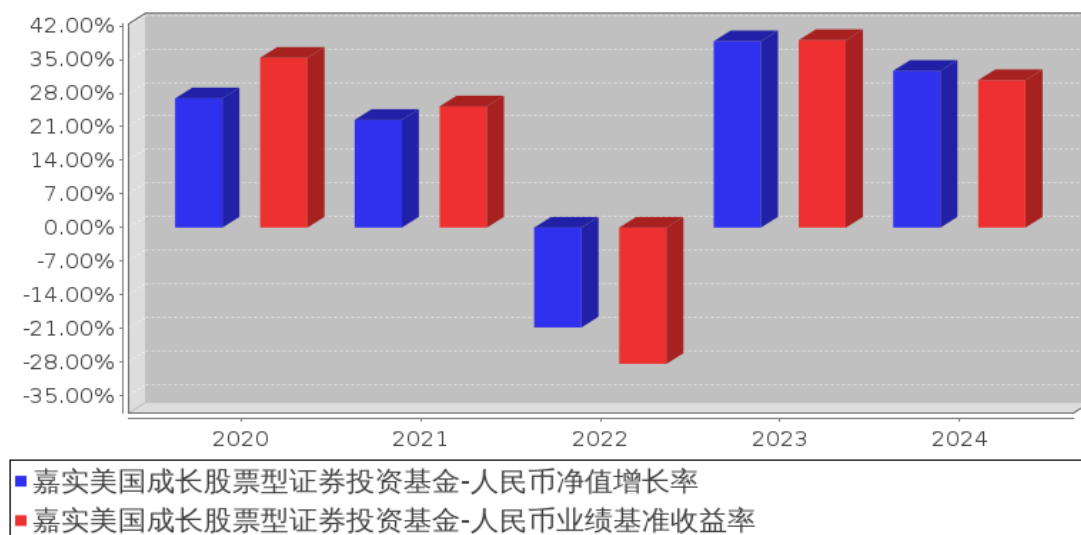
(2013年06月14日至2024年12月31日)



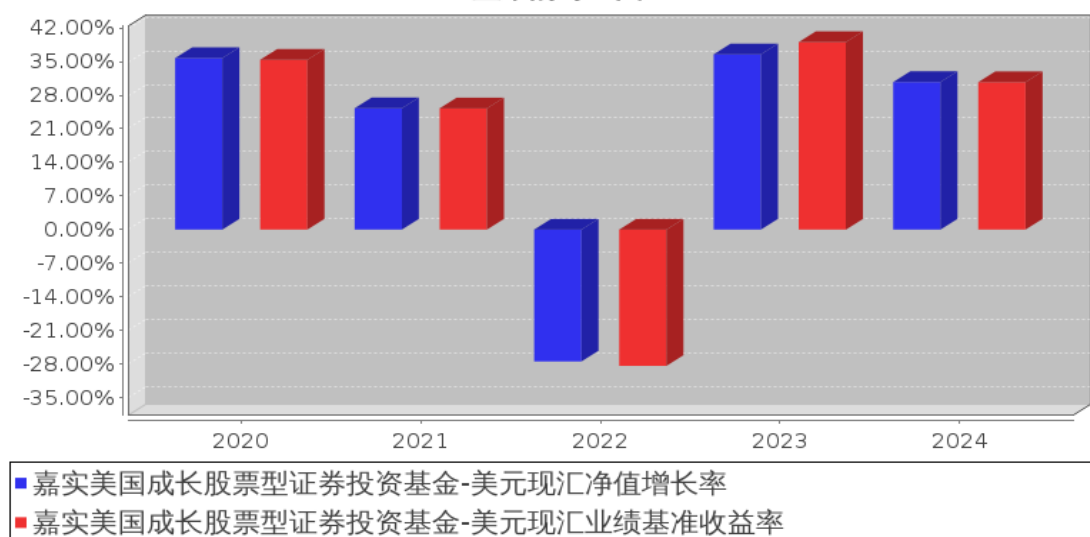
注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### 嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：上述数据根据基金当年实际存续期计算。

### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5 号文批准，于 1999 年 3 月 25 日成立。公司注册地上海，总部设在北京并设北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII 和特定资产管理业务等资格。

截止 2024 年 12 月 31 日，基金管理人共管理 355 只公募基金，覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF、基础设施基金等不同类别。同时，还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务   | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明                    |
|----|------|-----------------|------|--------|-----------------------|
|    |      | 任职日期            | 离任日期 |        |                       |
| 张自 | 本基金、 | 2013 年 6        | -    | 28 年   | 曾任美国世纪投资管理公司（American |

|   |                                |        |  |  |                                                                                                                                                                                                |
|---|--------------------------------|--------|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 力 | 嘉实全球<br>价值股票<br>（QDII）<br>基金经理 | 月 14 日 |  |  | Century Investments）资深副总经理，研究部总监暨基金经理，负责直接管理、支持公司旗下近二百亿美元的多项大型公募基金和对冲基金类产品。2012 年 2 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任定量投资部负责人、人工智能投资部负责人，现任股票投研人工智能投资总监，博士后科研工作站导师。博士研究生，毕业于美国德州大学奥斯汀分校和中国科学技术大学，具有基金从业资格。美国国籍。 |
|---|--------------------------------|--------|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

（3）2025 年 2 月 22 日，本基金管理人发布《关于新增嘉实美国成长股票（QDII）基金经理的公告》，增聘张楠先生担任本基金基金经理，本基金由张自力先生与张楠先生共同管理。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实美国成长股票型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易、境外投资以及投资管理过程中各个相关环节应当符合公平交易的监管要求，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司严格执行《公平交易管理制度》，各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部门集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进

行分配。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的，合计 11 次，均为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 全年，美股资本市场整体呈现积极上涨的态势，并且表现出较为明显的结构性特征，大盘占优、成长占优。道指上涨 12.88%，标普 500 上涨 23.31%，大盘成长风格和科技板块较强，纳指上涨 24.88%。市值维度上，大盘指数罗素 1000 上涨 22.84%，大幅领先小盘指数罗素 2000 的 10.02%，大盘之内的风格维度上，罗素 1000 成长上涨 32.46%，也大幅领先罗素 1000 价值的 11.94%。

报告期内，美联储在下半年开启了降息措施，正式进入降息通道，但受高通胀等约束，降息节奏不快，强度不大。

美股市场内的结构性特征，受到诸多因素推动，疫情后持续多个季度的较强劲的企业盈利增长，对整体市场尤其是成长板块和龙头股的上行起到了推动作用并消化估值、AI 产业趋势继续对科技成长风格以及核心龙头股票的催化、宏观经济指标对美联储货币政策施展空间及投资者预期的推动。相比于美联储加息期间价值风格的走强而言，报告期内成长风格显著占优。美股市场在科技龙头的较强势表现之外，有逐步向扩散性上行趋势发展的趋势，预计随着诸如美联储降息预期升温而进一步催化，其背后是企业盈利的坚实基本面，随着盈利增厚，美股整体估值并未明显抬升到高估水平。由于一季度大面积的业绩持续超预期，美股也远未达到泡沫化水平，三季度期间受大选、飓风影响，企业经营决策在期间有所延迟，盈利回到龙头股拉动的结构。在货币政策

转向后，美股经济预估没有深度衰退的风险，在此背景下估值扩张会是另一个整体上涨的驱动力，市场将有更广泛的 ALPHA 机会，从历史规律来看，加息转入降息通道后，对利率更为敏感的资产往往表现领先。下半年，美联储已经进入降息周期，预期未来随着通胀处于高位平台并不再上行、美国就业数据保持稳定、经济增长稳健、企业投资开支增加等多重因素，权益类资产、成长风格以及新兴科技等领域都会有更乐观的预期。

2024 年内，美股波动较大的时段在 7 月末 8 月初，期间适逢日本突然加息带来国际资本相关 Carry Trade 受冲击并传导到权益市场、美国飓风下失业率数据超预期提升、7 月上旬 Trump Trade 带来的短促强劲的结构变化开始反向交易，多重因素下市场出现短期快速调整，但以上因素都不涉及美股核心定价基础企业盈利能力，在市场情绪和预期风险释放后重新转入上行趋势。

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

本报告期间，本基金运作主要包括应对净申赎造成的仓位波动和实现对美国成长股的筛选与投资过程。本基金资金运作流程较长，单向包括从人民币申购、确认、换汇和掉汇等一系列步骤，涉及国内外券商和银行的多个环节，在市场大幅震荡背景下，申赎的随机性和资金流程会影响仓位水平并影响投资业绩，报告期内实现了流动性的稳健管理。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币基金份额净值为 4.933 元，本报告期基金份额净值增长率为 32.68%；截至本报告期末嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇基金份额净值为 4.188 美元，本报告期基金份额净值增长率为 30.75%；业绩比较基准收益率为 30.73%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美股的核心驱动力，是企业盈利能力的积极态势，建立在对美股上市公司盈利能力、成长性、估值等多维度特征基础上的纪律化选股模型是本组合的基础模型，面向未来依然坚持以企业盈利能力及资本市场定价模型为核心判断依据。美股在 2023 年 3 季度、4 季度以及 2024 年前 2 个季度的几次财务披露中，不仅都保持了强劲的盈利水平和盈利成长态势，也展示了逐渐扩张的盈利范围，由此构成了更广泛的选股机会。已披露的 3 季报，受大选等因素企业战略规划和资本开支

有所延滞，3 季报依然以龙头企业为拉动主力，4 季度财务预期基本保持与 3 季度一致。2023 年以来的多个季度的美股市场结构，如我们多次报告内的展望一致，逐步从龙头领涨上涨的状态，进入有更广泛企业盈利增长为基础的扩散性的上行阶段，有更大范围的 ALPHA 挖掘机会，在本年度，也如之前的展望一致，RLG 对 NDX 继续领先。

除企业盈利外，美联储政策以及美国新政府的财政方面计划，也是资本市场的基础环境和核心催化。美联储已经进入降息通道，将不会退回到加息进程，在利率等金融条件进入更加宽松的环境时，企业融资约束边际放松，相对利好对利率更为敏感的成长股和小盘股。从历史规律来看，加息停止后，对利率更为敏感的资产往往表现领先，小盘股占优将开启美股市场的扩散牛行情，被动指数将难以跑赢主动权益基金。市场将面临扩散性牛市的潜在时机，而降息预期加强以及政策推出等时刻会出现的市场快速结构性调整是潜在的波动和风险。另一方面，新政府在关税、贸易争端等方面带来的风险，与在国内企业减税、金融去监管、支持能源企业、扩大财政支出方面带来的机会并存，需要积极跟踪并进行分析判断。

后续，我们将根据合同要求保持高仓位水平，坚持量化框架的纪律化操作，并积极调整和优化模型，控制风险，希望取得更好的投资效果，回馈投资者。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人有关监察稽核工作情况如下：

（1）继续内控前置。在基金营销、投资交易、信息披露以及新产品设计开发、海外业务、另类业务、制度建设、合同管理、法律咨询等方面，事前进行合规性审核、监控。全力支持新业务开展，对新产品、新投资工具等进行合规性判断。在制度流程、投资范围、投资工具、运作规则等方面，防控重大风险。

（2）全流程动态开展投资交易监督。一是事前防范，主要从事前研讨，合规风险识别、评估和分析，IT 事前设置，建立禁限库，合规培训、承诺书等方面开展；二是事中实时监控，如实时回答组合经理、交易员投资交易事项，盘中实时监控等；三是事后检查及改进，如检查投资交易合规情况，对异常行为进行提示、处理建议并督促改正。优化和升级合规风控系统，不断提高自动化监控能力，保障各类组合合规运作，保护投资者利益。

（3）按计划对销售、投资、后台和其它业务开展内部稽核，完成相应内审报告及其后续改进跟踪。完成公司及基金的外审、公司 GIPS 第三方验证、ISAE3402 国际鉴证等。

（4）基金法务工作。包括合同、协议审查，主动解决各项法律文件以及实务运作中存在的差错和风险隐患，重点防控新增产品、新增业务以及日常业务的法律风险问题。

（5）加强差错管理。继续推动各业务单元梳理流程、制度，落实风险责任授权体系，确保所有识

别的关键风险点均有相应措施控制。

此外，我们还积极配合监管，按时完成合规报告和各项统计报表以及专题报告。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制，与估值相关的机构包括基金投资市场的证券交易场所以及境内相关机构等。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

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

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本年度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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

|            |                      |
|------------|----------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                    |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见              |
| 审计报告编号     | 容诚审字[2025]100Z0652 号 |

6.2 审计报告的基本内容

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|-----------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 审计报告标题          | 审计报告                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 审计报告收件人         | 嘉实美国成长股票型证券投资基金全体基金份额持有人                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 审计意见            | <p>我们审计了嘉实美国成长股票型证券投资基金（以下简称“嘉实美国成长股票（QDII）基金”）财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“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，公允反映了嘉实美国成长股票（QDII）基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础       | <p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于嘉实美国成长股票（QDII）基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>                                                                                                                                        |
| 强调事项            | 无                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 其他事项            | 无                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 其他信息            | 无                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>嘉实美国成长股票（QDII）基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估嘉实美国成长股票（QDII）基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理</p>                                                       |

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |     |
|-----------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|
|                 | <p>层计划清算嘉实美国成长股票(QDII)基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督嘉实美国成长股票(QDII)基金的财务报告过程。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |     |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对嘉实美国成长股票(QDII)基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致嘉实美国成长股票(QDII)基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |     |
| 会计师事务所的名称       | 容诚会计师事务所（特殊普通合伙）                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |     |
| 注册会计师的姓名        | 蔡晓慧                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | 柴瀚英 |
| 会计师事务所的地址       | 北京市西城区阜成门外大街22号1幢10层1001-1至1001-26                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |     |
| 审计报告日期          | 2025年3月26日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |     |

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：嘉实美国成长股票型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产           | 附注号        | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日         |
|---------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>   |            |                                 |                                  |
| 货币资金          | 7.4.7.1    | 412,180,456.24                  | 112,543,778.61                   |
| 结算备付金         |            | —                               | —                                |
| 存出保证金         |            | —                               | —                                |
| 交易性金融资产       | 7.4.7.2    | 6,385,300,181.99                | 1,391,179,240.32                 |
| 其中：股票投资       |            | 6,374,467,133.94                | 1,339,895,575.80                 |
| 基金投资          |            | 10,833,048.05                   | 51,283,664.52                    |
| 债券投资          |            | —                               | —                                |
| 资产支持证券投资      |            | —                               | —                                |
| 贵金属投资         |            | —                               | —                                |
| 其他投资          |            | —                               | —                                |
| 衍生金融资产        | 7.4.7.3    | —                               | —                                |
| 买入返售金融资产      | 7.4.7.4    | —                               | —                                |
| 债权投资          | 7.4.7.5    | —                               | —                                |
| 其中：债券投资       |            | —                               | —                                |
| 资产支持证券投资      |            | —                               | —                                |
| 其他投资          |            | —                               | —                                |
| 其他债权投资        | 7.4.7.6    | —                               | —                                |
| 其他权益工具投资      | 7.4.7.7    | —                               | —                                |
| 应收清算款         |            | —                               | —                                |
| 应收股利          |            | 1,077,773.30                    | 699,842.80                       |
| 应收申购款         |            | 55,354,353.78                   | 10,678,975.43                    |
| 递延所得税资产       |            | —                               | —                                |
| 其他资产          | 7.4.7.8    | —                               | —                                |
| 资产总计          |            | 6,853,912,765.31                | 1,515,101,837.16                 |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2024 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2023 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        | 7.4.7.3    | —                               | —                                |
| 卖出回购金融资产款     |            | —                               | —                                |
| 应付清算款         |            | 28,563,029.05                   | 2,985,757.94                     |
| 应付赎回款         |            | 73,547,835.40                   | 18,222,142.55                    |

|             |          |                  |                  |
|-------------|----------|------------------|------------------|
| 应付管理人报酬     |          | 9,102,578.87     | 2,238,657.55     |
| 应付托管费       |          | 1,769,945.90     | 435,294.54       |
| 应付销售服务费     |          | -                | -                |
| 应付投资顾问费     |          | -                | -                |
| 应交税费        |          | 77,710.84        | 123,123.40       |
| 应付利润        |          | -                | -                |
| 递延所得税负债     |          | -                | -                |
| 其他负债        | 7.4.7.9  | 427,301.42       | 269,398.49       |
| 负债合计        |          | 113,488,401.48   | 24,274,374.47    |
| <b>净资产：</b> |          |                  |                  |
| 实收基金        | 7.4.7.10 | 1,366,507,768.39 | 401,200,270.43   |
| 未分配利润       | 7.4.7.12 | 5,373,916,595.44 | 1,089,627,192.26 |
| 净资产合计       |          | 6,740,424,363.83 | 1,490,827,462.69 |
| 负债和净资产总计    |          | 6,853,912,765.31 | 1,515,101,837.16 |

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币基金份额净值 4.933 元，基金份额总额 1,340,845,658.20 份，嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇基金份额净值 4.188 美元，基金份额总额 4,166,527.16 份，基金份额总额合计为 1,345,012,185.36 份。

## 7.2 利润表

会计主体：嘉实美国成长股票型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目               | 附注号      | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024<br>年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023<br>年 12 月 31 日 |
|-------------------|----------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| <b>一、营业总收入</b>    |          | 787,034,281.80                            | 461,592,493.00                                 |
| 1. 利息收入           |          | 428,919.72                                | 169,101.80                                     |
| 其中：存款利息收入         | 7.4.7.13 | 428,919.72                                | 169,101.80                                     |
| 债券利息收入            |          | -                                         | -                                              |
| 资产支持证券利息收入        |          | -                                         | -                                              |
| 买入返售金融资产收入        |          | -                                         | -                                              |
| 其他利息收入            |          | -                                         | -                                              |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） |          | 249,850,716.18                            | 95,852,178.28                                  |
| 其中：股票投资收益         | 7.4.7.14 | 229,598,946.56                            | 81,844,315.59                                  |
| 基金投资收益            | 7.4.7.15 | 322,887.03                                | 3,832,056.39                                   |
| 债券投资收益            | 7.4.7.16 | -                                         | -                                              |
| 资产支持证券投资          | 7.4.7.17 | -                                         | -                                              |

|                            |            |                |                |
|----------------------------|------------|----------------|----------------|
| 收益                         |            |                |                |
| 贵金属投资收益                    | 7.4.7.18   | -              | -              |
| 衍生工具收益                     | 7.4.7.19   | -              | -              |
| 股利收益                       | 7.4.7.20   | 19,928,882.59  | 10,175,806.30  |
| 其他投资收益                     |            | -              | -              |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.21   | 606,664,419.44 | 363,551,605.01 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |            | -74,714,234.93 | 1,024,535.72   |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 7.4.7.22   | 4,804,461.39   | 995,072.19     |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 75,623,619.21  | 29,193,279.08  |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2.1 | 63,102,482.20  | 24,244,989.32  |
| 其中：暂估管理人报酬                 |            | -              | -              |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 12,269,927.12  | 4,714,303.47   |
| 3. 销售服务费                   |            | -              | -              |
| 4. 投资顾问费                   |            | -              | -              |
| 5. 利息支出                    |            | -              | -              |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | -              | -              |
| 6. 信用减值损失                  | 7.4.7.23   | -              | -              |
| 7. 税金及附加                   |            | 12,926.29      | 13,191.79      |
| 8. 其他费用                    | 7.4.7.24   | 238,283.60     | 220,794.50     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 711,410,662.59 | 432,399,213.92 |
| 减：所得税费用                    |            | -              | -              |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 711,410,662.59 | 432,399,213.92 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -              | -              |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | 711,410,662.59 | 432,399,213.92 |

### 7.3 净资产变动表

会计主体：嘉实美国成长股票型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |        |                  |                  |
|-----------|----------------------------------------|--------|------------------|------------------|
|           | 实收基金                                   | 其他综合收益 | 未分配利润            | 净资产合计            |
| 一、上期期末净资产 | 401,200,270.43                         | -      | 1,089,627,192.26 | 1,490,827,462.69 |
| 二、本期期初净   | 401,200,270.43                         | -      | 1,089,627,192.   | 1,490,827,462.6  |

|                                          |                                             |        |                   |                   |
|------------------------------------------|---------------------------------------------|--------|-------------------|-------------------|
| 资产                                       |                                             |        | 26                | 9                 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | 965,307,497.96                              | -      | 4,284,289,403.18  | 5,249,596,901.14  |
| (一)、综合收益总额                               | -                                           | -      | 711,410,662.59    | 711,410,662.59    |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)      | 965,307,497.96                              | -      | 3,572,878,740.59  | 4,538,186,238.55  |
| 其中：1. 基金申购款                              | 1,807,121,753.94                            | -      | 6,469,217,011.56  | 8,276,338,765.50  |
| 2. 基金赎回款                                 | -841,814,255.98                             | -      | -2,896,338,270.97 | -3,738,152,526.95 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | -                                           | -      | -                 | -                 |
| 四、本期期末净资产                                | 1,366,507,768.39                            | -      | 5,373,916,595.44  | 6,740,424,363.83  |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 |        |                   |                   |
|                                          | 实收基金                                        | 其他综合收益 | 未分配利润             | 净资产合计             |
| 一、上期期末净资产                                | 474,111,355.85                              | -      | 794,956,460.33    | 1,269,067,816.18  |
| 二、本期期初净资产                                | 474,111,355.85                              | -      | 794,956,460.33    | 1,269,067,816.18  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -72,911,085.42                              | -      | 294,670,731.93    | 221,759,646.51    |
| (一)、综合收益总额                               | -                                           | -      | 432,399,213.92    | 432,399,213.92    |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)      | -72,911,085.42                              | -      | -137,728,481.99   | -210,639,567.41   |

|                                          |                 |   |                  |                   |
|------------------------------------------|-----------------|---|------------------|-------------------|
| “—”号填列)                                  |                 |   |                  |                   |
| 其中：1. 基金申购款                              | 254,410,168.57  | — | 584,527,306.10   | 838,937,474.67    |
| 2. 基金赎回款                                 | -327,321,253.99 | — | -722,255,788.09  | -1,049,577,042.08 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“—”号填列） | —               | — | —                | —                 |
| 四、本期期末净资产                                | 401,200,270.43  | — | 1,089,627,192.26 | 1,490,827,462.69  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

