

大成标普 500 等权重指数证券投资基金
2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料已经审计。容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§ 6 审计报告	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	23
§ 8 投资组合报告	51

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	52
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	103
§ 9 基金份额持有人信息	104
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	104
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	105
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	105
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	105
§ 10 开放式基金份额变动	105
§ 11 重大事件揭示	106
11.1 基金份额持有人大会决议	106
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	106
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	106
11.4 基金投资策略的改变	106
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	106
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	107
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	107
11.8 其他重大事件	108
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	111
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	111
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	112
§ 13 备查文件目录	112
13.1 备查文件目录	112
13.2 存放地点	112
13.3 查阅方式	112

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成标普 500 等权重指数证券投资基金	
基金简称	大成标普 500 等权重指数（QDII）	
基金主代码	096001	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011 年 3 月 23 日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	321,984,645.37 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	大成标普 500 等权重指数(QDII)A	大成标普 500 等权重指数(QDII)C
下属分级基金的交 易代码	096001	008401
报告期末下属分级 基金的份额总额	285,403,996.15 份	36,580,649.22 份

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

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	段皓静	许俊
	联系电话	0755-83183388	010-66596688
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		4008885558	95566

传真	0755-83199588	010-66594942
注册地址	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518054	100818
法定代表人	吴庆斌	葛海蛟

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

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

2.5 信息披露方式

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

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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 1001-1 至 1001-26
注册登记机构	大成基金管理有限公司	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 层

§ 3 主要财务指标、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 期间数据和指标	2024 年		2023 年	2023 年 8 月 30 日(基金合同生效日) - 2023 年 12 月 31 日	2022 年
	大成标普 500	大成标普 500	大成标普 500	大成标普 500	大成标普 500

	等权重指数 (QDII)A	等权重指数 (QDII)C	等权重指数 (QDII)A	等权重指数 (QDII)C	等权重指数 (QDII)A
本期已实现收益	32,218,201.19	2,576,201.08	8,266,278.39	-17,179.03	22,412,144.74
本期利润	68,890,479.87	2,923,199.24	49,265,014.99	658,422.73	-14,630,980.20
加权平均基金份额本期利润	0.2648	0.1511	0.2822	0.3938	-0.0903
本期加权平均净值利润率	10.64%	6.01%	12.76%	16.84%	-4.19%
本期基金份额净值增长率	11.63%	11.34%	13.30%	3.78%	-3.91%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末
期末可供分配利润	212,635,159.50	26,923,050.16	126,645,751.79	5,786,784.04	117,034,390.82
期末可供分配基金份额利润	0.7450	0.7360	0.6939	0.6921	0.7183
期末基金资产净值	738,651,461.55	94,516,503.30	435,937,264.25	19,994,894.99	355,103,657.13
期末基金份额净值	2.5881	2.5838	2.3890	2.3910	2.1790
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末
基金份额累计净值增长率	245.61%	15.54%	209.60%	3.78%	173.26%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成标普 500 等权重指数 (QDII)A