经雷

梁凯

李袁

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

嘉实美国成长股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]14 号《关于核准嘉实美国成长股票型证券投资基金募集的批复》核准，由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《嘉实美国成长股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定。经向中国证监会备案，《嘉实美国成长股票型证券投资基金基金合同》于 2013 年 6 月 14 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 477,029,933.09 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、

中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实美国成长股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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、金融负债或权益工具。

##### (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业务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业务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。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。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、资产支持证券投资 and 基金投资，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) 金融负债的分类

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。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。

#### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以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衍生金融资产/负债。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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或资产支持证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和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，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。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、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。

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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算确认。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中（该类别次于其他所有工具类别），所有工具具有相同的特征（例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同）；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动（不包括本基金的任何影响）。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动（不包括该基金或合同的任何影响）；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证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交易所在地适用的预缴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。基金投资在持有期间应取得的红利扣除基金交易所在地适用的预缴所得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及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税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。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

基金的管理人报酬、托管费等在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

基金收益分配是指按规定将基金的可分配收益按基金份额进行比例分配。由于本基金两类基金份额类别分别以人民币和美元计价，两类基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同类别的每份基金份额享有同等分配权。基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，对某一基金份额类别，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利。如果基金份额持有人选择或默认选择现金分红形式，则美元份额以美元进行现金分红，人民币份额以人民币进行现金分红；如果选择红利再投资形式，则同一类别基金份额的分红资金将按除息日该类别的基金份额净值转成相应的同一类别的基金份额，红利再

投资的份额免收申购费。在符合基金收益分配条件的情况下，本基金收益每年最多分配 6 次，各类基金份额收益分配比例分别不得低于收益分配基准日该类基金份额的可供分配利润的 10%。基金收益分配后各类基金份额的每一基金份额净值分别不能低于其面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金无其他重要的会计政策和会计估计。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 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。

#### 7.4.5.2 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。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通

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

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

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

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

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

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目     | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款   | 412,180,456.24          | 112,543,778.61           |
| 等于：本金  | 412,154,870.03          | 112,535,574.15           |
| 加：应计利息 | 25,586.21               | 8,204.46                 |
| 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             | 412,180,456.24 | 112,543,778.61 |

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日  |      |                  |                  |
|---------------|-------|--------------------------|------|------------------|------------------|
|               |       | 成本                       | 应计利息 | 公允价值             | 公允价值变动           |
| 股票            |       | 5,308,276,351.58         | -    | 6,374,467,133.94 | 1,066,190,782.36 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                        | -    | -                | -                |
| 债券            | 交易所市场 | -                        | -    | -                | -                |
|               | 银行间市场 | -                        | -    | -                | -                |
|               | 合计    | -                        | -    | -                | -                |
| 资产支持证券        |       | -                        | -    | -                | -                |
| 基金            |       | 9,124,623.70             | -    | 10,833,048.05    | 1,708,424.35     |
| 其他            |       | -                        | -    | -                | -                |
| 合计            |       | 5,317,400,975.28         | -    | 6,385,300,181.99 | 1,067,899,206.71 |
| 项目            |       | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |      |                  |                  |
|               |       | 成本                       | 应计利息 | 公允价值             | 公允价值变动           |
| 股票            |       | 882,818,179.03           | -    | 1,339,895,575.80 | 457,077,396.77   |
| 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            |       | 47,126,274.02            | -    | 51,283,664.52    | 4,157,390.50     |
| 其他            |       | -                        | -    | -                | -                |
| 合计            |       | 929,944,453.05           | -    | 1,391,179,240.32 | 461,234,787.27   |

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

#### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

#### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

### 7.4.7.5 债权投资

#### 7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

#### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

### 7.4.7.6 其他债权投资

#### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

#### 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

### 7.4.7.7 其他权益工具投资

#### 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

#### 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 7.4.7.8 其他资产

无。

## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                       | -                        |
| 应付赎回费       | 259,301.42              | 50,398.49                |
| 应付证券出借违约金   | -                       | -                        |
| 应付交易费用      | -                       | -                        |
| 其中：交易所市场    | -                       | -                        |
| 银行间市场       | -                       | -                        |
| 应付利息        | -                       | -                        |
| 预提费用        | 168,000.00              | 219,000.00               |
| 合计          | 427,301.42              | 269,398.49               |

## 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币

| 项目            | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |                  |
|---------------|----------------------------------------|------------------|
|               | 基金份额（份）                                | 账面金额             |
| 上年度末          | 373,719,810.71                         | 373,719,810.71   |
| 本期申购          | 1,797,789,269.39                       | 1,797,789,269.39 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -830,663,421.90                        | -830,663,421.90  |
| 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           | 1,340,845,658.20                       | 1,340,845,658.20 |

嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇

| 项目            | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |                |
|---------------|----------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                                | 账面金额           |
| 上年度末          | 4,460,681.52                           | 27,480,459.72  |
| 本期申购          | 1,515,001.51                           | 9,332,484.55   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,809,155.87                          | -11,150,834.08 |
| 基金拆分/份额折算前    | -                                      | -              |
| 基金拆分/份额折算调整   | -                                      | -              |
| 本期申购          | -                                      | -              |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                      | -              |
| 本期末           | 4,166,527.16                           | 25,662,110.19  |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币

| 项目             | 已实现部分            | 未实现部分             | 未分配利润合计           |
|----------------|------------------|-------------------|-------------------|
| 上年度末           | 300,978,556.95   | 714,922,143.80    | 1,015,900,700.75  |
| 本期期初           | 300,978,556.95   | 714,922,143.80    | 1,015,900,700.75  |
| 本期利润           | 101,350,294.56   | 578,585,160.65    | 679,935,455.21    |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 855,235,539.57   | 2,723,087,478.82  | 3,578,323,018.39  |
| 其中：基金申购款       | 1,549,411,693.89 | 4,887,456,529.78  | 6,436,868,223.67  |
| 基金赎回款          | -694,176,154.32  | -2,164,369,050.96 | -2,858,545,205.28 |
| 本期已分配利润        | -                | -                 | -                 |
| 本期末            | 1,257,564,391.08 | 4,016,594,783.27  | 5,274,159,174.35  |

嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 上年度末           | 25,302,250.25  | 48,424,241.26  | 73,726,491.51  |
| 本期期初           | 25,302,250.25  | 48,424,241.26  | 73,726,491.51  |
| 本期利润           | 3,395,948.59   | 28,079,258.79  | 31,475,207.38  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,704,585.92  | -3,739,691.88  | -5,444,277.80  |
| 其中：基金申购款       | 9,086,804.95   | 23,261,982.94  | 32,348,787.89  |
| 基金赎回款          | -10,791,390.87 | -27,001,674.82 | -37,793,065.69 |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -              |
| 本期末            | 26,993,612.92  | 72,763,808.17  | 99,757,421.09  |

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 |
|-----------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 419,664.73                             | 168,340.63                                  |
| 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        | 9,254.99                               | 761.17                                      |
| 合计        | 428,919.72                             | 169,101.80                                  |

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

|                  | 2024年1月1日至2024年12月31日 | 2023年1月1日至2023年12月31日 |
|------------------|-----------------------|-----------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 229,598,946.56        | 81,844,315.59         |
| 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               | 229,598,946.56        | 81,844,315.59         |

#### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2024年1月1日至2024年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年12月31日 |
|------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 3,556,687,544.69            | 1,138,864,337.28                 |
| 减：卖出股票成本总额 | 3,322,529,501.54            | 1,055,815,614.59                 |
| 减：交易费用     | 4,559,096.59                | 1,204,407.10                     |
| 买卖股票差价收入   | 229,598,946.56              | 81,844,315.59                    |

#### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 7.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

| 项目                | 本期<br>2024年1月1日至2024年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年12月31日 |
|-------------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 卖出/赎回基金成交总额       | 60,630,996.66               | 41,980,214.43                    |
| 减：卖出/赎回基金成本总额     | 60,239,277.59               | 37,967,666.91                    |
| 减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额 | 11,409.31                   | 116,870.30                       |
| 减：交易费用            | 57,422.73                   | 63,620.83                        |
| 基金投资收益            | 322,887.03                  | 3,832,056.39                     |

#### 7.4.7.16 债券投资收益

##### 7.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

无。

## 7.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

## 7.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.17 资产支持证券投资收益

## 7.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

## 7.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

## 7.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.18 贵金属投资收益

## 7.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 7.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 7.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.19 衍生工具收益

## 7.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 7.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 7.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月<br>31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月<br>31 日 |
|---------------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 19,750,319.53                             | 9,834,174.09                                   |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | -                                         | -                                              |
| 基金投资产生的股利收益   | 178,563.06                                | 341,632.21                                     |
| 合计            | 19,928,882.59                             | 10,175,806.30                                  |

## 7.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年<br>12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023<br>年 12 月 31 日 |
|------------------------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | 606,664,419.44                            | 363,551,605.01                                 |
| 股票投资                   | 609,113,385.59                            | 358,311,843.61                                 |
| 债券投资                   | -                                         | -                                              |
| 资产支持证券投资               | -                                         | -                                              |
| 基金投资                   | -2,448,966.15                             | 5,239,761.40                                   |
| 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                     | 606,664,419.44                            | 363,551,605.01                                 |

## 7.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月<br>31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023<br>年 12 月 31 日 |
|---------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 4,804,461.39                              | 995,072.19                                     |
| 合计      | 4,804,461.39                              | 995,072.19                                     |

## 7.4.7.23 信用减值损失

无。

## 7.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

|         | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 |
|---------|----------------------------------|----------------------------------|
| 审计费用    | 48,000.00                        | 99,000.00                        |
| 信息披露费   | 120,000.00                       | 120,000.00                       |
| 证券出借违约金 | -                                | -                                |
| 银行划款手续费 | 70,283.60                        | 1,794.50                         |
| 合计      | 238,283.60                       | 220,794.50                       |

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 关联方关系

| 关联方名称                             | 与本基金的关系     |
|-----------------------------------|-------------|
| 嘉实基金管理有限公司（“嘉实基金”）                | 基金管理人       |
| 中国银行股份有限公司（“中国银行”）                | 基金托管人       |
| DWS Investments Singapore Limited | 基金管理人的股东    |
| 立信投资有限责任公司                        | 基金管理人的股东    |
| 中诚信托有限责任公司                        | 基金管理人的股东    |
| 嘉实资本管理有限公司（“嘉实资本”）                | 基金管理人的控股子公司 |
| 嘉实财富管理有限公司（“嘉实财富”）                | 基金管理人的控股子公司 |

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 7.4.10.1.4 基金交易

无。

###### 7.4.10.1.5 权证交易

无。

**7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金**

无。

**7.4.10.2 关联方报酬****7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 |
|------------------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 63,102,482.20                          | 24,244,989.32                               |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 23,751,428.55                          | 9,224,542.65                                |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 39,351,053.65                          | 15,020,446.67                               |

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.80%/当年天数。

2. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 |
|----------------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 12,269,927.12                          | 4,714,303.47                                |

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.35%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.35%/当年天数。

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

无。

**7.4.10.4 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****7.4.10.4.1 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。

**7.4.10.4.2 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。

## 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

## 7.4.10.5.2 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。

## 7.4.10.6 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<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |            | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 |            |
|---------------|----------------------------------------|------------|---------------------------------------------|------------|
|               | 期末余额                                   | 当期利息收入     | 期末余额                                        | 当期利息收入     |
| 中国银行股份有限公司_活期 | 412,180,456.24                         | 419,664.73 | 112,543,778.61                              | 168,340.63 |

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

## 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

## 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 7.4.11 利润分配情况

本期（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日），本基金未实施利润分配。

## 7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

## 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

## 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

## 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

## 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金主要投资于美国大盘成长型股票，属于主动投资的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金与混合型基金，为证券投资基金中的较高预期风险、较高预期收益的投资品种。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是主要投资于美国大盘成长型股票，在股票选择及组合构建等方面均运用量化投资方法并结合风险管理手段，力争获取长期资本增值。本基金的基金管理人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和风险管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

公司建立包括董事会、管理层、各部门及一线员工组成的四道风控防线，还有董事会风险控制与内审委员会、公司风险控制委员会、督察长及其合规管理部门、风险管理部门，评估各项风险并提出防控措施并有效执行。

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

### 7.4.13.2 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同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

基金的银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均与授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算或通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

**7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

无。

**7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

**7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

无。

**7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

无。

**7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

**7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

无。

**7.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

**7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照相关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时

变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 | 1 年以内          | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息              | 合计               |
|-------------------------|----------------|-------|-------|------------------|------------------|
| 资产                      |                |       |       |                  |                  |
| 货币资金                    | 412,180,456.24 | -     | -     | -                | 412,180,456.24   |
| 结算备付金                   | -              | -     | -     | -                | -                |
| 存出保证金                   | -              | -     | -     | -                | -                |
| 交易性金融资产                 | -              | -     | -     | 6,385,300,181.99 | 6,385,300,181.99 |
| 衍生金融资产                  | -              | -     | -     | -                | -                |
| 买入返售金融资产                | -              | -     | -     | -                | -                |
| 应收清算款                   | -              | -     | -     | -                | -                |
| 债权投资                    | -              | -     | -     | -                | -                |
| 应收股利                    | -              | -     | -     | 1,077,773.30     | 1,077,773.30     |
| 应收申购款                   | -              | -     | -     | 55,354,353.78    | 55,354,353.78    |
| 递延所得税资产                 | -              | -     | -     | -                | -                |
| 其他资产                    | -              | -     | -     | -                | -                |

|                          |                |       |       |                  |                  |
|--------------------------|----------------|-------|-------|------------------|------------------|
| 资产总计                     | 412,180,456.24 | -     | -     | 6,441,732,309.07 | 6,853,912,765.31 |
| 负债                       |                |       |       |                  |                  |
| 短期借款                     | -              | -     | -     | -                | -                |
| 交易性金融负债                  | -              | -     | -     | -                | -                |
| 衍生金融负债                   | -              | -     | -     | -                | -                |
| 卖出回购金融资产款                | -              | -     | -     | -                | -                |
| 应付清算款                    | -              | -     | -     | 28,563,029.05    | 28,563,029.05    |
| 应付赎回款                    | -              | -     | -     | 73,547,835.40    | 73,547,835.40    |
| 应付管理人报酬                  | -              | -     | -     | 9,102,578.87     | 9,102,578.87     |
| 应付托管费                    | -              | -     | -     | 1,769,945.90     | 1,769,945.90     |
| 应付销售服务费                  | -              | -     | -     | -                | -                |
| 应付投资顾问费                  | -              | -     | -     | -                | -                |
| 应交税费                     | -              | -     | -     | 77,710.84        | 77,710.84        |
| 应付利润                     | -              | -     | -     | -                | -                |
| 递延所得税负债                  | -              | -     | -     | -                | -                |
| 其他负债                     | -              | -     | -     | 427,301.42       | 427,301.42       |
| 负债总计                     | -              | -     | -     | 113,488,401.48   | 113,488,401.48   |
| 利率敏感度缺口                  | 412,180,456.24 | -     | -     | 6,328,243,907.59 | 6,740,424,363.83 |
| 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 | 1 年以内          | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息              | 合计               |
| 资产                       |                |       |       |                  |                  |
| 货币资金                     | 112,543,778.61 | -     | -     | -                | 112,543,778.61   |
| 结算备付金                    | -              | -     | -     | -                | -                |
| 存出保证金                    | -              | -     | -     | -                | -                |
| 交易性金融资产                  | -              | -     | -     | 1,391,179,240.32 | 1,391,179,240.32 |
| 衍生金融资产                   | -              | -     | -     | -                | -                |
| 买入返售金融资产                 | -              | -     | -     | -                | -                |
| 应收清算款                    | -              | -     | -     | -                | -                |
| 债权投资                     | -              | -     | -     | -                | -                |
| 应收股利                     | -              | -     | -     | 699,842.80       | 699,842.80       |
| 应收申购款                    | -              | -     | -     | 10,678,975.43    | 10,678,975.43    |
| 递延所得税资产                  | -              | -     | -     | -                | -                |
| 其他资产                     | -              | -     | -     | -                | -                |
| 资产总计                     | 112,543,778.61 | -     | -     | 1,402,558,058.55 | 1,515,101,837.16 |
| 负债                       |                |       |       |                  |                  |
| 短期借款                     | -              | -     | -     | -                | -                |
| 交易性金融负债                  | -              | -     | -     | -                | -                |
| 衍生金融负债                   | -              | -     | -     | -                | -                |
| 卖出回购金融资产款                | -              | -     | -     | -                | -                |
| 应付清算款                    | -              | -     | -     | 2,985,757.94     | 2,985,757.94     |

|         |                |   |   |                  |                  |
|---------|----------------|---|---|------------------|------------------|
| 应付赎回款   | -              | - | - | 18,222,142.55    | 18,222,142.55    |
| 应付管理人报酬 | -              | - | - | 2,238,657.55     | 2,238,657.55     |
| 应付托管费   | -              | - | - | 435,294.54       | 435,294.54       |
| 应付销售服务费 | -              | - | - | -                | -                |
| 应付投资顾问费 | -              | - | - | -                | -                |
| 应交税费    | -              | - | - | 123,123.40       | 123,123.40       |
| 应付利润    | -              | - | - | -                | -                |
| 递延所得税负债 | -              | - | - | -                | -                |
| 其他负债    | -              | - | - | 269,398.49       | 269,398.49       |
| 负债总计    | -              | - | - | 24,274,374.47    | 24,274,374.47    |
| 利率敏感度缺口 | 112,543,778.61 | - | - | 1,378,283,684.08 | 1,490,827,462.69 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                             |                        |
|----|--------------------|-----------------------------|------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                    | 本期末（2024 年 12 月 31 日）       | 上年度末（2023 年 12 月 31 日） |
|    | 市场利率上升 25 个基点      | -                           | -                      |
|    | 市场利率下降 25 个基点      | -                           | -                      |

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外币计价的资产和负债进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目       | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 |             |               |    |
|----------|-------------------------|-------------|---------------|----|
|          | 美元<br>折合人民币             | 港币<br>折合人民币 | 其他币种<br>折合人民币 | 合计 |
| 以外币计价的资产 |                         |             |               |    |

|          |                  |   |   |                  |
|----------|------------------|---|---|------------------|
| 货币资金     | 167,494,730.90   | — | — | 167,494,730.90   |
| 结算备付金    | —                | — | — | —                |
| 存出保证金    | —                | — | — | —                |
| 交易性金融资产  | 6,385,300,181.99 | — | — | 6,385,300,181.99 |
| 衍生金融资产   | —                | — | — | —                |
| 债权投资     | —                | — | — | —                |
| 应收股利     | 1,077,773.30     | — | — | 1,077,773.30     |
| 应收申购款    | 93,297.60        | — | — | 93,297.60        |
| 应收清算款    | —                | — | — | —                |
| 其他资产     | —                | — | — | —                |
| 资产合计     | 6,553,965,983.79 | — | — | 6,553,965,983.79 |
| 以外币计价的负债 |                  |   |   |                  |
| 应付清算款    | 28,563,029.05    | — | — | 28,563,029.05    |
| 衍生金融负债   | —                | — | — | —                |
| 应付赎回款    | 402,276.67       | — | — | 402,276.67       |
| 应付管理人报酬  | —                | — | — | —                |
| 应付托管费    | —                | — | — | —                |
| 应付销售服务费  | —                | — | — | —                |
| 应付投资顾问费  | —                | — | — | —                |
| 其他负债     | 1,170.34         | — | — | 1,170.34         |
| 负债合计     | 28,966,476.06    | — | — | 28,966,476.06    |

|                       |                          |             |               |                  |
|-----------------------|--------------------------|-------------|---------------|------------------|
| 资产负债表外<br>汇风险敞口净<br>额 | 6,524,999<br>,507.73     | -           | -             | 6,524,999,507.73 |
| 项目                    | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |             |               |                  |
|                       | 美元<br>折合人民<br>币          | 港币<br>折合人民币 | 其他币种<br>折合人民币 | 合计               |
| 以外币计价的<br>资产          |                          |             |               |                  |
| 货币资金                  | 56,639,34<br>2.05        | -           | -             | 56,639,342.05    |
| 结算备付金                 | -                        | -           | -             | -                |
| 存出保证金                 | -                        | -           | -             | -                |
| 交易性金融资<br>产           | 1,391,179<br>,240.32     | -           | -             | 1,391,179,240.32 |
| 衍生金融资产                | -                        | -           | -             | -                |
| 债权投资                  | -                        | -           | -             | -                |
| 应收股利                  | 699,842.8<br>0           | -           | -             | 699,842.80       |
| 应收申购款                 | 133,266.8<br>1           | -           | -             | 133,266.81       |
| 应收清算款                 | -                        | -           | -             | -                |
| 其他资产                  | -                        | -           | -             | -                |
| 资产合计                  | 1,448,651<br>,691.98     | -           | -             | 1,448,651,691.98 |
| 以外币计价的<br>负债          |                          |             |               |                  |
| 应付清算款                 | 2,985,757<br>.94         | -           | -             | 2,985,757.94     |
| 衍生金融负债                | -                        | -           | -             | -                |
| 应付赎回款                 | 437,202.6<br>1           | -           | -             | 437,202.61       |

|               |                  |   |   |                  |
|---------------|------------------|---|---|------------------|
| 应付管理人报酬       | -                | - | - | -                |
| 应付托管费         | -                | - | - | -                |
| 应付销售服务费       | -                | - | - | -                |
| 应付投资顾问费       | -                | - | - | -                |
| 其他负债          | 658.48           | - | - | 658.48           |
| 负债合计          | 3,423,619.03     | - | - | 3,423,619.03     |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | 1,445,228,072.95 | - | - | 1,445,228,072.95 |