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

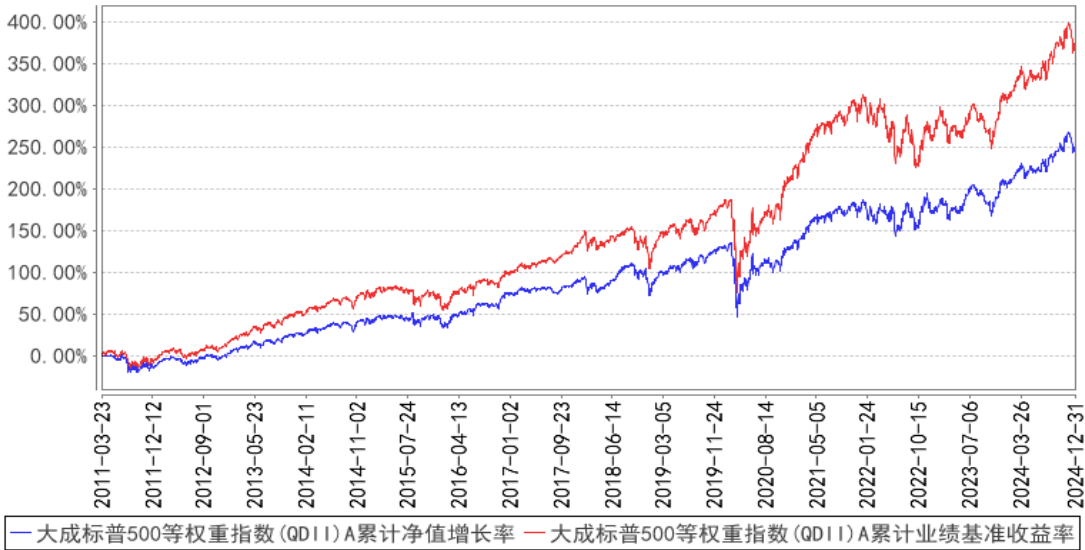
过去三个月	0.26%	0.72%	-1.87%	0.76%	2.13%	-0.04%
过去六个月	7.14%	0.76%	7.55%	0.80%	-0.41%	-0.04%
过去一年	11.63%	0.68%	13.01%	0.72%	-1.38%	-0.04%
过去三年	21.53%	1.00%	13.96%	1.04%	7.57%	-0.04%
过去五年	50.25%	1.35%	66.68%	1.42%	-16.43%	-0.07%
自基金合同生效 起至今	245.61%	1.09%	366.94%	1.15%	-121.33 %	-0.06%

大成标普 500 等权重指数 (QDII) C

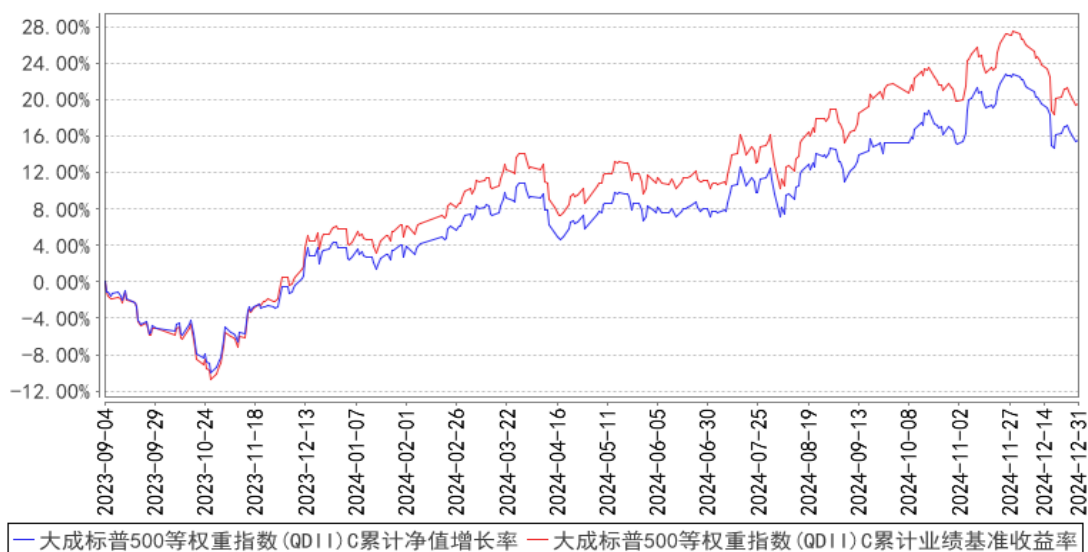
阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.18%	0.72%	-1.87%	0.76%	2.05%	-0.04%
过去六个月	6.97%	0.76%	7.55%	0.80%	-0.58%	-0.04%
过去一年	11.34%	0.68%	13.01%	0.72%	-1.67%	-0.04%
自基金合同生效 起至今	15.54%	0.72%	19.55%	0.76%	-4.01%	-0.04%

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

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



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



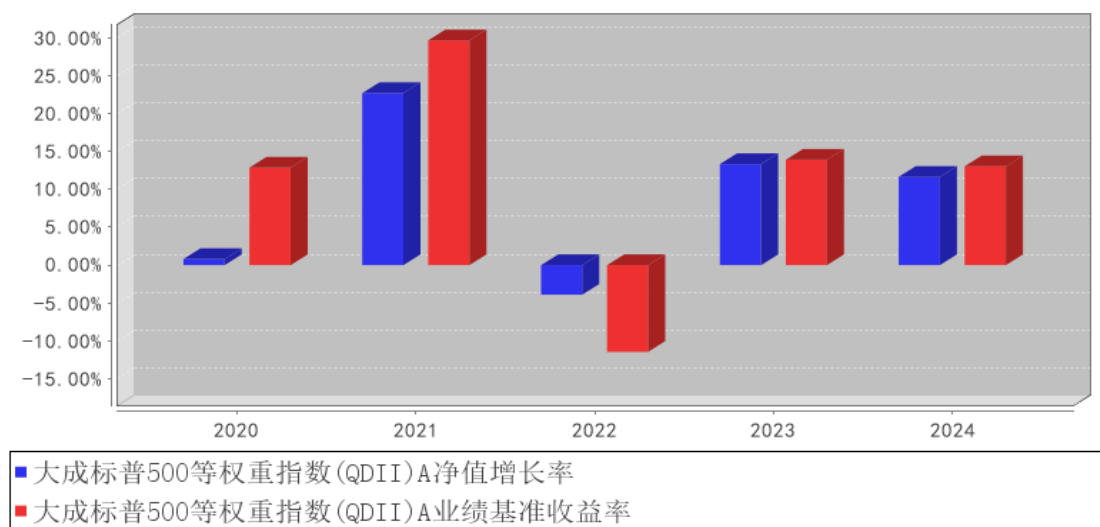
注：1、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

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

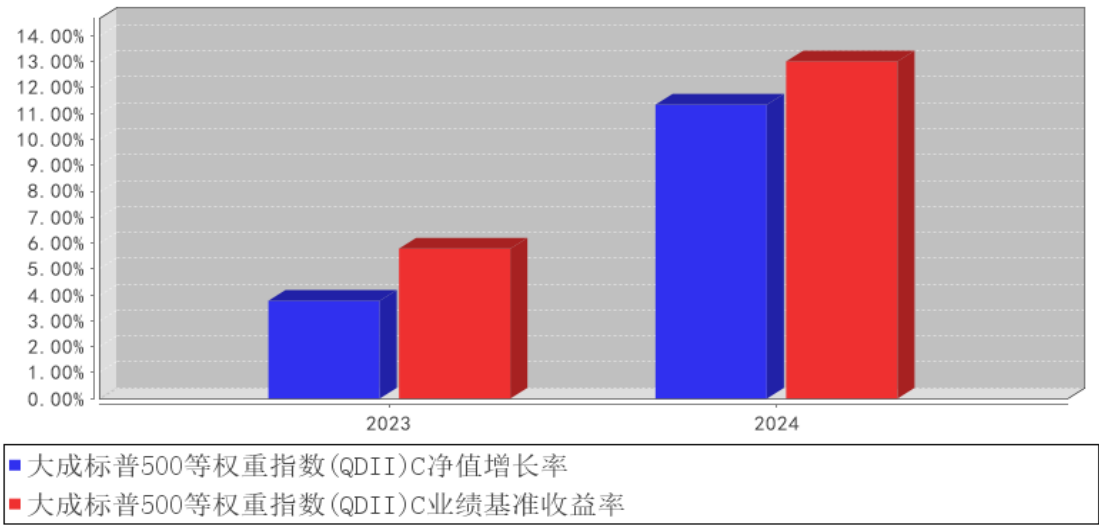
3、同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

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

大成标普500等权重指数(QDII)A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



大成标普500等权重指数(QDII)C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：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

大成标普 500 等权重指数 (QDII) A

年度	每 10 份基金 份额分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配 合计	备注
2024 年	0.6940	11,332,568.59	5,852,471.19	17,185,039.78	—
2023 年	0.7190	6,849,710.71	4,977,348.44	11,827,059.15	—
2022 年	0.6460	6,885,645.16	3,924,155.16	10,809,800.32	—
合计	2.0590	25,067,924.46	14,753,974.79	39,821,899.25	—