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设 | 除汇率以外的其他市场变量保持不变 |                             |                        |
|----|------------------|-----------------------------|------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动        | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                  | 本期末（2024 年 12 月 31 日）       | 上年度末（2023 年 12 月 31 日） |
|    | 所有外币相对人民币升值 5%   | 326,249,975.39              | 72,261,403.65          |
|    | 所有外币相对人民币贬值 5%   | -326,249,975.39             | -72,261,403.65         |

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票、债券及基金，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|----|-------------------------|---------------------|
|----|-------------------------|---------------------|

|               | 公允价值             | 占基金资产净值<br>比例（%） | 公允价值             | 占基金资产净值<br>比例（%） |
|---------------|------------------|------------------|------------------|------------------|
| 交易性金融资产—股票投资  | 6,374,467,133.94 | 94.57            | 1,339,895,575.80 | 89.88            |
| 交易性金融资产—基金投资  | 10,833,048.05    | 0.16             | 51,283,664.52    | 3.44             |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | —                | —                | —                | —                |
| 衍生金融资产—权证投资   | —                | —                | —                | —                |
| 其他            | —                | —                | —                | —                |
| 合计            | 6,385,300,181.99 | 94.73            | 1,391,179,240.32 | 93.32            |

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩基准以外的其他市场变量保持不变 |                             |                        |
|----|--------------------|-----------------------------|------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                    | 本期末（2024 年 12 月 31 日）       | 上年度末（2023 年 12 月 31 日） |
|    | 业绩比较基准上升 5%        | 365,208,335.66              | 76,281,452.50          |
|    | 业绩比较基准下降 5%        | -365,208,335.66             | -76,281,452.50         |

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。                          |

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------------|--------------------------|
|---------------|-------------------------|--------------------------|

|      |                  |                  |
|------|------------------|------------------|
| 第一层次 | 6,385,300,181.99 | 1,391,179,240.32 |
| 第二层次 | —                | —                |
| 第三层次 | —                | —                |
| 合计   | 6,385,300,181.99 | 1,391,179,240.32 |

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

无。

##### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

无。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债（上年度末：无）。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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 | 6,374,467,133.94 | 93.00        |

|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
|   | 其中：普通股            | 6,234,544,735.58 | 90.96  |
|   | 存托凭证              | 139,922,398.36   | 2.04   |
|   | 优先股               | —                | —      |
|   | 房地产信托凭证           | —                | —      |
| 2 | 基金投资              | 10,833,048.05    | 0.16   |
| 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      | 412,180,456.24   | 6.01   |
| 8 | 其他各项资产            | 56,432,127.08    | 0.82   |
| 9 | 合计                | 6,853,912,765.31 | 100.00 |

## 8.2 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     | 6,374,467,133.94 | 94.57        |
| 合计     | 6,374,467,133.94 | 94.57        |

## 8.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

| 行业类别   | 公允价值             | 占基金资产净值比例（%） |
|--------|------------------|--------------|
| 信息技术   | 2,726,007,649.19 | 40.44        |
| 非必需消费品 | 1,048,821,626.87 | 15.56        |
| 通信服务   | 977,992,766.36   | 14.51        |
| 医疗保健   | 267,245,902.14   | 3.96         |
| 工业     | 377,707,186.88   | 5.60         |
| 金融     | 555,993,589.90   | 8.25         |
| 必需消费品  | 214,514,785.48   | 3.18         |
| 能源     | 57,558,673.32    | 0.85         |
| 原材料    | 48,168,110.59    | 0.71         |
| 公用事业   | 93,268,184.93    | 1.38         |
| 房地产    | 7,188,658.28     | 0.11         |
| 合计     | 6,374,467,133.94 | 94.57        |

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

## 8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称<br>(英文)          | 公司名称<br>(中文)  | 证券代<br>码 | 所在证<br>券市场        | 所属<br>国家<br>(地区) | 数量<br>(股) | 公允价值           | 占基<br>金资<br>产净<br>值比<br>例(%) |
|----|-----------------------|---------------|----------|-------------------|------------------|-----------|----------------|------------------------------|
| 1  | Apple Inc             | 苹果公司          | AAPL UW  | 纳斯达克<br>证券<br>交易所 | 美国               | 328,828   | 591,929,572.62 | 8.78                         |
| 2  | NVIDIA Corp           | 英伟达           | NVDA UW  | 纳斯达克<br>证券<br>交易所 | 美国               | 517,842   | 499,888,540.07 | 7.42                         |
| 3  | Alphabet Inc          | Alphabet 公司   | GOOGL UW | 纳斯达克<br>证券<br>交易所 | 美国               | 183,648   | 249,901,609.11 | 3.71                         |
| 3  | Alphabet Inc          | Alphabet 公司   | GOOG UW  | 纳斯达克<br>证券<br>交易所 | 美国               | 131,297   | 179,740,196.17 | 2.67                         |
| 4  | Amazon.com Inc        | 亚马逊公司         | AMZN UW  | 纳斯达克<br>证券<br>交易所 | 美国               | 267,336   | 421,605,734.49 | 6.25                         |
| 5  | Microsoft Corp        | 微软            | MSFT UW  | 纳斯达克<br>证券<br>交易所 | 美国               | 125,188   | 379,308,448.19 | 5.63                         |
| 6  | Meta Platforms Inc    | Meta 平台股份有限公司 | META UW  | 纳斯达克<br>证券<br>交易所 | 美国               | 67,566    | 284,377,191.76 | 4.22                         |
| 7  | Tesla Inc             | 特斯拉公司         | TSLA UW  | 纳斯达克<br>证券<br>交易所 | 美国               | 83,263    | 241,709,446.24 | 3.59                         |
| 8  | Broadcom Inc          | 博通股份有限公司      | AVGO UW  | 纳斯达克<br>证券<br>交易所 | 美国               | 144,647   | 241,062,709.91 | 3.58                         |
| 9  | Netflix Inc           | 奈飞公司          | NFLX UW  | 纳斯达克<br>证券<br>交易所 | 美国               | 16,629    | 106,544,741.60 | 1.58                         |
| 10 | Eli Lilly & Co        | 礼来            | LLY UN   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国               | 19,026    | 105,583,736.76 | 1.57                         |
| 11 | Costco Wholesale Corp | 开市客           | COST UW  | 纳斯达克<br>证券<br>交易所 | 美国               | 14,461    | 95,247,597.29  | 1.41                         |

|    |                                           |                     |         |           |    |         |               |      |
|----|-------------------------------------------|---------------------|---------|-----------|----|---------|---------------|------|
| 12 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | 台湾集成电路制造股份有限公司      | TSM UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 55,066  | 78,173,737.43 | 1.16 |
| 13 | Palantir Technologies Inc                 | Palantir 科技股份有限公司   | PLTR UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 114,785 | 62,403,862.96 | 0.93 |
| 14 | Salesforce Inc                            | Salesforce 股份有限公司   | CRM UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 25,812  | 62,033,922.09 | 0.92 |
| 15 | GE Vernova Inc                            | 通用电气 Vernova 股份有限公司 | GEV UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 23,478  | 55,513,271.11 | 0.82 |
| 16 | Mastercard Inc                            | 万事达股份有限公司           | MA UN   | 纽约证券交易所   | 美国 | 14,291  | 54,094,233.01 | 0.80 |
| 17 | Oracle Corp                               | 甲骨文                 | ORCL UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 40,385  | 48,376,180.91 | 0.72 |
| 18 | ServiceNow Inc                            | ServiceNow 公司       | NOW UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 5,940   | 45,266,165.65 | 0.67 |
| 19 | AppLovin Corp                             | AppLovin 公司         | APP UW  | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 16,581  | 38,597,576.32 | 0.57 |
| 20 | Intuitive Surgical Inc                    | 直觉外科手术公司            | ISRG UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 10,172  | 38,165,926.49 | 0.57 |
| 21 | Vertiv Holdings Co                        | 维谛技术                | VRT UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 44,693  | 36,499,616.62 | 0.54 |
| 22 | Arista Networks Inc                       | Arista 网络股份有限公司     | ANET UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 45,558  | 36,197,373.23 | 0.54 |
| 23 | GoDaddy Inc                               | GoDaddy 股份有限公司      | GDDY UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 24,457  | 34,698,968.14 | 0.51 |

|    |                         | 司                          |         |           |    |         |               |      |
|----|-------------------------|----------------------------|---------|-----------|----|---------|---------------|------|
| 24 | QUALCOMM Inc            | 高通公司                       | QCOM UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 31,382  | 34,654,577.98 | 0.51 |
| 25 | Walmart Inc             | 沃尔玛股份有限公司                  | WMT UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 53,115  | 34,496,702.09 | 0.51 |
| 26 | Marvell Technology Inc  | 美满电子科技公司                   | MRVL UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 42,556  | 33,787,709.84 | 0.50 |
| 27 | Deckers Outdoor Corp    | 德克斯户外用品公司                  | DECK UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 22,586  | 32,973,124.24 | 0.49 |
| 28 | Visa Inc                | 维萨公司                       | V UN    | 纽约证券交易所   | 美国 | 12,158  | 27,620,811.10 | 0.41 |
| 29 | SAP SE                  | SAP 公司                     | SAP UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 15,590  | 27,592,054.48 | 0.41 |
| 30 | Booking Holdings Inc    | Booking 控股股份有限公司           | BKNG UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 723     | 25,821,938.01 | 0.38 |
| 31 | Fox Corp                | 福克斯公司                      | FOX UW  | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 57,974  | 19,061,701.40 | 0.28 |
| 31 | Fox Corp                | 福克斯公司                      | FOXA UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 17,423  | 6,084,328.90  | 0.09 |
| 32 | AT&T Inc                | 美国电话电报公司                   | T UN    | 纽约证券交易所   | 美国 | 151,799 | 24,846,440.28 | 0.37 |
| 33 | American Express Co     | 美国运通                       | AXP UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 11,390  | 24,299,941.24 | 0.36 |
| 34 | Lululemon Athletica Inc | Lululemon Athletica 股份有限公司 | LULU UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 8,440   | 23,200,851.41 | 0.34 |
| 35 | Vistra Corp             | Vistra 公司                  | VST UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 23,356  | 23,147,307.32 | 0.34 |

|    |                             |                           |          |           |    |        |               |      |
|----|-----------------------------|---------------------------|----------|-----------|----|--------|---------------|------|
| 36 | Lam Research Corp           | 泛林集团                      | LRCX UW  | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 43,907 | 22,797,310.52 | 0.34 |
| 37 | Celestica Inc               | 天弘股份有限公司                  | CLS UN   | 纽约证券交易所   | 美国 | 33,463 | 22,202,343.12 | 0.33 |
| 38 | Spotify Technology SA       | Spotify 科技股份有限公司          | SPOT UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 6,767  | 21,762,309.23 | 0.32 |
| 39 | Blackstone Inc              | 黑石集团股份有限公司                | BX UN    | 纽约证券交易所   | 美国 | 17,351 | 21,505,244.57 | 0.32 |
| 40 | Berkshire Hathaway Inc      | 伯克希尔哈撒韦公司                 | BRK/B UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 6,462  | 21,055,509.09 | 0.31 |
| 41 | Progressive Corp/The        | 前进保险公司                    | PGR UN   | 纽约证券交易所   | 美国 | 12,104 | 20,848,081.19 | 0.31 |
| 42 | PayPal Holdings Inc         | Paypal 控股股份有限公司           | PYPL UW  | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 31,097 | 19,078,940.54 | 0.28 |
| 43 | Goldman Sachs Group Inc/The | 高盛                        | GS UN    | 纽约证券交易所   | 美国 | 4,631  | 19,062,222.27 | 0.28 |
| 44 | Virtu Financial Inc         | Virtu 金融股份有限公司            | VIRT UW  | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 72,154 | 18,506,210.31 | 0.27 |
| 45 | Palo Alto Networks Inc      | Palo Alto Networks 股份有限公司 | PANW UW  | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 13,982 | 18,288,473.67 | 0.27 |
| 46 | NRG Energy Inc              | NRG 能源股份有限公司              | NRG UN   | 纽约证券交易所   | 美国 | 27,464 | 17,811,432.47 | 0.26 |
| 47 | Fortinet Inc                | Fortinet 股份有限公司           | FTNT UW  | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 25,750 | 17,488,370.82 | 0.26 |

|    |                         | 司                      |         |           |    |        |               |      |
|----|-------------------------|------------------------|---------|-----------|----|--------|---------------|------|
| 48 | TJX Cos Inc/The         | TJX 公司                 | TJX UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 19,891 | 17,273,953.14 | 0.26 |
| 49 | Kroger Co/The           | 克罗格公司                  | KR UN   | 纽约证券交易所   | 美国 | 38,981 | 17,134,903.90 | 0.25 |
| 50 | Manulife Financial Corp | 宏利金融                   | MFC UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 74,441 | 16,433,279.83 | 0.24 |
| 51 | KKR & Co Inc            | KKR & Co 有限公司          | KKR UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 15,347 | 16,317,486.64 | 0.24 |
| 52 | Flex Ltd                | 伟创力国际有限公司              | FLEX UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 57,055 | 15,745,050.48 | 0.23 |
| 53 | NetApp Inc              | 美国网域存储技术有限公司           | NTAP UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 18,859 | 15,736,505.41 | 0.23 |
| 54 | Axon Enterprise Inc     | Axon Enterprise 股份有限公司 | AXON UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 3,589  | 15,332,961.29 | 0.23 |
| 55 | Pegasystems Inc         | Pegasystems 股份有限公司     | PEGA UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 22,863 | 15,317,269.87 | 0.23 |
| 56 | Howmet Aerospace Inc    | Howmet 航空航天股份有限公司      | HWM UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 18,620 | 14,638,956.63 | 0.22 |
| 57 | Twilio Inc              | Twilio 股份有限公司          | TWLO UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 18,012 | 13,993,923.96 | 0.21 |
| 58 | Williams-Sonoma Inc     | Williams-Sonoma 股份有限公司 | WSM UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 10,170 | 13,537,774.27 | 0.20 |
| 59 | Amphenol                | 安费诺                    | APH UN  | 纽约证       | 美国 | 26,875 | 13,416,923.96 | 0.20 |

|    | Corp                       | 公司                 |          | 券交易<br>所  |    |        |               |      |
|----|----------------------------|--------------------|----------|-----------|----|--------|---------------|------|
| 60 | Cadence Design Systems Inc | Cadence 设计系统股份有限公司 | CDNS UW  | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 6,178  | 13,343,409.13 | 0.20 |
| 61 | DocuSign Inc               | DocuSign 股份有限公司    | DOCU UW  | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 19,792 | 12,796,016.78 | 0.19 |
| 62 | DoorDash Inc               | DoorDash 股份有限公司    | DASH UW  | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 10,574 | 12,750,701.25 | 0.19 |
| 63 | Motorola Solutions Inc     | 摩托罗拉解决方案股份有限公司     | MSI UN   | 纽约证券交易所   | 美国 | 3,834  | 12,739,209.30 | 0.19 |
| 64 | EMCOR Group Inc            | 埃姆科集团公司            | EME UN   | 纽约证券交易所   | 美国 | 3,882  | 12,666,246.90 | 0.19 |
| 65 | KLA Corp                   | KLA 公司             | KLAC UW  | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 2,793  | 12,651,046.02 | 0.19 |
| 66 | Tencent Holdings Ltd       | 腾讯控股有限公司           | TCEHY UV | 纽约证券交易所   | 美国 | 32,676 | 12,491,352.26 | 0.19 |
| 67 | Trade Desk Inc/The         | Trade Desk 股份有限公司  | TTD UQ   | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 14,638 | 12,366,953.12 | 0.18 |
| 68 | Victoria's Secret & Co     | 维多利亚的秘密            | VSCO UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 41,475 | 12,348,912.82 | 0.18 |
| 69 | Eaton Corp PLC             | 伊顿                 | ETN UN   | 纽约证券交易所   | 美国 | 5,151  | 12,288,299.30 | 0.18 |
| 70 | Home Depot Inc/The         | 家得宝                | HD UN    | 纽约证券交易所   | 美国 | 4,381  | 12,250,221.05 | 0.18 |
| 71 | Applied Materials          | 应用材料               | AMAT UW  | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 10,348 | 12,097,324.14 | 0.18 |

|    | Inc                       |                        |         | 交易所       |    |        |               |      |
|----|---------------------------|------------------------|---------|-----------|----|--------|---------------|------|
| 72 | Build-A-Bear Workshop Inc | 金泰迪工作室股份有限公司           | BBW UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 36,349 | 12,029,844.62 | 0.18 |
| 73 | Plexus Corp               | Plexus 有限公司            | PLXS UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 10,601 | 11,924,437.66 | 0.18 |
| 74 | Pure Storage Inc          | Pure 储存股份有限公司          | PSTG UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 26,812 | 11,839,734.44 | 0.18 |
| 75 | Excele rate Energy Inc    | Excele rate Energy Inc | EE UN   | 纽约证券交易所   | 美国 | 52,461 | 11,407,597.24 | 0.17 |
| 76 | Trip.com Group Ltd        | 携程集团有限公司               | TCOM UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 22,953 | 11,328,580.40 | 0.17 |
| 77 | Kinder Morgan Inc         | 特拉华州金德摩根公司             | KMI UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 57,312 | 11,288,295.31 | 0.17 |
| 78 | InterDigi tal Inc         | InterD igital 股份有限公司   | IDCC UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 7,665  | 10,673,794.94 | 0.16 |
| 79 | General Electric Co       | 通用电气航空 航天              | GE UN   | 纽约证券交易所   | 美国 | 8,661  | 10,384,133.98 | 0.15 |
| 80 | Expedia Group Inc         | 亿客行集团股份有限公司            | EXPE UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 7,708  | 10,324,207.52 | 0.15 |
| 81 | Dick's Sporting Goods Inc | 迪克体育用品股份有限公司           | DKS UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 6,182  | 10,169,349.54 | 0.15 |
| 82 | AbbVie Inc                | 艾伯维股份有限公司              | ABBV UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 7,959  | 10,166,656.91 | 0.15 |
| 83 | Doximity Inc              | Doximi ty Inc          | DOCS UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 26,377 | 10,123,193.91 | 0.15 |

|    |                                    |                                    |         |           |    |        |               |      |
|----|------------------------------------|------------------------------------|---------|-----------|----|--------|---------------|------|
| 84 | Trane Technologies PLC             | 特灵科技公共有限公司                         | TT UN   | 纽约证券交易所   | 美国 | 3,808  | 10,110,375.34 | 0.15 |
| 85 | Carpenter Technology Corp          | 卡朋特科技公司                            | CRS UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 8,215  | 10,021,834.74 | 0.15 |
| 86 | T-Mobile US Inc                    | T-Mobile US 股份有限公司                 | TMUS UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 6,265  | 9,940,647.51  | 0.15 |
| 87 | Bank of America Corp               | 美国银行公司                             | BAC UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 31,463 | 9,940,111.25  | 0.15 |
| 88 | eBay Inc                           | eBay 股份有限公司                        | EBAY UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 22,125 | 9,852,735.53  | 0.15 |
| 89 | Credo Technology Group Holding Ltd | Credo Technology Group Holding Ltd | CRDO UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 20,349 | 9,831,260.48  | 0.15 |
| 90 | Uber Technologies Inc              | 优步技术股份有限公司                         | UBER UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 22,540 | 9,773,440.65  | 0.14 |
| 91 | F5 Inc                             | F5 股份有限公司                          | FFIV UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 5,376  | 9,718,017.51  | 0.14 |
| 92 | Royal Caribbean Cruises Ltd        | 皇家加勒比国际游轮有限公司                      | RCL UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 5,851  | 9,702,666.47  | 0.14 |
| 93 | Autodesk Inc                       | 欧特克                                | ADSK UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 4,551  | 9,669,397.69  | 0.14 |
| 94 | Q2 Holdings Inc                    | Q2 控股股份有限公司                        | QTWO UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 13,307 | 9,627,780.31  | 0.14 |
| 95 | Honeywell Inter                    | 霍尼韦尔                               | HON UW  | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 5,832  | 9,469,929.73  | 0.14 |

|     |                                                      |                                                |             |                   |    |        |              |      |
|-----|------------------------------------------------------|------------------------------------------------|-------------|-------------------|----|--------|--------------|------|
|     | national<br>Inc                                      |                                                |             | 交易所               |    |        |              |      |
| 96  | Apollo Global<br>Management Inc                      | 阿波罗<br>全球管<br>理股份<br>有限公<br>司                  | APO UN      | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 7,975  | 9,468,208.25 | 0.14 |
| 97  | Liberty<br>Media<br>Corp-Libe<br>rty Form<br>ula One | Libert<br>y 传媒<br>公司<br>-Liber<br>ty 一级<br>方程式 | FWONK<br>UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 10,729 | 7,146,341.68 | 0.11 |
| 97  | Liberty<br>Media<br>Corp-Libe<br>rty Form<br>ula One | Libert<br>y 传媒<br>公司<br>-Liber<br>ty 一级<br>方程式 | FWONA<br>UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 3,808  | 2,300,462.82 | 0.03 |
| 98  | HubSpot<br>Inc                                       | HubSpo<br>t 公司                                 | HUBS UN     | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,837  | 9,200,911.12 | 0.14 |
| 99  | Wells<br>Fargo & Co                                  | 富国银<br>行                                       | WFC UN      | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 18,194 | 9,186,391.05 | 0.14 |
| 100 | Ubiquiti<br>Inc                                      | Ubiqui<br>ti 股份<br>有限公<br>司                    | UI UN       | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 3,794  | 9,052,657.05 | 0.13 |
| 101 | Capital<br>One Fina<br>ncial<br>Corp                 | 第一资<br>本金融                                     | COF UN      | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 6,970  | 8,934,393.35 | 0.13 |
| 102 | Ameripris<br>e Financ<br>ial Inc                     | 阿默普<br>莱斯金<br>融公司                              | AMP UN      | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 2,333  | 8,929,137.12 | 0.13 |
| 103 | JPMorgan<br>Chase<br>& Co                            | 摩根大<br>通                                       | JPM UN      | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 5,177  | 8,920,651.07 | 0.13 |
| 104 | Tapestry<br>Inc                                      | TPR-DR<br>S-RS                                 | TPR UN      | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 18,981 | 8,913,822.52 | 0.13 |
| 105 | Freshpet<br>Inc                                      | Freshp<br>et 公司                                | FRPT UQ     | 纳斯达<br>克证券        | 美国 | 8,314  | 8,851,699.00 | 0.13 |

|     |                                               |                               |         | 交易所       |    |        |              |      |
|-----|-----------------------------------------------|-------------------------------|---------|-----------|----|--------|--------------|------|
| 106 | Applied Industrial Technologies Inc           | 应用工业技术公司                      | AIT UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 5,138  | 8,844,584.79 | 0.13 |
| 107 | Boston Scientific Corp                        | 波士顿科学                         | BSX UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 13,688 | 8,788,625.25 | 0.13 |
| 108 | Cal-Maine Foods Inc                           | Cal-Maine 食品股份有限公司            | CALM UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 11,695 | 8,652,313.35 | 0.13 |
| 109 | Chipotle Mexican Grill Inc                    | Chipotle Mexican Grill 股份有限公司 | CMG UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 19,708 | 8,542,639.93 | 0.13 |
| 110 | McKesson Corp                                 | McKesson 公司                   | MCK UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 2,035  | 8,336,868.02 | 0.12 |
| 111 | Constellation Energy Corp                     | 美国联合能源公司                      | CEG UW  | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 5,177  | 8,325,221.52 | 0.12 |
| 112 | Banco Latinoamericano de Comercio Exterior SA | 拉美出口银行                        | BLX UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 32,546 | 8,321,731.91 | 0.12 |
| 113 | Altria Group Inc                              | 高特利                           | MO UN   | 纽约证券交易所   | 美国 | 22,005 | 8,271,271.00 | 0.12 |
| 114 | Automatic Data Processing Inc                 | ADP 公司                        | ADP UW  | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 3,838  | 8,076,151.15 | 0.12 |
| 115 | State Street Corp                             | 道富集团                          | STT UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 11,395 | 8,039,644.94 | 0.12 |
| 11  | Norwegian                                     | 挪威邮                           | NCLH UN | 纽约证       | 美国 | 42,895 | 7,933,753.34 | 0.12 |

|     |                                      |                          |         |           |    |        |              |      |
|-----|--------------------------------------|--------------------------|---------|-----------|----|--------|--------------|------|
| 6   | Cruise Line Holdings Ltd             | 轮控股有限公司                  |         | 券交易所      |    |        |              |      |
| 117 | Advanced Micro Devices Inc           | AMD 公司                   | AMD UW  | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 9,087  | 7,890,122.48 | 0.12 |
| 118 | MasTec Inc                           | MasTec 股份有限公司            | MTZ UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 8,000  | 7,829,030.21 | 0.12 |
| 119 | SoFi Technologies Inc                | SoFi Technologies 股份有限公司 | SOFI UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 70,526 | 7,807,324.12 | 0.12 |
| 120 | Allison Transmission Holdings Inc    | 艾里逊变速箱控股公司               | ALSN UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 9,652  | 7,497,466.12 | 0.11 |
| 121 | Wix.com Ltd                          | Wix.com 有限公司             | WIX UW  | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 4,737  | 7,305,738.77 | 0.11 |
| 122 | International Business Machines Corp | 国际商业机器公司                 | IBM UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 4,578  | 7,234,274.50 | 0.11 |
| 123 | Sherwin-Williams Co/The              | 宣伟公司                     | SHW UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 2,946  | 7,198,706.58 | 0.11 |
| 124 | CBRE Group Inc                       | 世邦魏理仕                    | CBRE UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 7,617  | 7,188,658.28 | 0.11 |
| 125 | CrowdStrike Holdings Inc             | CrowdStrike 控股股份有限公司     | CRWD UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 2,898  | 7,127,871.37 | 0.11 |
| 126 | Shopify Inc                          | Shopify 股份有限公司           | SHOP UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 9,316  | 7,120,615.40 | 0.11 |

|     |                               |                   |         |           |    |        |              |      |
|-----|-------------------------------|-------------------|---------|-----------|----|--------|--------------|------|
| 127 | Cheniere Energy Inc           | Cheniere 能源股份有限公司 | LNG UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 4,496  | 6,944,393.50 | 0.10 |
| 128 | Brinker International Inc     | Brinker 国际股份有限公司  | EAT UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 7,290  | 6,932,450.55 | 0.10 |
| 129 | Burlington Stores Inc         | 伯灵顿商店股份有限公司       | BURL UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 3,371  | 6,907,601.40 | 0.10 |
| 130 | Pentair PLC                   | Pentair 公共有限公司    | PNR UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 9,544  | 6,904,516.86 | 0.10 |
| 131 | Caterpillar Inc               | 卡特彼勒              | CAT UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 2,647  | 6,902,486.57 | 0.10 |
| 132 | Abercrombie & Fitch Co        | 阿贝克隆比&费奇公司        | ANF UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 6,297  | 6,765,812.58 | 0.10 |
| 133 | Unum Group                    | 尤纳姆集团             | UNM UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 12,879 | 6,761,073.84 | 0.10 |
| 134 | RTX Corp                      | RTX 公司            | RTX UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 8,120  | 6,754,554.18 | 0.10 |
| 135 | Entergy Corp                  | Entergy 公司        | ETR UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 12,374 | 6,744,133.01 | 0.10 |
| 136 | Grindr Inc                    | Grindr Inc        | GRND UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 52,492 | 6,731,629.51 | 0.10 |
| 137 | Interactive Brokers Group Inc | 盈透证券集团股份有限公司      | IBKR UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 5,292  | 6,720,705.73 | 0.10 |
| 138 | Fair Isaac Corp               | 费埃哲公司             | FICO UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 467    | 6,683,517.77 | 0.10 |
| 139 | Chubb Ltd                     | 邱博保险集团            | CB UN   | 纽约证券交易所   | 美国 | 3,364  | 6,681,425.15 | 0.10 |

|     |                               |                        |         |           |    |        |              |      |
|-----|-------------------------------|------------------------|---------|-----------|----|--------|--------------|------|
|     |                               |                        |         | 所         |    |        |              |      |
| 140 | Datadog Inc                   | Datadog 股份有限公司         | DDOG UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 6,494  | 6,670,315.19 | 0.10 |
| 141 | TKO Group Holdings Inc        | TKO Group Holdings Inc | TKO UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 6,520  | 6,660,463.78 | 0.10 |
| 142 | United Therapeutics Corp      | 联合治疗公司                 | UTHR UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 2,620  | 6,645,250.25 | 0.10 |
| 143 | Mueller Industries Inc        | 美乐工业有限公司               | MLI UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 11,579 | 6,605,488.62 | 0.10 |
| 144 | Live Nation Entertainment Inc | Live Nation 娱乐公司       | LYV UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 7,054  | 6,566,553.08 | 0.10 |
| 145 | Axis Capital Holdings Ltd     | 阿克西斯资本控股有限公司           | AXS UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 10,217 | 6,508,596.89 | 0.10 |
| 146 | Alaska Air Group Inc          | 阿拉斯加航空集团               | ALK UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 13,553 | 6,308,228.94 | 0.09 |
| 147 | Allstate Corp/The             | 好事达保险公司                | ALL UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 4,470  | 6,194,756.81 | 0.09 |
| 148 | Williams Cos Inc/The          | 威廉姆斯公司                 | WMB UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 15,764 | 6,132,766.78 | 0.09 |
| 149 | Amer Sports Inc               | Amer Sports Inc        | AS UN   | 纽约证券交易所   | 美国 | 30,443 | 6,118,667.46 | 0.09 |
| 150 | Frontdoor Inc                 | Frontdoor 股份有限公司       | FTDR UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 15,456 | 6,074,050.78 | 0.09 |
| 151 | Planet Fitness Inc            | Planet Fitness 股份      | PLNT UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 8,484  | 6,029,723.94 | 0.09 |

|         |                                    |                                 |         |                   |    |        |              |      |
|---------|------------------------------------|---------------------------------|---------|-------------------|----|--------|--------------|------|
|         |                                    | 有限公司                            |         |                   |    |        |              |      |
| 15<br>2 | Synchrony<br>Financial             | 同步金融公司                          | SYF UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 12,884 | 6,019,997.46 | 0.09 |
| 15<br>3 | Fiserv<br>Inc                      | Fiserv<br>公司                    | FI UN   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 4,044  | 5,971,536.72 | 0.09 |
| 15<br>4 | Morgan<br>Stanley                  | 摩根士<br>丹利                       | MS UN   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 6,604  | 5,968,204.18 | 0.09 |
| 15<br>5 | SkyWest<br>Inc                     | SkyWes<br>t 股份<br>有限公司          | SKYW UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 8,256  | 5,942,458.21 | 0.09 |
| 15<br>6 | Ares<br>Managemen<br>t Corp        | 阿瑞斯<br>管理公<br>司                 | ARES UN | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 4,652  | 5,919,960.53 | 0.09 |
| 15<br>7 | Natera<br>Inc                      | Natera<br>股份有<br>限公司            | NTRA UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 5,100  | 5,803,410.97 | 0.09 |
| 15<br>8 | Ralph<br>Lauren<br>Corp            | 拉夫劳<br>伦                        | RL UN   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 3,491  | 5,796,374.82 | 0.09 |
| 15<br>9 | Kyndryl<br>Holdings<br>Inc         | Kyndry<br>l<br>Holdin<br>gs Inc | KD UN   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 23,271 | 5,787,931.47 | 0.09 |
| 16<br>0 | Sea Ltd                            | Sea 有<br>限公司                    | SE UN   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 7,491  | 5,713,305.10 | 0.08 |
| 16<br>1 | Atlassian<br>Corp                  | Atlass<br>ian<br>Corp           | TEAM UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 3,203  | 5,603,689.47 | 0.08 |
| 16<br>2 | Comfort<br>Systems<br>USA Inc<br>c | 美国舒<br>适系统<br>公司                | FIX UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,821  | 5,550,977.80 | 0.08 |
| 16<br>3 | Commvault<br>Systems<br>Inc        | CommVa<br>ult 系<br>统股份<br>有限公司  | CVLT UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 5,093  | 5,524,893.75 | 0.08 |
| 16      | Hilton W                           | 希尔顿                             | HLT UN  | 纽约证               | 美国 | 3,103  | 5,513,053.38 | 0.08 |

|         |                                                            |                                           |         |                   |    |        |              |      |
|---------|------------------------------------------------------------|-------------------------------------------|---------|-------------------|----|--------|--------------|------|
| 4       | orldwide<br>Holdi<br>ngs Inc                               | 全球控<br>股股份<br>有限公<br>司                    |         | 券交易<br>所          |    |        |              |      |
| 16<br>5 | Altair E<br>ngineerin<br>g Inc                             | Altair En<br>gineerin<br>g 股份<br>有限公<br>司 | ALTR UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 7,029  | 5,513,029.73 | 0.08 |
| 16<br>6 | DaVita<br>Inc                                              | DaVita<br>股份有<br>限公司                      | DVA UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 5,086  | 5,467,578.27 | 0.08 |
| 16<br>7 | Pinnacle<br>West C<br>apital<br>Corp                       | Pinnac<br>le 西部<br>资本                     | PNW UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 8,944  | 5,450,121.81 | 0.08 |
| 16<br>8 | BILL<br>Holdings<br>Inc                                    | Bill 控<br>股股份<br>有限公<br>司                 | BILL UN | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 8,945  | 5,446,873.16 | 0.08 |
| 16<br>9 | Coca-Cola<br>Conso<br>lidated<br>Inc                       | 可口可<br>乐装瓶<br>有限公<br>司                    | COKE UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 592    | 5,361,928.77 | 0.08 |
| 17<br>0 | Primo<br>Brands<br>Corp                                    | Primo<br>Brands<br>Corp                   | PRMB UN | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 23,881 | 5,282,168.37 | 0.08 |
| 17<br>1 | Glaukos<br>Corp                                            | Glauko<br>s 公司                            | GKOS UN | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 4,838  | 5,214,535.23 | 0.08 |
| 17<br>2 | O'Reilly<br>Automot<br>ive Inc                             | O'Reil<br>ly 汽车<br>股份有<br>限公司             | ORLY UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 610    | 5,199,642.88 | 0.08 |
| 17<br>3 | UGI Corp                                                   | UGI 公<br>司                                | UGI UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 25,587 | 5,192,332.35 | 0.08 |
| 17<br>4 | Westingho<br>use Air<br>Brake<br>Technol<br>ogies Co<br>rp | 西屋制<br>动公司                                | WAB UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 3,803  | 5,182,913.82 | 0.08 |
| 17      | Urban                                                      | Urban                                     | URBN UW | 纳斯达               | 美国 | 13,020 | 5,136,382.08 | 0.08 |

|         |                                            |                               |         |                   |    |        |              |      |
|---------|--------------------------------------------|-------------------------------|---------|-------------------|----|--------|--------------|------|
| 5       | Outfitter<br>s Inc                         | Ou<br>tfitte<br>rs 股份<br>有限公司 |         | 克证券<br>交易所        |    |        |              |      |
| 17<br>6 | Packaging<br>Corp o<br>f Amer<br>ica       | 美国包<br>装公司                    | PKG UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 3,145  | 5,089,630.53 | 0.08 |
| 17<br>7 | Internati<br>onal Pap<br>er Co             | 国际纸<br>业                      | IP UN   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 13,137 | 5,082,438.46 | 0.08 |
| 17<br>8 | Cloudflar<br>e Inc                         | Cloudf<br>lare 股份<br>有限公司     | NET UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 6,516  | 5,043,689.68 | 0.07 |
| 17<br>9 | Knife<br>River<br>Corp                     | Knife<br>River<br>Corp        | KNF UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 6,887  | 5,031,841.76 | 0.07 |
| 18<br>0 | Willis T<br>owers Wa<br>tson P<br>LC       | 韦莱韬<br>睿惠悦<br>公共有<br>限公司      | WTW UW  | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 2,225  | 5,010,020.08 | 0.07 |
| 18<br>1 | Philip M<br>orris<br>Internati<br>onal Inc | 菲利普<br>莫里斯<br>国际集<br>团公司      | PM UN   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 5,769  | 4,990,900.01 | 0.07 |
| 18<br>2 | NiSource<br>Inc                            | NiSour<br>ce 公<br>司           | NI UN   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 18,877 | 4,988,163.89 | 0.07 |
| 18<br>3 | Garmin<br>Ltd                              | 佳明有<br>限公司                    | GRMN UN | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 3,359  | 4,980,320.05 | 0.07 |
| 18<br>4 | Stryker<br>Corp                            | 史赛克                           | SYK UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,921  | 4,971,900.35 | 0.07 |
| 18<br>5 | Ecolab<br>Inc                              | 艺康集<br>团                      | ECL UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 2,919  | 4,916,722.41 | 0.07 |
| 18<br>6 | Gilead<br>Sciences<br>Inc                  | 吉利德<br>科学                     | GILD UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 7,371  | 4,894,288.78 | 0.07 |
| 18<br>7 | Citigroup<br>Inc                           | 花旗集<br>团                      | C UN    | 纽约证<br>券交易        | 美国 | 9,479  | 4,796,293.20 | 0.07 |

|     |                                |                                |         | 所         |    |       |              |      |
|-----|--------------------------------|--------------------------------|---------|-----------|----|-------|--------------|------|
| 188 | Esquire Financial Holdings Inc | Esquire Financial Holdings Inc | ESQ UR  | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 8,202 | 4,687,260.92 | 0.07 |
| 189 | Kontoor Brands Inc             | Kontoor Brands Inc             | KTB UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 7,626 | 4,682,068.45 | 0.07 |
| 190 | Itron Inc                      | 爱拓利公司                          | ITRI UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 5,998 | 4,681,537.80 | 0.07 |
| 191 | Jabil Inc                      | 捷普集团                           | JBL UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 4,497 | 4,651,745.19 | 0.07 |
| 192 | RadNet Inc                     | RadNet 股份有限公司                  | RDNT UQ | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 9,222 | 4,629,793.11 | 0.07 |
| 193 | Electronic Arts Inc            | 电子艺界                           | EA UW   | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 4,383 | 4,609,438.58 | 0.07 |
| 194 | Masimo Corp                    | Masimo 公司                      | MASI UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 3,864 | 4,591,369.10 | 0.07 |
| 195 | Lennox International Inc       | 雷诺士国际有限公司                      | LII UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 1,043 | 4,568,227.48 | 0.07 |
| 196 | Intapp Inc                     | Intapp Inc                     | INTA UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 9,788 | 4,509,376.19 | 0.07 |
| 197 | Astera Labs Inc                | Astera Labs Inc                | ALAB UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 4,719 | 4,492,976.79 | 0.07 |
| 198 | Quanta Services Inc            | Quanta 服务股份有限公司                | PWR UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 1,977 | 4,491,534.08 | 0.07 |
| 199 | Ulta Salon Cosmetics & Fragra  | Ulta 美容产品公司                    | ULTA UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,434 | 4,483,330.46 | 0.07 |

|     |                                   |                        |         |           |    |        |              |      |
|-----|-----------------------------------|------------------------|---------|-----------|----|--------|--------------|------|
|     | nce Inc                           |                        |         |           |    |        |              |      |
| 200 | Raymond James Financial Inc       | Raymond James 金融股份有限公司 | RJF UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 3,969  | 4,431,682.89 | 0.07 |
| 201 | 3M Co                             | 3M 公司                  | MMM UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 4,774  | 4,430,035.95 | 0.07 |
| 202 | Citizens Financial Group Inc      | 公民金融集团股份有限公司           | CFG UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 14,075 | 4,427,493.70 | 0.07 |
| 203 | Bank of New York Mellon Corp /The | 纽约梅隆银行                 | BK UN   | 纽约证券交易所   | 美国 | 7,978  | 4,406,127.91 | 0.07 |
| 204 | CSW Industrials Inc               | CSW 工业股份有限公司           | CSWI UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,723  | 4,369,644.34 | 0.06 |
| 205 | Enova International Inc           | Enova International 公司 | ENVA UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 6,274  | 4,324,190.07 | 0.06 |
| 206 | Invesco Ltd                       | 景顺有限公司                 | IVZ UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 33,996 | 4,271,707.28 | 0.06 |
| 207 | Dropbox Inc                       | Dropbox 股份有限公司         | DBX UW  | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 19,709 | 4,255,952.32 | 0.06 |
| 208 | ONEOK Inc                         | Oneok 股份有限公司           | OKE UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 5,886  | 4,248,016.61 | 0.06 |
| 209 | Piper Sandler Cos                 | Piper Sandler 公司       | PIPR UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 1,966  | 4,239,011.70 | 0.06 |
| 210 | Insulet Corp                      | Insulet 股份有限公司         | PODD UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 2,258  | 4,237,533.48 | 0.06 |