大成标普 500 等权重指数 (QDII) C

年度	每 10 份基金 份额分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配 合计	备注
2024 年	0.6922	610,155.69	52,129.22	662,284.91	—
2023 年	—	—	—	—	—
合计	0.6922	610,155.69	52,129.22	662,284.91	—

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司成立于 1999 年 4 月 12 日，注册资本人民币 2 亿元，是中国首批获准

成立的“老十家”基金管理公司之一。公司总部位于深圳，同时设置了北方、华东和南方营销总部，在北京、上海等地开设有 5 家分公司。2009 年，公司在香港设立大成国际资产管理有限公司，大力拓展国际业务；2013 年，设立大成创新资本管理有限公司，开拓专户及专项管理业务。

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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

					基金经理。2021 年 9 月 9 日起任大成恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。2023 年 7 月 12 日起任大成纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金经理。2024 年 5 月 29 日起任大成全球美元债券型证券投资基金(QDII)基金经理。2024 年 6 月 18 日起任大成恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
--	--	--	--	--	---

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.1.4 基金经理薪酬机制

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持，投资部门负责投资决策，交易管理部负责实施交易并实时监控，监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核，风险管理部负责对交易情况进行合理性分析，通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

无。

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未发现存在异常交易行为。公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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% 的交易共 3 次，为完全按照指数的构成比例进行投资的组合和其他组合发生的反向交易。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年，国际经济形势相对较为稳定，美股也取得了较好的涨势。全年美股市场的主要焦点依然围绕着通货膨胀水平、美联储货币政策与经济增长预期展开。

从整体来看，全年美国宏观经济韧性较强，经济软着陆迹象明显。美国 2024 年 4 季度 GDP 同比增速为 2.5%，保持在较佳增长区间。

分项来看，个人消费仍然是经济增长的主要支柱。最新公布的美国 4 季度个人消费实际增长季环比折年率为 4.2%，同样位于较佳增长区间，也仍然是 GDP 增长的重要支柱。

较好的消费是由较好的劳动力市场推动的。美国 4 季度劳动力市场虽然也出现边际降温的迹象，但 2024 年 12 月份失业率为 4.1%，仍然处于低位；同月的非农就业增加人数也远超市场预期，这也为消费的增长提供更多的支撑。

美国总体通胀增速趋稳，但也并未出现大幅下降趋势。美国 12 月份 CPI 同比为 2.9%，同时其工资增速仍然保持在较高位置，这对核心通胀的进一步下降形成了阻碍。

2024 年，美联储开启了降息进程，全年累计降息 100bp，降息行为有效的支持了美股的上行走势。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成标普 500 等权重指数(QDII)A 的基金份额净值为 2.5881 元,本报告期基金份额净值增长率为 11.63%,同期业绩比较基准收益率为 13.01%;截至本报告期末大成标普 500 等权重指数(QDII)C 的基金份额净值为 2.5838 元,本报告期基金份额净值增长率为 11.34%,同期业绩比较基准收益率为 13.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2025 年,预计美国宏观经济能够实现软着陆,全年 GDP 增速有望在 2%左右。同时,总体通胀中枢仍有望轻微下行,美联储也有望会继续降息,但降息次数及幅度较此前的市场预期有所减少。

美股指数涨跌的核心决定因素是上市公司盈利的变动。在经济软着陆的背景下,预期 2025 年美股上市公司盈利仍有较好的增长。但当前美股估值水平稍高于历史平均水平,因此虽然上市公司盈利增长有望推动美股指数的持续走强,但美股增幅有可能低于盈利增速。

本基金的投资目标是要复制基准指数的收益率,因此本基金将坚持被动化的投资理念,持续实施高效的组合管理策略、交易策略及风险控制方法,以期更好地跟踪指数,力争将跟踪误差控制在较低的水平。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,依据相关的法律法规、基金合同以及内部监察稽核制度,本基金管理人对本基金运作、内部管理、制度执行及遵纪守法情况进行了监察稽核。内部监察稽核的重点是:国家法律法规及行业监管规则的执行情况;基金合同的遵守情况;内部规章制度的执行情况;资讯管制和保密工作落实情况;员工职业操守规范情况,目的是规范基金财产的运作,防范和控制投资风险,确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整,维护本基金份额持有人的合法权益。