|         |                                      |                                                      |         |                   |    |        |              |      |
|---------|--------------------------------------|------------------------------------------------------|---------|-------------------|----|--------|--------------|------|
| 21<br>1 | Houlihan<br>Lokey Inc                | 华利安<br>股份有<br>限公司                                    | HLI UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 3,379  | 4,218,132.56 | 0.06 |
| 21<br>2 | Snowflake<br>Inc                     | Snowfl<br>ake 股<br>份有限<br>公司                         | SNOW UN | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 3,742  | 4,153,473.48 | 0.06 |
| 21<br>3 | Innodata<br>Inc                      | Innoda<br>ta Inc                                     | INOD UQ | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 14,586 | 4,143,672.09 | 0.06 |
| 21<br>4 | Tyler Te<br>chnologie<br>s Inc       | Tyler<br>科技公<br>司                                    | TYL UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 989    | 4,099,522.67 | 0.06 |
| 21<br>5 | LPL Fina<br>ncial<br>Holdings<br>Inc | LPL 金<br>融控股<br>公司                                   | LPLA UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 1,734  | 4,069,844.50 | 0.06 |
| 21<br>6 | Zebra Te<br>chnologie<br>s Corp      | 斑马技<br>术公司                                           | ZBRA UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 1,465  | 4,067,285.14 | 0.06 |
| 21<br>7 | On<br>Holding<br>AG                  | On 控股<br>股份公<br>司                                    | ONON UN | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 10,238 | 4,030,789.34 | 0.06 |
| 21<br>8 | Wolverine<br>World<br>Wide I<br>nc   | Wolver<br>ine W<br>orld<br>Wide<br>股份有<br>限公司        | WWW UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 25,019 | 3,992,594.07 | 0.06 |
| 21<br>9 | ACI<br>Worldwide<br>Inc              | ACI<br>Worldw<br>ide 公<br>司                          | ACIW UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 10,682 | 3,985,986.63 | 0.06 |
| 22<br>0 | Sprouts<br>Farmers<br>Market<br>Inc  | Sprout<br>s Far<br>mers<br>Mark<br>et 股份<br>有限公<br>司 | SFM UW  | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 4,356  | 3,978,901.03 | 0.06 |
| 22<br>1 | Brown &<br>Brown Inc                 | Brown<br>& B<br>rown 股<br>份有限<br>公司                  | BRO UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 5,368  | 3,936,679.53 | 0.06 |

|         |                                        |                                     |         |                   |    |        |              |      |
|---------|----------------------------------------|-------------------------------------|---------|-------------------|----|--------|--------------|------|
| 22<br>2 | Murphy<br>USA Inc                      | Murphy<br>美国股份<br>有限公司              | MUSA UN | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,087  | 3,920,569.53 | 0.06 |
| 22<br>3 | Zions<br>Bancorp<br>NA                 | 锡安银<br>行                            | ZION UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 9,995  | 3,897,757.15 | 0.06 |
| 22<br>4 | CH Robin<br>son Worl<br>dwide<br>Inc   | 罗宾逊<br>全球物<br>流有限<br>公司             | CHRW UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 5,214  | 3,872,466.41 | 0.06 |
| 22<br>5 | ExlServic<br>e Holdin<br>gs Inc        | ExlSer<br>vice 控<br>股公司             | EXLS UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 11,822 | 3,771,468.53 | 0.06 |
| 22<br>6 | Blackrock<br>Inc                       | 贝莱德<br>股份有<br>限公司                   | BLK UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 511    | 3,765,508.27 | 0.06 |
| 22<br>7 | Ensign<br>Group<br>Inc/The             | Ensign<br>集团股<br>份有限<br>公司          | ENSG UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 3,888  | 3,713,237.60 | 0.06 |
| 22<br>8 | Discover<br>Financi<br>al Ser<br>vices | Discover<br>金融<br>服务公<br>司          | DFS UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 2,977  | 3,707,098.93 | 0.05 |
| 22<br>9 | Veeva<br>Systems<br>Inc                | Veeva<br>System<br>s 股份<br>有限公<br>司 | VEEV UN | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 2,415  | 3,649,937.06 | 0.05 |
| 23<br>0 | Xcel<br>Energy<br>Inc                  | Xcel<br>能源                          | XEL UW  | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 7,433  | 3,607,686.59 | 0.05 |
| 23<br>1 | HealthEqu<br>ity Inc                   | Health<br>equity<br>有限公<br>司        | HQY UW  | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 5,220  | 3,600,374.84 | 0.05 |
| 23<br>2 | Louisiana<br>-Pacific<br>Corp          | 路易斯<br>安娜太<br>平洋                    | LPX UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 4,721  | 3,514,117.99 | 0.05 |
| 23<br>3 | Xometry<br>Inc                         | Xometr<br>y Inc                     | XMTR UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 11,219 | 3,440,386.50 | 0.05 |
| 23      | Vitesse                                | Vitess                              | VTS UN  | 纽约证               | 美国 | 19,118 | 3,435,695.78 | 0.05 |

|     |                               |                                  |         |           |    |        |              |      |
|-----|-------------------------------|----------------------------------|---------|-----------|----|--------|--------------|------|
| 4   | Energy Inc                    | e Energy Inc                     |         | 券交易所      |    |        |              |      |
| 235 | Talen Energy Corp             | Talen 能源公司                       | TLN UW  | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 2,358  | 3,414,966.30 | 0.05 |
| 236 | WW Grainger Inc               | 固安捷股份有限公司                        | GWV UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 448    | 3,394,465.99 | 0.05 |
| 237 | DXP Enterprises Inc/TX        | 德克萨斯州 DXP Enterprises 公司         | DXPE UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 5,674  | 3,369,820.42 | 0.05 |
| 238 | EPAM Systems Inc              | EPAM 系统公司                        | EPAM UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 1,996  | 3,354,860.21 | 0.05 |
| 239 | Veracyte Inc                  | Veracyte 股份有限公司                  | VCYT UQ | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 11,761 | 3,347,893.79 | 0.05 |
| 240 | Targa Resources Corp          | Targa 资源公司                       | TRGP UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 2,592  | 3,325,871.40 | 0.05 |
| 241 | Barrett Business Services Inc | Barrett Business Services 股份有限公司 | BBSI UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 10,596 | 3,308,750.36 | 0.05 |
| 242 | Carvana Co                    | Carvana 公司                       | CVNA UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 2,262  | 3,306,666.30 | 0.05 |
| 243 | Texas Roadhouse Inc           | Texas Roadhouse 股份有限公司           | TXRH UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 2,530  | 3,281,417.62 | 0.05 |
| 244 | Chefs' Warehouse Inc/The      | Chefs' Warehouse 股份有限公司          | CHEF UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 9,245  | 3,277,647.30 | 0.05 |

|         |                                                   | 司                               |             |                   |    |        |              |      |
|---------|---------------------------------------------------|---------------------------------|-------------|-------------------|----|--------|--------------|------|
| 24<br>5 | Assurant<br>Inc                                   | 安信龙<br>集团                       | AIZ UN      | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 2,121  | 3,250,879.28 | 0.05 |
| 24<br>6 | Ingredion<br>Inc                                  | 宜瑞安<br>公司                       | INGR UN     | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 3,280  | 3,243,383.08 | 0.05 |
| 24<br>7 | Vita Coco<br>Co<br>Inc/The                        | Vita<br>Coco Co<br>Inc/The<br>e | COCO UW     | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 12,112 | 3,213,602.40 | 0.05 |
| 24<br>8 | PNC Fina<br>ncial<br>Services<br>Group<br>Inc/The | PNC 财<br>务服务                    | PNC UN      | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 2,318  | 3,213,403.85 | 0.05 |
| 24<br>9 | Coinbase<br>Global<br>Inc                         | Coinba<br>se 全球<br>股份有<br>限公司   | COIN UW     | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 1,787  | 3,189,580.06 | 0.05 |
| 25<br>0 | Five<br>Below Inc                                 | Five<br>Below<br>股份有<br>限公司     | FIVE UW     | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 4,221  | 3,184,721.13 | 0.05 |
| 25<br>1 | Exelixis<br>Inc                                   | Exelix<br>is 股份<br>有限公司         | EXEL UW     | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 13,202 | 3,160,211.85 | 0.05 |
| 25<br>2 | Coherent<br>Corp                                  | 相干公<br>司                        | COHR UN     | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 4,627  | 3,150,788.65 | 0.05 |
| 25<br>3 | Progress<br>Softwar<br>e Corp                     | Progre<br>ss 软件<br>公司           | PRGS UW     | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 6,721  | 3,147,607.35 | 0.05 |
| 25<br>4 | TEGNA Inc                                         | TEGNA<br>股份有<br>限公司             | TGNA UN     | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 23,809 | 3,130,308.18 | 0.05 |
| 25<br>5 | Block Inc                                         | Block<br>股份有<br>限公司             | SQ UN       | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 5,104  | 3,118,248.56 | 0.05 |
| 25<br>6 | HEICO<br>Corp                                     | 海科航<br>空公司                      | HEI/A<br>UN | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 2,331  | 3,117,986.33 | 0.05 |
| 25      | Global B                                          | Global                          | GBTG UN     | 纽约证               | 美国 | 46,316 | 3,089,664.03 | 0.05 |

|         |                                                      |                                                            |         |                   |    |        |              |      |
|---------|------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|---------|-------------------|----|--------|--------------|------|
| 7       | usiness<br>Travel<br>Group<br>I                      | Busi<br>ness<br>Trav<br>el Gr<br>oup I                     |         | 券交易<br>所          |    |        |              |      |
| 25<br>8 | Vertex<br>Inc                                        | Vertex<br>股份有<br>限公司                                       | VERX UQ | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 8,055  | 3,089,101.68 | 0.05 |
| 25<br>9 | Workiva<br>Inc                                       | Workiv<br>a 股份<br>有限公司                                     | WK UN   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 3,876  | 3,050,915.10 | 0.05 |
| 26<br>0 | Tower Se<br>miconduct<br>or Ltd                      | 塔尔半<br>导体有<br>限公司                                          | TSEM UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 7,949  | 2,943,311.87 | 0.04 |
| 26<br>1 | Grab<br>Holdings<br>Ltd                              | Grab 控<br>股有限<br>公司                                        | GRAB UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 86,582 | 2,937,662.15 | 0.04 |
| 26<br>2 | US<br>Bancorp                                        | 美国合<br>众银行                                                 | USB UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 8,466  | 2,910,790.04 | 0.04 |
| 26<br>3 | Cummins<br>Inc                                       | 康明斯                                                        | CMI UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,152  | 2,886,769.43 | 0.04 |
| 26<br>4 | Charles<br>Schwab<br>Corp/The                        | 嘉信理<br>财                                                   | SCHW UN | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 5,400  | 2,872,872.81 | 0.04 |
| 26<br>5 | Quest<br>Diagnosti<br>cs Inc                         | Quest<br>Diagnost<br>ics 股<br>份有限<br>公司                    | DGX UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 2,640  | 2,862,926.94 | 0.04 |
| 26<br>6 | Boot Bar<br>n Holdin<br>gs Inc                       | Boot<br>Barn 控<br>股有限<br>公司                                | BOOT UN | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 2,597  | 2,834,217.48 | 0.04 |
| 26<br>7 | Natural<br>Grocers<br>by Vit<br>amin Cot<br>tage Inc | Natura<br>l Gro<br>cers<br>by Vi<br>tamin<br>Cot<br>tage 股 | NGVC UN | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 9,882  | 2,821,540.74 | 0.04 |

|     |                                     |                      |         |           |    |        |              |      |
|-----|-------------------------------------|----------------------|---------|-----------|----|--------|--------------|------|
|     |                                     | 份有限公司                |         |           |    |        |              |      |
| 268 | Vimeo Inc                           | Vimeo Inc            | VME0 UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 61,158 | 2,813,620.27 | 0.04 |
| 269 | Keysight Technologies Inc           | 是德科技公司               | KEYS UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 2,428  | 2,803,545.30 | 0.04 |
| 270 | Equitable Holdings Inc              | Equitable 控股股份有限公司   | EQH UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 8,238  | 2,793,314.91 | 0.04 |
| 271 | Chart Industries Inc                | 查特工业公司               | GTLS UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 2,032  | 2,787,567.21 | 0.04 |
| 272 | SPX Technologies Inc                | SPX 公司               | SPXC UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 2,630  | 2,751,127.20 | 0.04 |
| 273 | Public Service Enterprise Group Inc | 公共服务企业集团             | PEG UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 4,490  | 2,726,992.14 | 0.04 |
| 274 | Viant Technology Inc                | Viant Technology Inc | DSP UW  | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 19,815 | 2,704,900.39 | 0.04 |
| 275 | Travelers Cos Inc/The               | 旅行家集团                | TRV UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 1,555  | 2,692,659.27 | 0.04 |
| 276 | Waste Management Inc                | 废品管理                 | WM UN   | 纽约证券交易所   | 美国 | 1,846  | 2,677,710.20 | 0.04 |
| 277 | Group 1 Automotive Inc              | 第一汽车集团公司             | GPI UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 883    | 2,675,284.11 | 0.04 |
| 278 | Mueller Water Products Inc          | 穆勒水制品有限公司            | MWA UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 16,520 | 2,671,928.28 | 0.04 |
| 27  | ResMed                              | 瑞思迈                  | RMD UN  | 纽约证       | 美国 | 1,625  | 2,671,362.19 | 0.04 |

|         |                                                              |                                          |         |                   |    |        |              |      |
|---------|--------------------------------------------------------------|------------------------------------------|---------|-------------------|----|--------|--------------|------|
| 9       | Inc                                                          | 股份有<br>限公司                               |         | 券交易<br>所          |    |        |              |      |
| 28<br>0 | Hartford<br>Financi<br>al Servi<br>ces Gr<br>oup Inc/<br>The | 哈特福<br>德金融<br>服务                         | HIG UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 3,395  | 2,669,865.21 | 0.04 |
| 28<br>1 | Bristol-M<br>yers Squ<br>ibb Co                              | 百时美<br>施贵宝<br>公司                         | BMJ UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 6,536  | 2,657,380.11 | 0.04 |
| 28<br>2 | Manhattan<br>Associa<br>tes Inc                              | 曼哈顿<br>联合软<br>件公司                        | MANH UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 1,362  | 2,645,811.96 | 0.04 |
| 28<br>3 | Wintrust<br>Financi<br>al Corp                               | Wintru<br>st 金融<br>公司                    | WTFC UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 2,945  | 2,640,090.50 | 0.04 |
| 28<br>4 | Regions<br>Financial<br>Corp                                 | Region<br>s 金融<br>公司                     | RF UN   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 15,513 | 2,622,801.03 | 0.04 |
| 28<br>5 | MDU Reso<br>urces Gr<br>oup Inc                              | MDU 资<br>源集团<br>股份有<br>限公司               | MDU UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 20,077 | 2,600,673.55 | 0.04 |
| 28<br>6 | Okta Inc                                                     | Okta<br>Inc                              | OKTA UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 4,560  | 2,582,993.40 | 0.04 |
| 28<br>7 | Procter<br>& Gamble<br>Co/The                                | 宝洁                                       | PG UN   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 2,115  | 2,548,861.07 | 0.04 |
| 28<br>8 | Zoom Com<br>municatio<br>ns Inc                              | Zoom 通<br>信股份<br>有限公司                    | ZM UW   | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 4,340  | 2,546,040.71 | 0.04 |
| 28<br>9 | Climb Gl<br>obal Sol<br>utions<br>Inc                        | Climb<br>Glob<br>al Solu<br>tions 公<br>司 | CLMB UQ | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 2,749  | 2,504,695.55 | 0.04 |
| 29<br>0 | Adtalem<br>Global                                            | Adtale<br>m 环球                           | ATGE UN | 纽约证<br>券交易        | 美国 | 3,610  | 2,357,568.77 | 0.03 |

|     |                                   |                     |         |           |    |        |              |      |
|-----|-----------------------------------|---------------------|---------|-----------|----|--------|--------------|------|
|     | Educational Inc                   | 教育股份有限公司            |         | 所         |    |        |              |      |
| 291 | Hancock Whitney Corp              | Hancock Whitney 公司  | HWC UN  | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 5,963  | 2,345,541.57 | 0.03 |
| 292 | ARM Holdings PLC                  | ARM Holdings PLC    | ARM UN  | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 2,606  | 2,310,899.23 | 0.03 |
| 293 | CNO Financial Group Inc           | CNO 金融集团公司          | CNO UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 8,614  | 2,304,075.86 | 0.03 |
| 294 | Ameren Corp                       | Ameren 公司           | AEE UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 3,574  | 2,290,126.19 | 0.03 |
| 295 | Take-Two Interactive Software Inc | Take-Two 互动软件股份有限公司 | TTWO UN | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,730  | 2,289,206.36 | 0.03 |
| 296 | Blue Owl Capital Inc              | 蓝猫头鹰资本公司            | OWL UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 13,691 | 2,289,165.10 | 0.03 |
| 297 | OGE Energy Corp                   | OGE 能源公司            | OGE UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 7,700  | 2,283,215.55 | 0.03 |
| 298 | Federated Hermes Inc              | 联邦赫尔墨斯股份有限公司        | FHI UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 7,725  | 2,282,854.33 | 0.03 |
| 299 | Five9 Inc                         | Five9 股份有限公司        | FIVN UN | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 7,683  | 2,244,485.31 | 0.03 |
| 300 | Archrock Inc                      | Archrock 有限公司       | AROC UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 12,500 | 2,236,490.95 | 0.03 |
| 301 | Travel + Leisure Co               | Travel + Leisure 公司 | TNL UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 6,129  | 2,222,711.15 | 0.03 |
| 302 | Eagle Materials                   | 鹰牌材料有限公司            | EXP UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 1,248  | 2,213,714.36 | 0.03 |

|     | Inc                              | 公司                      |         | 所         |    |        |              |      |
|-----|----------------------------------|-------------------------|---------|-----------|----|--------|--------------|------|
| 303 | MetLife Inc                      | 大都会集团                   | MET UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 3,761  | 2,213,672.67 | 0.03 |
| 304 | Cintas Corp                      | Cintas 公司               | CTAS UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,680  | 2,206,378.74 | 0.03 |
| 305 | Aurora Innovation Inc            | Aurora Innovation Inc   | AUR UW  | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 47,566 | 2,154,117.64 | 0.03 |
| 306 | United Rentals Inc               | 联合租赁公司                  | URI UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 423    | 2,141,985.92 | 0.03 |
| 307 | West Pharmaceutical Services Inc | 西氏医药服务公司                | WST UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 905    | 2,130,942.24 | 0.03 |
| 308 | Truist Financial Corp            | Truist 金融公司             | TFC UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 6,775  | 2,112,667.17 | 0.03 |
| 309 | M&T Bank Corp                    | M&T 银行                  | MTB UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 1,559  | 2,106,974.60 | 0.03 |
| 310 | DT Midstream Inc                 | DT Midstream Inc        | DTM UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 2,901  | 2,073,468.32 | 0.03 |
| 311 | Gartner Inc                      | Gartner 公司              | IT UN   | 纽约证券交易所   | 美国 | 593    | 2,065,160.54 | 0.03 |
| 312 | Marsh & McLennan Cos Inc         | Marsh & McLennan 股份有限公司 | MMC UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 1,349  | 2,059,771.97 | 0.03 |
| 313 | Lazard Inc                       | Lazard 股份有限公司           | LAZ UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 5,545  | 2,051,976.22 | 0.03 |
| 314 | Tempur Sealy International Inc   | 泰普尔丝涟国际股份有限公司           | TPX UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 5,029  | 2,049,369.78 | 0.03 |

|         |                                                 | 司                                                           |             |                   |    |       |              |      |
|---------|-------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------|-------------|-------------------|----|-------|--------------|------|
| 31<br>5 | Dorman<br>Products<br>Inc                       | Dorman<br>产品公<br>司                                          | DORM UN     | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 2,171 | 2,021,759.42 | 0.03 |
| 31<br>6 | Teledyne<br>Technol<br>ogies<br>Inc             | Teledy<br>ne 科技<br>股份有<br>限公司                               | TDY UN      | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 599   | 1,998,474.90 | 0.03 |
| 31<br>7 | Reinsuran<br>ce Group<br>of A<br>merica I<br>nc | RGA 美<br>国再保<br>险公司                                         | RGA UN      | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,290 | 1,980,998.68 | 0.03 |
| 31<br>8 | Academy<br>Sports<br>& Outd<br>oors Inc         | Academ<br>y Spo<br>rts<br>& O<br>utdoor<br>s 股份<br>有限公<br>司 | ASO UN      | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 4,722 | 1,952,776.73 | 0.03 |
| 31<br>9 | John Bea<br>n Tech<br>nologies<br>Corp          | 卓缤科<br>技公司                                                  | JBT UN      | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 2,128 | 1,944,237.92 | 0.03 |
| 32<br>0 | Gen<br>Digital<br>Inc                           | Gen<br>Digita<br>l 股份<br>有限公<br>司                           | GEN UN      | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 9,775 | 1,923,899.78 | 0.03 |
| 32<br>1 | Toast Inc                                       | Toast<br>股份有<br>限公司                                         | TOST UN     | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 7,333 | 1,921,371.98 | 0.03 |
| 32<br>2 | Tradeweb<br>Markets<br>Inc                      | Tradew<br>eb<br>Market<br>s 股份<br>有限公<br>司                  | TW UN       | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 2,038 | 1,917,972.66 | 0.03 |
| 32<br>3 | Moody's<br>Corp                                 | 穆迪                                                          | MCO UN      | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 560   | 1,905,552.83 | 0.03 |
| 32<br>4 | Moog Inc                                        | 穆格公<br>司                                                    | MOG/A<br>UN | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,323 | 1,871,998.24 | 0.03 |

|         |                                          |                                               |         |                   |    |        |              |      |
|---------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|---------|-------------------|----|--------|--------------|------|
| 32<br>5 | GEO Group<br>Inc/The                     | GEO 集团<br>公司                                  | GEO UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 9,250  | 1,860,465.75 | 0.03 |
| 32<br>6 | Dexcom<br>Inc                            | Dexcom<br>股份有<br>限公司                          | DXCM UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 3,320  | 1,856,019.00 | 0.03 |
| 32<br>7 | Stifel<br>Financial<br>Corp              | 斯迪富<br>融资公<br>司                               | SF UN   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 2,417  | 1,843,072.41 | 0.03 |
| 32<br>8 | Ciena<br>Corp                            | Ciena<br>公司                                   | CIEN UN | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 2,978  | 1,815,532.35 | 0.03 |
| 32<br>9 | Fastenal<br>Co                           | 法思诺<br>公司                                     | FAST UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 3,462  | 1,789,569.58 | 0.03 |
| 33<br>0 | Toll<br>Brothers<br>Inc                  | 托尔兄<br>弟公司                                    | TOL UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,968  | 1,781,785.83 | 0.03 |
| 33<br>1 | Rush Str<br>eet In<br>teractive<br>Inc   | Rush<br>Street<br>In<br>teract<br>ive I<br>nc | RSI UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 18,038 | 1,778,995.01 | 0.03 |
| 33<br>2 | AvePoint<br>Inc                          | AvePoi<br>nt Inc                              | AVPT UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 14,854 | 1,762,879.91 | 0.03 |
| 33<br>3 | Jefferies<br>Financi<br>al Gro<br>up Inc | 杰富瑞<br>金融集<br>团                               | JEF UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 3,106  | 1,750,450.16 | 0.03 |
| 33<br>4 | PJT<br>Partners<br>Inc                   | PJT 合<br>伙股份<br>有限公<br>司                      | PJT UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,535  | 1,741,306.16 | 0.03 |
| 33<br>5 | Hewlett<br>Packard<br>Enterpr<br>ise Co  | 慧与公<br>司                                      | HPE UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 11,182 | 1,716,127.71 | 0.03 |
| 33<br>6 | Dave Inc                                 | Dave<br>Inc                                   | DAVE UQ | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 2,738  | 1,710,745.46 | 0.03 |
| 33<br>7 | Generac<br>Holdings                      | Genera<br>c 控股                                | GNRC UN | 纽约证<br>券交易        | 美国 | 1,531  | 1,706,393.53 | 0.03 |

|     | Inc                         | 公司                   |         | 所         |    |        |              |      |
|-----|-----------------------------|----------------------|---------|-----------|----|--------|--------------|------|
| 338 | Peloton Interactive Inc     | 派乐腾                  | PTON UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 26,969 | 1,686,616.45 | 0.03 |
| 339 | Sterling Infrastructure Inc | Sterling 基础设施股份有限公司  | STRL UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,384  | 1,675,866.20 | 0.02 |
| 340 | Taylor Morrison Home Corp   | Taylor Morrison 房屋公司 | TMHC UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 3,791  | 1,668,047.45 | 0.02 |
| 341 | Box Inc                     | Box 股份有限公司           | BOX UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 7,288  | 1,655,494.27 | 0.02 |
| 342 | OppFi Inc                   | OppFi Inc            | OPFI UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 30,026 | 1,653,325.96 | 0.02 |
| 343 | Nasdaq Inc                  | 纳斯达克股份有限公司           | NDAQ UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 2,884  | 1,602,740.33 | 0.02 |
| 344 | Crocs Inc                   | 卡骆驰股份有限公司            | CROX UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,968  | 1,549,495.85 | 0.02 |
| 345 | Owens Corning               | 欧文斯科宁公司              | OC UN   | 纽约证券交易所   | 美国 | 1,264  | 1,547,550.96 | 0.02 |
| 346 | StepStone Group Inc         | StepStone 集团股份有限公司   | STEP UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 3,656  | 1,521,132.15 | 0.02 |
| 347 | Carlyle Group Inc/The       | 凯雷集团股份有限公司           | CG UW   | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 3,982  | 1,445,236.30 | 0.02 |
| 348 | Onto Innovation Inc         | Onto 创新股份有限公司        | ONTO UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 1,171  | 1,402,964.13 | 0.02 |
| 349 | FedEx Corp                  | 联邦快递                 | FDX UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 690    | 1,395,395.67 | 0.02 |

|     |                           |                           |         |           |    |       |              |      |
|-----|---------------------------|---------------------------|---------|-----------|----|-------|--------------|------|
|     |                           |                           |         | 所         |    |       |              |      |
| 350 | Gulfport Energy Corp      | Gulfport Energy Corp      | GPOR UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 1,052 | 1,392,956.65 | 0.02 |
| 351 | Performance Food Group Co | Performance Food Group Co | PFGC UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 2,290 | 1,391,814.41 | 0.02 |
| 352 | Rambus Inc                | Rambus 股份有限公司             | RMBS UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 3,608 | 1,370,963.60 | 0.02 |
| 353 | Genpact Ltd               | 简柏特有限公司                   | G UN    | 纽约证券交易所   | 美国 | 4,381 | 1,352,597.74 | 0.02 |
| 354 | Atmos Energy Corp         | Atmos 能源公司                | ATO UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 1,345 | 1,346,517.79 | 0.02 |
| 355 | Southern Co/The           | 南方公司                      | SO UN   | 纽约证券交易所   | 美国 | 2,269 | 1,342,678.68 | 0.02 |
| 356 | Aramark                   | 爱玛客                       | ARMK UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 4,995 | 1,339,655.02 | 0.02 |
| 357 | Verisk Analytics Inc      | Verisk 分析公司               | VRSK UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 676   | 1,338,413.08 | 0.02 |
| 358 | Arch Capital Group Ltd    | 阿契资本集团                    | ACGL UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,997 | 1,325,705.93 | 0.02 |
| 359 | VeriSign Inc              | 威瑞信股份有限公司                 | VRSN UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 891   | 1,325,550.74 | 0.02 |
| 360 | Cisco Systems Inc         | 思科                        | CSCO UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 3,090 | 1,314,959.64 | 0.02 |
| 361 | Snap-on Inc               | 实耐宝                       | SNA UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 536   | 1,308,010.47 | 0.02 |
| 362 | Crane Co                  | Crane Co                  | CR UN   | 纽约证券交易所   | 美国 | 1,179 | 1,286,100.01 | 0.02 |
| 363 | FormFactor Inc            | Formfactor 股              | FORM UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 3,976 | 1,257,567.45 | 0.02 |

|     |                              |                       |         |           |    |        |              |      |
|-----|------------------------------|-----------------------|---------|-----------|----|--------|--------------|------|
|     |                              | 份有限公司                 |         | 交易所       |    |        |              |      |
| 364 | Fifth Third Bancorp          | 五三银行                  | FITB UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 4,135  | 1,256,732.16 | 0.02 |
| 365 | Monolithic Power Systems Inc | 芯源系统有限公司              | MPWR UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 295    | 1,254,746.00 | 0.02 |
| 366 | RingCentral Inc              | RingCentral 股份有限公司    | RNG UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 4,957  | 1,247,507.79 | 0.02 |
| 367 | Mercury General Corp         | Mercury General 公司    | MCY UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 2,608  | 1,246,323.64 | 0.02 |
| 368 | Sysco Corp                   | Sysco 公司              | SYN UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 2,262  | 1,243,251.89 | 0.02 |
| 369 | Infinera Corp                | Infinera 公司           | INFN UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 26,321 | 1,243,082.61 | 0.02 |
| 370 | DuPont de Nemours Inc        | 杜邦公司                  | DD UN   | 纽约证券交易所   | 美国 | 2,267  | 1,242,577.84 | 0.02 |
| 371 | Qifu Technology Inc          | 奇富科技股份有限公司            | QFIN UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 4,476  | 1,234,887.18 | 0.02 |
| 372 | EnerSys                      | 艾诺斯集团                 | ENS UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 1,852  | 1,230,512.90 | 0.02 |
| 373 | Neurocrine Biosciences Inc   | Neurocrine 生物科学股份有限公司 | NBIX UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,254  | 1,230,445.62 | 0.02 |
| 374 | FactSet Research Systems Inc | FactSet 研究系统股份有限公司    | FDS UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 353    | 1,218,713.00 | 0.02 |
| 37  | PriceSmar                    | PriceS                | PSMT UW | 纳斯达克      | 美国 | 1,838  | 1,217,775.77 | 0.02 |

|     |                          |                           |         |                |    |       |              |      |
|-----|--------------------------|---------------------------|---------|----------------|----|-------|--------------|------|
| 5   | t Inc                    | mart 股份有限公司               |         | 克 证 券 交 易 所    |    |       |              |      |
| 376 | Northern Trust Corp      | 北美信托                      | NTRS UW | 纳斯达克 证 券 交 易 所 | 美国 | 1,648 | 1,214,264.53 | 0.02 |
| 377 | Corpay Inc               | Corpay 股份有限公司             | CPAY UN | 纽约证 券 交 易 所    | 美国 | 489   | 1,189,589.48 | 0.02 |
| 378 | Carnival Corp            | 嘉年华 公司                    | CCL UN  | 纽约证 券 交 易 所    | 美国 | 6,611 | 1,184,261.01 | 0.02 |
| 379 | Accenture PLC            | 埃森哲 公司                    | ACN UN  | 纽约证 券 交 易 所    | 美国 | 468   | 1,183,481.79 | 0.02 |
| 380 | Reddit Inc               | Reddit 股份有限公司             | RDDT UN | 纽约证 券 交 易 所    | 美国 | 985   | 1,157,249.01 | 0.02 |
| 381 | Cava Group Inc           | Cava Group Inc            | CAVA UN | 纽约证 券 交 易 所    | 美国 | 1,422 | 1,153,030.86 | 0.02 |
| 382 | OneSpaWorld Holdings Ltd | OneSpa World Holdings Ltd | OSW UR  | 纳斯达克 证 券 交 易 所 | 美国 | 8,025 | 1,147,969.51 | 0.02 |
| 383 | A10 Networks Inc         | A10 网络公司                  | ATEN UN | 纽约证 券 交 易 所    | 美国 | 8,645 | 1,143,444.41 | 0.02 |
| 384 | AAON Inc                 | AAON 股份有限公司               | AAON UW | 纳斯达克 证 券 交 易 所 | 美国 | 1,319 | 1,115,782.87 | 0.02 |
| 385 | Valmont Industries Inc   | 维蒙特 工业公司                  | VMI UN  | 纽约证 券 交 易 所    | 美国 | 506   | 1,115,460.11 | 0.02 |
| 386 | KB Home                  | KB 家居                     | KBH UN  | 纽约证 券 交 易 所    | 美国 | 2,349 | 1,109,718.45 | 0.02 |
| 387 | Tyson Foods Inc          | 泰森食品公司                    | TSN UN  | 纽约证 券 交 易 所    | 美国 | 2,687 | 1,109,466.86 | 0.02 |
| 388 | DR Horton Inc            | 霍顿房屋公司                    | DHI UN  | 纽约证 券 交 易 所    | 美国 | 1,088 | 1,093,529.31 | 0.02 |

|     |                           |                           |         |           |    |        |              |      |
|-----|---------------------------|---------------------------|---------|-----------|----|--------|--------------|------|
| 389 | CoreCivic Inc             | CoreCivic 股份有限公司          | CXW UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 6,922  | 1,081,741.20 | 0.02 |
| 390 | PulteGroup Inc            | Pulte 集团公司                | PHM UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 1,376  | 1,077,155.86 | 0.02 |
| 391 | Guidewire Software Inc    | Guidewire 软件公司            | GWRE UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 882    | 1,068,825.66 | 0.02 |
| 392 | Modine Manufacturing Co   | 摩丁制造公司                    | MOD UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 1,282  | 1,068,356.25 | 0.02 |
| 393 | Synopsys Inc              | 新思科技公司                    | SNPS UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 305    | 1,064,133.36 | 0.02 |
| 394 | Yum China Holdings Inc    | 百胜中国控股有限公司                | YUMC UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 3,070  | 1,063,034.25 | 0.02 |
| 395 | Construction Partners Inc | Construction Partners Inc | ROAD UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,655  | 1,052,391.10 | 0.02 |
| 396 | Crown Holdings Inc        | Crown 控股股份有限公司            | CCK UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 1,734  | 1,030,704.85 | 0.02 |
| 397 | General Motors Co         | 通用汽车公司                    | GM UN   | 纽约证券交易所   | 美国 | 2,691  | 1,030,454.05 | 0.02 |
| 398 | Moelis & Co               | Moelis 公司                 | MC UN   | 纽约证券交易所   | 美国 | 1,875  | 995,773.11   | 0.01 |
| 399 | Robinhood Markets Inc     | 罗宾汉市场股份公司                 | HOOD UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 3,671  | 983,239.85   | 0.01 |
| 400 | Waters Corp               | 沃特世公司                     | WAT UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 368    | 981,364.97   | 0.01 |
| 401 | Hanesbrands Inc           | Hanesbrands 股份有           | HBI UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 16,763 | 980,863.07   | 0.01 |

|         |                                 |                             |         |           |    |       |            |      |
|---------|---------------------------------|-----------------------------|---------|-----------|----|-------|------------|------|
|         |                                 | 限公司                         |         |           |    |       |            |      |
| 40<br>2 | Smartsheet Inc                  | Smartsheet 股份有限公司           | SMAR UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 2,427 | 977,513.21 | 0.01 |
| 40<br>3 | Super Micro Computer Inc        | Super Micro Computer 股份有限公司 | SMCI UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 4,414 | 967,118.13 | 0.01 |
| 40<br>4 | Carlisle Cos Inc                | 卡莱股份有限公司                    | CSL UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 361   | 957,144.37 | 0.01 |
| 40<br>5 | Old Republic International Corp | Old Republic 国际公司           | ORI UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 3,669 | 954,483.73 | 0.01 |
| 40<br>6 | Texas Pacific Land Corp         | 德克萨斯州太平洋土地公司                | TPL UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 120   | 954,009.94 | 0.01 |
| 40<br>7 | SiTime Corp                     | SiTime Corp                 | SITM UQ | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 607   | 936,071.36 | 0.01 |
| 40<br>8 | Smurfit WestRock PLC            | Smurfit WestRock 公共有限公司     | SW UN   | 纽约证券交易所   | 美国 | 2,411 | 933,460.18 | 0.01 |
| 40<br>9 | Juniper Networks Inc            | 瞻博网络股份有限公司                  | JNPR UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 3,446 | 927,682.43 | 0.01 |
| 41<br>0 | United Airlines Holdings Inc    | 美国联合航空控股股份有限公司              | UAL UW  | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,320 | 921,351.60 | 0.01 |
| 41<br>1 | Armstrong World Industries Inc  | 阿姆斯壮世界工业有限公司                | AWI UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 894   | 908,247.30 | 0.01 |

|         |                                |                                 |             |                   |    |       |            |      |
|---------|--------------------------------|---------------------------------|-------------|-------------------|----|-------|------------|------|
| 41<br>2 | EQT Corp                       | EQT 公司                          | EQT UN      | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 2,733 | 905,872.32 | 0.01 |
| 41<br>3 | Antero<br>Midstream<br>Corp    | Antero<br>中游公<br>司              | AM UN       | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 8,242 | 894,034.10 | 0.01 |
| 41<br>4 | Deere & Co                     | 迪尔                              | DE UN       | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 293   | 892,397.45 | 0.01 |
| 41<br>5 | KeyCorp                        | KeyCor<br>p 公司                  | KEY UN      | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 7,186 | 885,381.14 | 0.01 |
| 41<br>6 | Rocket<br>Lab USA<br>Inc       | Rocket<br>Lab USA<br>Inc        | RKLB UR     | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 4,800 | 878,825.03 | 0.01 |
| 41<br>7 | First<br>Horizon<br>Corp       | 第一线<br>国民银<br>行                 | FHN UN      | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 6,069 | 878,635.69 | 0.01 |
| 41<br>8 | National<br>Fuel Gas<br>Co     | 国家燃<br>气公司                      | NFG UN      | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 2,006 | 875,001.38 | 0.01 |
| 41<br>9 | Pandora<br>A/S                 | 潘多拉<br>公司                       | PANDY<br>UV | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 2,600 | 869,077.56 | 0.01 |
| 42<br>0 | Markel<br>Group Inc            | Markel<br>集团股<br>份有限<br>公司      | MKL UN      | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 70    | 868,618.22 | 0.01 |
| 42<br>1 | Encompass<br>Health<br>Corp    | 南方保<br>健公司                      | EHC UN      | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,308 | 868,314.15 | 0.01 |
| 42<br>2 | PPL Corp                       | PPL 公<br>司                      | PPL UN      | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 3,672 | 856,807.82 | 0.01 |
| 42<br>3 | Emerson<br>Electric<br>Co      | 艾默生<br>电气                       | EMR UN      | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 953   | 848,988.07 | 0.01 |
| 42<br>4 | Berry Gl<br>obal Gro<br>up Inc | Berry<br>全球集<br>团股份<br>有限公<br>司 | BERY UN     | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,814 | 843,281.12 | 0.01 |
| 42<br>5 | Resideo<br>Technolog           | Reside<br>o Tec                 | REZI UN     | 纽约证<br>券交易        | 美国 | 5,082 | 842,049.89 | 0.01 |

|     |                                |                            |         |           |    |       |            |      |
|-----|--------------------------------|----------------------------|---------|-----------|----|-------|------------|------|
|     | ies Inc                        | hnologies Inc              |         | 所         |    |       |            |      |
| 426 | PACCAR Inc                     | 帕卡                         | PCAR UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,124 | 840,456.80 | 0.01 |
| 427 | First Financial Bankshares Inc | 第一金融银行股份有限公司               | FFIN UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 3,242 | 840,137.78 | 0.01 |
| 428 | Interface Inc                  | 英特飞股份有限公司                  | TILE UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 4,776 | 835,979.29 | 0.01 |
| 429 | Mirion Technologies Inc        | Mirion Technologies Inc    | MIR UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 6,658 | 835,163.41 | 0.01 |
| 430 | BWX Technologies Inc           | BWX 科技公司                   | BWXT UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 1,041 | 833,545.23 | 0.01 |
| 431 | Revolve Group Inc              | Revolve Group Inc          | RVLV UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 3,458 | 832,477.25 | 0.01 |
| 432 | RLI Corp                       | RLI 公司                     | RLI UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 700   | 829,404.78 | 0.01 |
| 433 | East West Bancorp Inc          | 华美银行集团公司                   | EWBC UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,193 | 821,214.89 | 0.01 |
| 434 | ConocoPhillips                 | 康菲石油                       | COP UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 1,149 | 819,091.80 | 0.01 |
| 435 | Merit Medical Systems Inc      | Merit 医疗系统股份有限公司           | MMSI UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,173 | 815,542.38 | 0.01 |
| 436 | Commerce Bancshares Inc/MO     | Commerce Bancshares 股份有限公司 | CBSH UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,815 | 812,955.21 | 0.01 |

|     |                                   |                                   |         |           |    |       |            |      |
|-----|-----------------------------------|-----------------------------------|---------|-----------|----|-------|------------|------|
| 437 | Clearwater Analytics Holdings Inc | Clearwater Analytics Holdings Inc | CWAN UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 4,069 | 804,948.98 | 0.01 |
| 438 | TransUnion                        | 环联有限责任公司                          | TRU UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 1,207 | 804,388.93 | 0.01 |
| 439 | Hubbell Inc                       | 哈贝尔公司                             | HUBB UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 264   | 794,943.30 | 0.01 |
| 440 | Energizer Holdings Inc            | 劲量控股股份有限公司                        | ENR UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 3,163 | 793,290.76 | 0.01 |
| 441 | Avnet Inc                         | 安富利股份有限公司                         | AVT UW  | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 2,089 | 785,666.82 | 0.01 |
| 442 | Trimble Inc                       | 天宝股份有限公司                          | TRMB UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,541 | 782,723.74 | 0.01 |
| 443 | Atmus Filtration Technologies Inc | Atmus Filtration Technologies Inc | ATMU UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 2,553 | 719,030.78 | 0.01 |
| 444 | Parker-Hannifin Corp              | 派克汉尼汾公司                           | PH UN   | 纽约证券交易所   | 美国 | 155   | 708,665.90 | 0.01 |
| 445 | NVR Inc                           | NVR 股份有限公司                        | NVR UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 12    | 705,518.46 | 0.01 |
| 446 | Synovus Financial Corp            | Synovus 金融                        | SNV UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 1,914 | 704,852.96 | 0.01 |
| 447 | Cohen & Steers Inc                | Cohen & Steers 股份有限公司             | CNS UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 1,052 | 698,293.25 | 0.01 |
| 44  | RealReal                          | RealRe                            | REAL UW | 纳斯达克      | 美国 | 8,806 | 691,880.48 | 0.01 |

|         |                                                             |                              |         |                   |    |       |            |      |
|---------|-------------------------------------------------------------|------------------------------|---------|-------------------|----|-------|------------|------|
| 8       | Inc/The                                                     | al<br>Inc/Th<br>e            |         | 克证券<br>交易所        |    |       |            |      |
| 44<br>9 | Axogen<br>Inc                                               | Axogen<br>股份有<br>限公司         | AXGN UR | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 5,664 | 670,984.81 | 0.01 |
| 45<br>0 | Semtech<br>Corp                                             | Semtec<br>h 公司               | SMTC UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 1,474 | 655,344.14 | 0.01 |
| 45<br>1 | Vail<br>Resorts<br>Inc                                      | 范尔度<br>度假村股<br>份有限公<br>司     | MTN UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 479   | 645,436.01 | 0.01 |
| 45<br>2 | Teradyne<br>Inc                                             | 泰瑞达                          | TER UW  | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 710   | 642,665.96 | 0.01 |
| 45<br>3 | Darden R<br>estaurant<br>s Inc                              | 达登餐<br>饮公司                   | DRI UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 472   | 633,425.13 | 0.01 |
| 45<br>4 | ROBLOX<br>Corp                                              | Roblox<br>公司                 | RBLX UN | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,474 | 613,067.29 | 0.01 |
| 45<br>5 | Addus<br>HomeCare<br>Corp                                   | 爱德斯<br>家庭护<br>理公司            | ADUS UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 666   | 600,109.92 | 0.01 |
| 45<br>6 | Fidelity<br>Nationa<br>l Info<br>rmation<br>Services<br>Inc | 繁德信<br>息技术<br>有限公<br>司       | FIS UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,028 | 596,864.07 | 0.01 |
| 45<br>7 | TPG Inc                                                     | TPG Inc                      | TPG UW  | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 1,318 | 595,365.72 | 0.01 |
| 45<br>8 | VF Corp                                                     | VF 公司                        | VFC UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 3,794 | 585,274.06 | 0.01 |
| 45<br>9 | Pilgrim's<br>Pride<br>Corp                                  | Pilgri<br>m's<br>Pride<br>公司 | PPC UW  | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 1,754 | 572,297.71 | 0.01 |
| 46<br>0 | RH                                                          | RH                           | RH UN   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 199   | 563,027.19 | 0.01 |

|     |                                         |                    |         |           |    |       |            |      |
|-----|-----------------------------------------|--------------------|---------|-----------|----|-------|------------|------|
| 461 | Casey's General Stores Inc              | 凯西杂货公司             | CASY UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 196   | 558,258.91 | 0.01 |
| 462 | Evercore Inc                            | Evercore 股份有限公司    | EVR UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 273   | 543,966.86 | 0.01 |
| 463 | Elanco Animal Health Inc                | Elanco 动物健康股份有限公司  | ELAN UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 6,129 | 533,538.79 | 0.01 |
| 464 | Morningstar Inc                         | 晨星公司               | MORN UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 217   | 525,306.13 | 0.01 |
| 465 | Lattice Semiconductor Corp              | 莱迪斯半导体公司           | LSCC UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,261 | 513,508.03 | 0.01 |
| 466 | Kratos Defense & Security Solutions Inc | Kratos 国防与安全解决方案公司 | KTOS UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 2,676 | 507,449.86 | 0.01 |
| 467 | Broadridge Financial Solutions Inc      | 布罗德里奇金融解决方案股份有限公司  | BR UN   | 纽约证券交易所   | 美国 | 307   | 498,944.18 | 0.01 |
| 468 | Corcept Therapeutics Inc                | Corcept 医疗公司       | CORT UR | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,362 | 493,348.37 | 0.01 |
| 469 | Despegar.com Corp                       | Despegar.com Corp  | DESP UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 3,562 | 492,897.81 | 0.01 |
| 470 | Exxon Mobil Corp                        | 埃克森美孚石油公司          | XOM UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 619   | 478,645.58 | 0.01 |
| 471 | Crinetics Pharmaceuticals               | Crinetics Phar     | CRNX UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,299 | 477,438.22 | 0.01 |

|         |                                 |                             |         |                   |    |       |            |      |
|---------|---------------------------------|-----------------------------|---------|-------------------|----|-------|------------|------|
|         | s Inc                           | maceut<br>icals<br>Inc      |         |                   |    |       |            |      |
| 47<br>2 | Sylvamo Corp                    | Sylvamo Corp                | SLVM UN | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 825   | 468,622.58 | 0.01 |
| 47<br>3 | Cavco Industries Inc            | Cavco 工业股份有限公司              | CVCO UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 146   | 468,321.24 | 0.01 |
| 47<br>4 | Tenet Healthcare Corp           | Tenet 医疗保健公司                | THC UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 507   | 460,047.61 | 0.01 |
| 47<br>5 | Cardinal Health Inc             | 嘉德诺健康集团                     | CAH UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 541   | 459,943.09 | 0.01 |
| 47<br>6 | News Corp                       | 新闻集团                        | NWS UW  | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 2,065 | 451,704.32 | 0.01 |
| 47<br>7 | Thermo Fisher Scientific Inc    | Thermo Fisher Scientific 公司 | TMO UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 117   | 437,535.70 | 0.01 |
| 47<br>8 | Choice Hotels International Inc | 精品国际酒店集团                    | CHH UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 423   | 431,717.62 | 0.01 |
| 47<br>9 | Walt Disney Co/The              | 华特迪士尼公司                     | DIS UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 538   | 430,630.45 | 0.01 |
| 48<br>0 | Dayforce Inc                    | Dayforce 股份有限公司             | DAY UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 812   | 423,998.29 | 0.01 |
| 48<br>1 | Apogee Enterprises Inc          | Apogee Enterprises 股份公司     | APOG UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 825   | 423,492.01 | 0.01 |
| 48<br>2 | Paychex Inc                     | Paychex 公司                  | PAYX UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 420   | 423,342.13 | 0.01 |

|     |                                |                             |         |           |    |       |            |      |
|-----|--------------------------------|-----------------------------|---------|-----------|----|-------|------------|------|
| 483 | Newmont Corp                   | 纽蒙黄金公司                      | NEM UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 1,560 | 417,381.51 | 0.01 |
| 484 | Viper Energy Inc               | Viper 能源股份有限公司              | VNOM UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,168 | 411,994.23 | 0.01 |
| 485 | Grand Canyon Education Inc     | Grand Canyon 教育股份有限公司       | LOPE UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 346   | 407,401.13 | 0.01 |
| 486 | Molina Healthcare Inc          | Molina Healthcare 股份有限公司    | MOH UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 192   | 401,699.29 | 0.01 |
| 487 | Las Vegas Sands Corp           | 拉斯维加斯金沙公司                   | LVS UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 1,082 | 399,470.31 | 0.01 |
| 488 | NU Holdings Ltd/Cayman Islands | NU 控股有限公司/开曼群岛              | NU UN   | 纽约证券交易所   | 美国 | 5,304 | 394,998.55 | 0.01 |
| 489 | Dell Technologies Inc          | 戴尔科技公司                      | DELL UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 474   | 392,657.44 | 0.01 |
| 490 | MKS Instruments Inc            | MKS Instruments 股份有限公司      | MKSI UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 498   | 373,697.74 | 0.01 |
| 491 | Ryan Specialty Holdings Inc    | Ryan Specialty 控股股份有限公司     | RYAN UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 810   | 373,578.27 | 0.01 |
| 492 | Builders FirstSource Inc       | Builders FirstSource 股份有限公司 | BLDR UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 349   | 358,575.87 | 0.01 |

|     |                                     |                      |         |           |    |       |            |      |
|-----|-------------------------------------|----------------------|---------|-----------|----|-------|------------|------|
| 493 | UiPath Inc                          | UiPath 股份有限公司        | PATH UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 3,917 | 357,875.00 | 0.01 |
| 494 | Primerica Inc                       | Primerica 股份有限公司     | PRI UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 179   | 349,242.52 | 0.01 |
| 495 | BGC Group Inc                       | BGC Group Inc        | BGC UW  | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 5,146 | 335,143.05 | 0.00 |
| 496 | Newell Brands Inc                   | 纽威尔品牌公司              | NWL UW  | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 4,598 | 329,200.54 | 0.00 |
| 497 | American Airlines Group Inc         | 美国航空集团股份有限公司         | AAL UW  | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 2,563 | 321,128.04 | 0.00 |
| 498 | Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc | Ollie's 折扣商店控股股份有限公司 | OLLI UQ | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 373   | 294,216.11 | 0.00 |
| 499 | CNX Resources Corp                  | CNX 资源公司             | CNX UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 1,071 | 282,314.13 | 0.00 |
| 500 | CEVA Inc                            | CEVA 股份有限公司          | CEVA UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,243 | 281,904.97 | 0.00 |
| 501 | Cantaloupe Inc                      | Cantaloupe 股份有限公司    | CTLP UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 4,056 | 277,274.99 | 0.00 |
| 502 | Liquidity Services Inc              | 流动性服务股份有限公司          | LQDT UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,141 | 264,841.43 | 0.00 |
| 503 | Acuity Brands Inc                   | Acuity Brands 股份有限公司 | AYI UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 125   | 262,493.41 | 0.00 |
| 504 | Roku Inc                            | Roku 股份有限公司          | ROKU UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 489   | 261,314.59 | 0.00 |

|     |                                |                              |         |           |    |       |            |      |
|-----|--------------------------------|------------------------------|---------|-----------|----|-------|------------|------|
| 505 | Champion Homes Inc             | Champion Homes 股份有限公司        | SKY UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 412   | 260,918.79 | 0.00 |
| 506 | United Natural Foods Inc       | 联合天然食品股份有限公司                 | UNFI UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 1,300 | 255,209.77 | 0.00 |
| 507 | C3.ai Inc                      | C3.ai Inc                    | AI UN   | 纽约证券交易所   | 美国 | 1,027 | 254,179.02 | 0.00 |
| 508 | JetBlue Airways Corp           | 捷蓝航空公司                       | JBLU UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 4,299 | 242,897.04 | 0.00 |
| 509 | American Electric Power Co Inc | 美国电力                         | AEP UW  | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 362   | 240,000.98 | 0.00 |
| 510 | ICU Medical Inc                | ICU 医疗股份有限公司                 | ICUI UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 214   | 238,700.74 | 0.00 |
| 511 | Diamondback Energy Inc         | Diamondback 能源股份有限公司         | FANG UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 202   | 237,890.47 | 0.00 |
| 512 | Duolingo Inc                   | 多邻国                          | DUOL UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 102   | 237,730.88 | 0.00 |
| 513 | Beacon Roofing Supply Inc      | Beacon Roofing Supply 股份有限公司 | BECN UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 322   | 235,123.65 | 0.00 |
| 514 | Shake Shack Inc                | Shake Shack 股份有限公司           | SHAK UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 243   | 226,732.20 | 0.00 |
| 515 | SharkNinja Inc                 | SharkNinja                   | SN UN   | 纽约证券交易所   | 美国 | 307   | 214,857.83 | 0.00 |

|     |                               | Inc                      |         | 所         |    |     |            |      |
|-----|-------------------------------|--------------------------|---------|-----------|----|-----|------------|------|
| 516 | Renaissance Holdings Ltd      | 复兴再保险控股公司                | RNR UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 113 | 202,105.68 | 0.00 |
| 517 | Adobe Inc                     | 奥多比                      | ADBE UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 62  | 198,185.34 | 0.00 |
| 518 | NIKE Inc                      | 耐克公司                     | NKE UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 362 | 196,908.53 | 0.00 |
| 519 | Intercontinental Exchange Inc | 洲际交易所 (ICE)              | ICE UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 182 | 194,948.11 | 0.00 |
| 520 | Vertex Pharmaceuticals Inc    | 福泰制药                     | VRTX UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 67  | 193,949.50 | 0.00 |
| 521 | Agilent Technologies Inc      | 安捷伦                      | A UN    | 纽约证券交易所   | 美国 | 187 | 180,583.97 | 0.00 |
| 522 | Enstar Group Ltd              | Enstar 集团有限公司            | ESGR UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 76  | 175,941.84 | 0.00 |
| 523 | Corebridge Financial Inc      | Corebridge Financial Inc | CRBG UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 756 | 162,652.50 | 0.00 |
| 524 | Pennant Group Inc/The         | Pennant Group Inc/The    | PNTG UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 846 | 161,278.37 | 0.00 |
| 525 | Starbucks Corp                | 星巴克                      | SBUX UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 244 | 160,049.73 | 0.00 |
| 526 | Korn Ferry                    | 光辉国际                     | KFY UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 322 | 156,124.14 | 0.00 |
| 527 | TransDigm Group Inc           | TransDigm 集团公司           | TDG UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 17  | 154,865.16 | 0.00 |

|     |                                      |                                |         |           |    |       |            |      |
|-----|--------------------------------------|--------------------------------|---------|-----------|----|-------|------------|------|
| 528 | Airbnb Inc                           | 爱彼迎股份有限公司                      | ABNB UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 157   | 148,306.54 | 0.00 |
| 529 | Textron Inc                          | 德事隆                            | TXT UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 262   | 144,058.27 | 0.00 |
| 530 | Select Medical Holdings Corp         | Select Medical 控股公司            | SEM UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 1,047 | 141,869.90 | 0.00 |
| 531 | Benchmark Electronics Inc            | 基准电子有限公司                       | BHE UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 430   | 140,331.94 | 0.00 |
| 532 | Federal Signal Corp                  | 联邦信号公司                         | FSS UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 209   | 138,804.48 | 0.00 |
| 533 | Freeport-McMoRan Inc                 | 自由港迈克墨伦股份有限公司                  | FCX UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 494   | 135,224.73 | 0.00 |
| 534 | GE Healthcare Technologies Inc       | GE Healthcare Technologies Inc | GEHC UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 237   | 133,191.42 | 0.00 |
| 535 | Kirby Corp                           | Kirby 公司                       | KEX UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 172   | 130,811.63 | 0.00 |
| 536 | Bright Horizons Family Solutions Inc | 光明地平线家庭解决方案股份有限公司              | BFAM UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 163   | 129,883.96 | 0.00 |
| 537 | Alibaba Group Holding Ltd            | 阿里巴巴集团控股有限公司                   | BABA UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 196   | 119,462.87 | 0.00 |
| 538 | UnitedHealth Group Inc               | 联合健康集团                         | UNH UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 30    | 109,089.72 | 0.00 |
| 539 | Terawulf                             | Terawu                         | WULF UR | 纳斯达克      | 美国 | 2,617 | 106,476.16 | 0.00 |

|         |                               |                                  |         |                   |    |     |            |      |
|---------|-------------------------------|----------------------------------|---------|-------------------|----|-----|------------|------|
| 9       | Inc                           | lf Inc                           |         | 克证券<br>交易所        |    |     |            |      |
| 54<br>0 | Mr Cooper<br>Group Inc        | Mr<br>Cooper<br>集团股<br>份有限<br>公司 | COOP UR | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 149 | 102,833.58 | 0.00 |
| 54<br>1 | H&R Block<br>Inc              | H&R<br>Block<br>股份有<br>限公司       | HRB UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 270 | 102,555.47 | 0.00 |
| 54<br>2 | Tractor<br>Supply Co          | 拖拉机<br>供应公<br>司                  | TSCO UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 260 | 99,168.29  | 0.00 |
| 54<br>3 | GeneDx<br>Holdings<br>Corp    | GeneDx<br>Holdin<br>gs Corp      | WGS UW  | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 165 | 91,162.57  | 0.00 |
| 54<br>4 | Phillips<br>66                | Philli<br>ps 66                  | PSX UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 109 | 89,268.21  | 0.00 |
| 54<br>5 | Novo<br>Nordisk<br>A/S        | 诺和诺<br>德公司                       | NVO UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 144 | 89,041.85  | 0.00 |
| 54<br>6 | FNB<br>Corp/PA                | FNB/宾<br>州                       | FNB UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 778 | 82,658.26  | 0.00 |
| 54<br>7 | Tetra<br>Tech Inc             | Tetra<br>科技股<br>份有限<br>公司        | TTEK UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 280 | 80,188.04  | 0.00 |
| 54<br>8 | Danaher<br>Corp               | 丹纳赫                              | DHR UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 34  | 56,103.31  | 0.00 |
| 54<br>9 | Organon &<br>Co               | Organo<br>n & Co                 | OGN UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 516 | 55,341.48  | 0.00 |
| 55<br>0 | T Rowe<br>Price Gr<br>oup Inc | 普徕仕                              | TROW UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 62  | 50,402.04  | 0.00 |
| 55<br>1 | Amgen Inc                     | 安进公<br>司                         | AMGN UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 22  | 41,218.86  | 0.00 |
| 55      | Arcosa                        | Arcosa                           | ACA UN  | 纽约证               | 美国 | 57  | 39,638.13  | 0.00 |

|     |                              |                              |         |           |    |     |           |      |
|-----|------------------------------|------------------------------|---------|-----------|----|-----|-----------|------|
| 2   | Inc                          | Inc                          |         | 券交易所      |    |     |           |      |
| 553 | Cirrus Logic Inc             | Cirrus Logic 股份有限公司          | CRUS UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 46  | 32,927.76 | 0.00 |
| 554 | Ross Stores Inc              | 罗斯百货股份有限公司                   | ROST UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 30  | 32,621.68 | 0.00 |
| 555 | Prudential Financial Inc     | 保德信金融集团                      | PRU UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 33  | 28,117.35 | 0.00 |
| 556 | PG&E Corp                    | 太平洋煤气电力                      | PCG UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 171 | 24,805.59 | 0.00 |
| 557 | Casella Waste Systems Inc    | Casella 废物处理系统股份有限公司         | CWST UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 32  | 24,339.35 | 0.00 |
| 558 | Eastman Chemical Co          | 伊士曼化工                        | EMN UN  | 纽约证券交易所   | 美国 | 36  | 23,632.01 | 0.00 |
| 559 | Protagonist Therapeutics Inc | Protagonist Therapeutics Inc | PTGX UQ | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 80  | 22,197.78 | 0.00 |
| 560 | Red Rock Resorts Inc         | 红岩赌场度假村股份有限公司                | RRR UW  | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 61  | 20,275.89 | 0.00 |
| 561 | QIAGEN NV                    | 德国 QIAGEN 公共有限公司             | QGEN UN | 纽约证券交易所   | 美国 | 62  | 19,846.17 | 0.00 |
| 562 | Skyworks Solutions Inc       | 思佳讯解决方案公司                    | SWKS UW | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 19  | 12,111.88 | 0.00 |
| 56  | Pfizer                       | 辉瑞制                          | PFE UN  | 纽约证       | 美国 | 58  | 11,061.08 | 0.00 |

|         |                               |                                      |         |                   |    |    |          |      |
|---------|-------------------------------|--------------------------------------|---------|-------------------|----|----|----------|------|
| 3       | Inc                           | 药                                    |         | 券交易<br>所          |    |    |          |      |
| 56<br>4 | Qorvo Inc                     | Qorvo<br>股份有<br>限公司                  | QRVO UW | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 14 | 7,037.59 | 0.00 |
| 56<br>5 | Southern<br>Copper<br>Corp    | 南方铜<br>业公司                           | SCCO UN | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 6  | 3,930.47 | 0.00 |
| 56<br>6 | Home Ban<br>cShares<br>Inc/AR | 阿肯色<br>Home<br>BancSh<br>ares 公<br>司 | HOMB UN | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 16 | 3,254.91 | 0.00 |
| 56<br>7 | General<br>Dynamics<br>Corp   | 通用动<br>力                             | GD UN   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1  | 1,894.07 | 0.00 |
| 56<br>8 | Dow Inc                       | 陶氏公<br>司                             | DOW UN  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1  | 288.47   | 0.00 |

注：本表所使用的证券代码为彭博代码。

## 8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 8.5.1 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<br>值比例(%) |
|----|----------------------------------------------------|----------|----------------|--------------------|
| 1  | Apple Inc                                          | AAPL UW  | 443,174,210.59 | 29.73              |
| 2  | Alphabet Inc                                       | GOOG UW  | 185,557,726.09 | 12.45              |
| 2  | Alphabet Inc                                       | GOOGL UW | 163,077,761.43 | 10.94              |
| 3  | Amazon.com Inc                                     | AMZN UW  | 319,379,927.34 | 21.42              |
| 4  | Microsoft Corp                                     | MSFT UW  | 297,937,265.50 | 19.98              |
| 5  | NVIDIA Corp                                        | NVDA UW  | 257,499,188.03 | 17.27              |
| 6  | Meta Platforms Inc                                 | META UW  | 207,600,904.60 | 13.93              |
| 7  | Tesla Inc                                          | TSLA UW  | 171,323,374.00 | 11.49              |
| 8  | Broadcom Inc                                       | AVGO UW  | 160,290,611.25 | 10.75              |
| 9  | Eli Lilly & Co                                     | LLY UN   | 127,483,645.61 | 8.55               |
| 10 | Taiwan<br>Semiconductor<br>Manufacturing Co<br>Ltd | TSM UN   | 98,565,930.89  | 6.61               |
| 11 | Netflix Inc                                        | NFLX UW  | 78,954,845.60  | 5.30               |
| 12 | Costco Wholesale<br>Corp                           | COST UW  | 78,540,220.66  | 5.27               |
| 13 | Salesforce Inc                                     | CRM UN   | 65,172,301.80  | 4.37               |

|    |                            |          |               |      |
|----|----------------------------|----------|---------------|------|
| 14 | Mastercard Inc             | MA UN    | 64,070,300.27 | 4.30 |
| 15 | Oracle Corp                | ORCL UN  | 56,567,149.20 | 3.79 |
| 16 | QUALCOMM Inc               | QCOM UW  | 53,431,240.15 | 3.58 |
| 17 | Celestica Inc              | CLS UN   | 52,132,901.03 | 3.50 |
| 18 | AbbVie Inc                 | ABBV UN  | 47,595,035.85 | 3.19 |
| 19 | Berkshire Hathaway Inc     | BRK/B UN | 46,056,618.20 | 3.09 |
| 20 | GE Vernova Inc             | GEV UN   | 45,400,729.08 | 3.05 |
| 21 | General Electric Co        | GE UN    | 42,846,487.82 | 2.87 |
| 22 | ServiceNow Inc             | NOW UN   | 42,033,707.41 | 2.82 |
| 23 | Deckers Outdoor Corp       | DECK UN  | 41,357,159.51 | 2.77 |
| 24 | Walmart Inc                | WMT UN   | 39,972,637.74 | 2.68 |
| 25 | Vertiv Holdings Co         | VRT UN   | 39,024,952.10 | 2.62 |
| 26 | Advanced Micro Devices Inc | AMD UW   | 37,627,895.03 | 2.52 |
| 27 | Marvell Technology Inc     | MRVL UW  | 37,493,951.31 | 2.51 |
| 28 | Lam Research Corp          | LRCX UW  | 35,208,367.39 | 2.36 |
| 29 | Visa Inc                   | V UN     | 34,923,279.60 | 2.34 |
| 30 | American Express Co        | AXP UN   | 33,565,106.19 | 2.25 |
| 31 | Home Depot Inc/The         | HD UN    | 33,397,132.02 | 2.24 |
| 32 | SAP SE                     | SAP UN   | 32,882,848.48 | 2.21 |
| 33 | GoDaddy Inc                | GDDY UN  | 31,889,543.25 | 2.14 |
| 34 | Arista Networks Inc        | ANET UN  | 31,868,541.49 | 2.14 |
| 35 | Intuitive Surgical Inc     | ISRG UW  | 31,451,420.80 | 2.11 |
| 36 | Palantir Technologies Inc  | PLTR UW  | 31,381,883.63 | 2.10 |
| 37 | ASML Holding NV            | ASML UW  | 30,875,748.87 | 2.07 |
| 38 | Palo Alto Networks Inc     | PANW UW  | 30,271,477.99 | 2.03 |

### 8.5.2 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 UW  | 96,438,933.66 | 6.47           |
| 2  | Apple Inc      | AAPL UW  | 76,784,360.96 | 5.15           |
| 3  | Microsoft Corp | MSFT UW  | 71,042,260.02 | 4.77           |
| 4  | Alphabet Inc   | GOOGL UW | 58,068,419.65 | 3.90           |
| 4  | Alphabet Inc   | GOOG UW  | 7,825,268.58  | 0.52           |
| 5  | Eli Lilly & Co | LLY UN   | 65,631,957.65 | 4.40           |
| 6  | Amazon.com Inc | AMZN UW  | 53,351,998.84 | 3.58           |

|    |                                           |          |               |      |
|----|-------------------------------------------|----------|---------------|------|
| 7  | General Electric Co                       | GE UN    | 44,574,852.68 | 2.99 |
| 8  | Advanced Micro Devices Inc                | AMD UW   | 41,783,316.68 | 2.80 |
| 9  | Tesla Inc                                 | TSLA UW  | 40,963,501.04 | 2.75 |
| 10 | Adobe Inc                                 | ADBE UW  | 39,861,218.46 | 2.67 |
| 11 | AbbVie Inc                                | ABBV UN  | 38,646,680.71 | 2.59 |
| 12 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | TSM UN   | 37,821,941.30 | 2.54 |
| 13 | Home Depot Inc/The                        | HD UN    | 37,391,347.07 | 2.51 |
| 14 | UnitedHealth Group Inc                    | UNH UN   | 33,164,880.44 | 2.22 |
| 15 | Visa Inc                                  | V UN     | 27,762,541.94 | 1.86 |
| 16 | ASML Holding NV                           | ASML UW  | 27,107,688.13 | 1.82 |
| 17 | Berkshire Hathaway Inc                    | BRK/B UN | 27,048,976.19 | 1.81 |
| 18 | Mastercard Inc                            | MA UN    | 24,678,137.52 | 1.66 |
| 19 | Dell Technologies Inc                     | DELL UN  | 24,603,034.07 | 1.65 |
| 20 | Celestica Inc                             | CLS UN   | 24,582,008.10 | 1.65 |

### 8.5.3 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 | 7,747,988,256.17 |
| 卖出收入（成交）总额 | 3,556,687,544.69 |

注：8.5.1 项“买入金额”、8.5.2 项“卖出金额”及 8.5.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

### 8.7 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。

### 8.8 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。

### 8.9 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。

### 8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 基金名称                                                             | 基金类型 | 运作方式       | 管理人                                          | 公允价值             | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) |
|----|------------------------------------------------------------------|------|------------|----------------------------------------------|------------------|----------------------|
| 1  | Invesco<br>QQQ Trust<br>Series 1                                 | ETF  | 交易型开放<br>式 | Invesco<br>Capital<br>Management<br>LLC      | 2,326,227.<br>99 | 0.03                 |
| 2  | Invesco<br>S&P<br>Spin-Off<br>ETF                                | ETF  | 交易型开放<br>式 | Invesco<br>Capital<br>Management<br>LLC      | 2,197,028.<br>07 | 0.03                 |
| 3  | Technology<br>Select<br>Sector<br>SPDR Fund                      | ETF  | 交易型开放<br>式 | SSgA Funds<br>Management<br>Inc              | 1,584,531.<br>54 | 0.02                 |
| 4  | SPDR Gold<br>Shares                                              | ETF  | 交易型开放<br>式 | State<br>Street<br>Global<br>Advisors<br>Inc | 1,521,220.<br>85 | 0.02                 |
| 5  | ARK<br>Autonomous<br>Technology<br>& Robotics<br>ETF             | ETF  | 交易型开放<br>式 | ARK<br>Investment<br>Management<br>LLC       | 1,085,063.<br>82 | 0.02                 |
| 6  | VanEck<br>Gold<br>Miners<br>ETF/USA                              | ETF  | 交易型开放<br>式 | Van Eck<br>Associates<br>Corp                | 657,173.30       | 0.01                 |
| 7  | iShares<br>Russell<br>1000 Value<br>ETF                          | ETF  | 交易型开放<br>式 | BlackRock<br>Fund<br>Advisors                | 507,030.42       | 0.01                 |
| 8  | iPath<br>Series B<br>S&P 500 VIX<br>Short-Term<br>Futures<br>ETN | ETN  | 交易型开放<br>式 | Barclays<br>Capital<br>Inc                   | 388,160.66       | 0.01                 |
| 9  | Global X<br>Artificial<br>Intelligen<br>ce &<br>Technology       | ETF  | 交易型开放<br>式 | Global X<br>Management<br>Co LLC             | 346,088.68       | 0.01                 |

|    |                                                   |     |            |                                                   |            |      |
|----|---------------------------------------------------|-----|------------|---------------------------------------------------|------------|------|
|    | ETF                                               |     |            |                                                   |            |      |
| 10 | iMGP DBi<br>Managed<br>Futures<br>Strategy<br>ETF | ETF | 交易型开放<br>式 | iM Global<br>Partner<br>Fund<br>Management<br>LLC | 198,015.12 | 0.00 |

## 8.11 投资组合报告附注

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

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 8.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 8.11.3 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  | 1,077,773.30  |
| 4  | 应收利息  | -             |
| 5  | 应收申购款 | 55,354,353.78 |
| 6  | 其他应收款 | -             |
| 7  | 待摊费用  | -             |
| 8  | 其他    | -             |
| 9  | 合计    | 56,432,127.08 |

### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人 | 户均持有的基 | 持有人结构 |
|------|-----|--------|-------|
|------|-----|--------|-------|

|                                      | 户数<br>(户) | 金份额      | 机构投资者         |                   | 个人投资者            |                   |
|--------------------------------------|-----------|----------|---------------|-------------------|------------------|-------------------|
|                                      |           |          | 持有份额          | 占总份<br>额比例<br>(%) | 持有份额             | 占总份<br>额比例<br>(%) |
| 嘉实美国<br>成长股票<br>型证券投资<br>基金-<br>人民币  | 478,861   | 2,800.07 | 71,051,073.90 | 5.30              | 1,269,794,584.30 | 94.70             |
| 嘉实美国<br>成长股票<br>型证券投资<br>基金-<br>美元现汇 | 884       | 4,713.27 | -             | -                 | 4,166,527.16     | 100.00            |
| 合计                                   | 479,494   | 2,805.07 | 71,051,073.90 | 5.28              | 1,273,961,111.46 | 94.72             |

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别                 | 持有份额总数（份）    | 占基金总份额比例（%） |
|------------------|----------------------|--------------|-------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币  | 1,163,708.78 | 0.09        |
|                  | 嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇 | 130.06       | 0.00        |
|                  | 合计                   | 1,163,838.84 | 0.09        |

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 份额级别                 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|----------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币  | 0~10              |
|                                | 嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇 | 0                 |
|                                | 合计                   | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币  | 0~10              |
|                                | 嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇 | 0                 |
|                                | 合计                   | 0~10              |

#### 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无。

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                     | 嘉实美国成长股票型证券投资基金<br>-人民币 | 嘉实美国成长股票型证券投资基金<br>-美元现汇 |
|----------------------------------------|-------------------------|--------------------------|
| 基金合同生效日<br>(2013 年 6 月 14 日)<br>基金份额总额 | 430,245,997.74          | 7,592,329.66             |
| 本报告期期初基金份额总额                           | 373,719,810.71          | 4,460,681.52             |
| 本报告期基金总申购份额                            | 1,797,789,269.39        | 1,515,001.51             |
| 减：本报告期基金总赎回份额                          | 830,663,421.90          | 1,809,155.87             |
| 本报告期基金拆分变动份额                           | —                       | —                        |
| 本报告期期末基金份额总额                           | 1,340,845,658.20        | 4,166,527.16             |

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

### § 11 重大事件揭示

#### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

#### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

##### (1) 基金管理人的重大人事变动情况

2024 年 8 月 9 日本基金管理人发布公告，赵学军先生辞任公司董事长，由联席董事长安国勇先生代行公司董事长职责。

2024 年 9 月 19 日本基金管理人发布公告，安国勇先生任公司董事长。

2024 年 12 月 4 日本基金管理人发布公告，张峰先生离任公司副总经理、郭杰先生离任机构首席投资官。

2024 年 12 月 19 日本基金管理人发布公告，鲁令飞先生任公司副总经理、张敏女士任公司副总经理。

##### (2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

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

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、本基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）会计师事务所为本基金提供审计服务，自 2024 年 11 月 16 日起，改聘容诚会计师事务所（特殊普通合伙）会计师事务所为本基金提供审计服务。报告年度应支付容诚会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费 48,000.00 元，该审计机构第 1 年提供审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 11.6.2 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称                                                             | 交易单元数量 | 股票交易              |                  | 应支付该券商的佣金    |                | 备注 |
|------------------------------------------------------------------|--------|-------------------|------------------|--------------|----------------|----|
|                                                                  |        | 成交金额              | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金           | 占当期佣金总量的比例 (%) |    |
| 野村证券<br>NOMURA                                                   | —      | 10,555,154,767.61 | 93.62            | 4,388,791.50 | 96.87          | —  |
| 招商证券<br>(香港)有限公司<br>China Merchants Securities<br>(HK) Co., Ltd. | —      | 666,376,118.00    | 5.91             | 132,524.81   | 2.93           | —  |

|                                                                            |   |                   |      |          |      |   |
|----------------------------------------------------------------------------|---|-------------------|------|----------|------|---|
| 瑞银集团<br>Union<br>Bank of<br>Switzerla<br>nd                                | - | 52,903,155.4<br>0 | 0.47 | 9,247.66 | 0.20 | - |
| Wolfe<br>Research<br>Securitie<br>s                                        | - | -                 | -    | -        | -    | - |
| 德意志银<br>行股份有<br>限公司<br>Deutsche<br>Bank                                    | - | -                 | -    | -        | -    | - |
| 花旗环球<br>金融亚洲<br>有限公司<br>Citigroup<br>Global<br>Marke<br>ts Asia<br>Limited | - | -                 | -    | -        | -    | - |
| 金贝塔证<br>券有限公<br>司<br>iGoldenbe<br>ta Sec<br>urities<br>Company<br>Limited  | - | -                 | -    | -        | -    | - |
| 麦格理资<br>本证券股<br>份有限公<br>司<br>Macquarie<br>Secur<br>ities Gr<br>oup         | - | -                 | -    | -        | -    | - |
| 瑞士信贷<br>(香港)有<br>限公司<br>Credit S<br>uisse<br>(Hong Ko<br>ng) Limi          | - | -                 | -    | -        | -    | - |

|                                                                                        |   |   |   |   |   |   |
|----------------------------------------------------------------------------------------|---|---|---|---|---|---|
| ted                                                                                    |   |   |   |   |   |   |
| 中信证券<br>国际有限<br>公司<br>CITIC Se<br>curities<br>Inter<br>national<br>Company<br>Limited  | - | - | - | - | - | - |
| 麦格理银<br>行有限公<br>司香港分<br>行<br>Macquaire<br>Bank<br>Limited<br>Hong K<br>ong Bran<br>ch. | - | - | - | - | - | - |

注：1. 本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

2. 交易单元的选择标准和程序

- （1）经营行为规范；
- （2）财务状况良好；
- （3）合规风控能力较强；
- （4）研究、交易等服务能力较强；

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

3. 本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致；本公司网站披露的《嘉实基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）》的报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日。敬请投资者关注上述报告统计时间区间的口径差异。

11. 7. 2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 |    | 债券回购交易 |    | 权证交易 |    | 基金交易 |    |
|------|------|----|--------|----|------|----|------|----|
|      | 成交   | 占当 | 成交     | 占当 | 成交   | 占当 | 成交金额 | 占当 |

|                                                              | 金<br>额 | 期<br>债<br>券<br>成<br>交<br>总<br>额<br>的<br>比<br>例<br>(%) | 金<br>额 | 期<br>债<br>券<br>回<br>购<br>成<br>交<br>总<br>额<br>的<br>比<br>例<br>(%) | 金<br>额 | 期<br>权<br>证<br>成<br>交<br>总<br>额<br>的<br>比<br>例<br>(%) |               | 期<br>基<br>金<br>成<br>交<br>总<br>额<br>的<br>比<br>例<br>(%) |
|--------------------------------------------------------------|--------|-------------------------------------------------------|--------|-----------------------------------------------------------------|--------|-------------------------------------------------------|---------------|-------------------------------------------------------|
| 野村证券 NOMURA                                                  | -      | -                                                     | -      | -                                                               | -      | -                                                     | 80,058,199.99 | 96.61                                                 |
| 招商证券（香港）有限公司<br>China Merchants Securities<br>(HK) Co., Ltd. | -      | -                                                     | -      | -                                                               | -      | -                                                     | 2,810,423.96  | 3.39                                                  |
| 瑞银集团 Union Bank of Switzerland                               | -      | -                                                     | -      | -                                                               | -      | -                                                     | -             | -                                                     |
| Wolfe Research Securities                                    | -      | -                                                     | -      | -                                                               | -      | -                                                     | -             | -                                                     |
| 德意志银行股份有限公司 Deutsche Bank                                    | -      | -                                                     | -      | -                                                               | -      | -                                                     | -             | -                                                     |
| 花旗环球金融亚洲有限公司<br>Citigroup Global Markets Asia Limited        | -      | -                                                     | -      | -                                                               | -      | -                                                     | -             | -                                                     |
| 金贝塔证券有限公司<br>iGoldenbeta Securities Company Limited          | -      | -                                                     | -      | -                                                               | -      | -                                                     | -             | -                                                     |
| 麦格理资本证券股份有限公司<br>Macquarie Securities Group                  | -      | -                                                     | -      | -                                                               | -      | -                                                     | -             | -                                                     |
| 瑞士信贷（香港）有限公司 Credit Suisse<br>(Hong Kong) Limited            | -      | -                                                     | -      | -                                                               | -      | -                                                     | -             | -                                                     |
| 中信证券国际有限公司<br>CITIC Securities International Company Limited | -      | -                                                     | -      | -                                                               | -      | -                                                     | -             | -                                                     |
| 麦格理银行有限公司香港分行<br>Macquarie Bank Limited Hong Kong Branch.    | -      | -                                                     | -      | -                                                               | -      | -                                                     | -             | -                                                     |

### 11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                           | 法定披露方式                     | 法定披露日期          |
|----|------------------------------------------------|----------------------------|-----------------|
| 1  | 关于嘉实美国成长股票（QDII）2024 年 1 月 15 日暂停申购、赎回及定投业务的公告 | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024 年 1 月 11 日 |

|    |                                                     |                            |                  |
|----|-----------------------------------------------------|----------------------------|------------------|
| 2  | 关于嘉实美国成长股票（QDII）2024 年 2 月 19 日暂停申购、赎回及定投业务的公告      | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024 年 2 月 7 日   |
| 3  | 嘉实美国成长股票型证券投资基金暂停大额申购（含定期定额投资）业务的公告                 | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024 年 3 月 23 日  |
| 4  | 关于嘉实美国成长股票（QDII）2024 年 3 月 29 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告  | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024 年 3 月 27 日  |
| 5  | 关于嘉实美国成长股票（QDII）2024 年 5 月 27 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告  | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024 年 5 月 23 日  |
| 6  | 关于嘉实美国成长股票（QDII）2024 年 6 月 19 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告  | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024 年 6 月 17 日  |
| 7  | 关于嘉实美国成长股票（QDII）2024 年 7 月 4 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告   | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024 年 7 月 2 日   |
| 8  | 嘉实美国成长股票型证券投资基金调整大额申购（含定期定额投资）业务的公告                 | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024 年 7 月 12 日  |
| 9  | 关于嘉实美国成长股票（QDII）2024 年 9 月 2 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告   | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024 年 8 月 29 日  |
| 10 | 嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告                                | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024 年 9 月 19 日  |
| 11 | 嘉实美国成长股票型证券投资基金调整大额申购（含定期定额投资）业务的公告                 | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024 年 11 月 14 日 |
| 12 | 嘉实基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告                         | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024 年 11 月 16 日 |
| 13 | 关于嘉实美国成长股票（QDII）2024 年 11 月 28 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告 | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024 年 11 月 26 日 |
| 14 | 嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告                                | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024 年 12 月 4 日  |
| 15 | 嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告                                | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024 年 12 月 19 日 |
| 16 | 关于嘉实美国成长股票（QDII）2024 年 12 月 25 日暂停申购、赎回及定期          | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金       | 2024 年 12 月 23 日 |

|    |                                     |                            |                  |
|----|-------------------------------------|----------------------------|------------------|
|    | 定额投资业务的公告                           | 电子披露网站                     |                  |
| 17 | 嘉实美国成长股票型证券投资基金调整大额申购（含定期定额投资）业务的公告 | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024 年 12 月 26 日 |

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

- (1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。
  - (2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>
- 投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发 E-mail: [service@jsfund.cn](mailto:service@jsfund.cn)。

嘉实基金管理有限公司  
2025 年 3 月 28 日