(一)根据最新的法律法规、规章、规范性文件,本基金管理人及时制定了相应的公司制度,并对现有制度进行不断修订和完善,确保本基金管理人内控制度的适时性、全面性和合法合规性。同时,为保障制度的适时性,避免部分内控制度、业务规则与业务发展不相适应,报告期内本基金管理人组织各部门对内部管理制度作了进一步梳理和完善。

(二)全面加强风险监控,不断提高基金业务风险管理水平。为督促各部门完善并落实各项内控措施,公司严格执行风险控制管理员制度,健全内控工作协调机制及监督机制,并进一步加强投资风险数量化评价能力及事前风险防范能力,有效防范相关业务风险。同时,公司严格执行投资报备制度,建立了基金从业人员证券投资管理监控信息系统,将投资报备工作纳入常态。

(三)日常监察和专项监察相结合,确保监察稽核的有效性和深入性。本年度,公司继续对

本基金销售、宣传等方面的材料、协议及其他法律资料等进行了严格审查，对本基金各项投资比例、投资权限、基金交易、股票投资限制、股票库维护等方面进行实时监控，同时，还专门针对基金投资交易（包括公平交易、转债投资、投资权限、投资比例、流动性风险、基金重仓股等）、基金运营（基金头寸、基金结算、登记清算等）、网上交易、基金销售等进行专项监察。通过日常监察，保证了公司监察的全面性、实时性，通过专项监察，及时发现并纠正了业务中的潜在风险，加强了业务部门和人员的风险意识，从而较好地预防了风险的发生。

（四）加强了对投资管理人员通讯工具在交易时间的集中管理，定期或不定期对投资管理人员的网络即时通讯记录、电话录音等进行抽查，有效的防范了各种形式的利益输送行为。

（五）以多种方式加强合规教育与培训，提高全公司的合规守法意识。及时向全公司传达与基金相关的法律法规，并要求公司各部门贯彻到日常工作中。公司监察稽核部通过解答各业务部门提出的法律问题，提供法律依据，对于较为重大疑难法律事项及时咨询公司外部律师或监管部门，避免了业务发展中的盲目性，及时防范风险，维护了基金份额持有人的利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

各投研部门、风险管理部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；交易管理部负责关注相关投资品种的流动性状况，协助反馈其市场交易信息；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管人沟通估值调整事项；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本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

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	大成标普 500 等权重指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了大成标普 500 等权重指数证券投资基金财务报表，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。 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，公允反映了大成标普 500 等权重指数证券投资基金 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。
形成审计意见的基础	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，我们独立于大成标普 500 等权重指数证券投资基金，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。
其他信息	大成标普 500 等权重指数证券投资基金的基金管理人大成基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2024 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	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。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估大成标普 500 等权重指数证券投资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层计划清算大成标普 500 等权重指数证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督大成标普 500 等权重指数证

	券投资基金的财务报告过程。	
注册会计师对财务报表审计的责任	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。 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： （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。 （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。 （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。 （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，就可能导致对大成标普 500 等权重指数证券投资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大成标普 500 等权重指数证券投资基金不能持续经营。 （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。 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。	
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	陈熹	陶文欣
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 28 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	61,453,622.90	31,359,238.59
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	770,025,843.25	420,451,075.44
其中：股票投资		770,025,843.25	420,451,075.44
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	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		-	5,516,281.79
应收股利		789,805.31	534,003.68
应收申购款		8,850,413.32	2,992,256.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		841,119,684.78	460,852,855.90
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		6,852,047.19	4,264,000.73
应付管理人报酬		705,755.73	369,415.03
应付托管费		176,438.93	92,353.74
应付销售服务费		21,863.15	3,070.83
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	195,614.93	191,856.33
负债合计		7,951,719.93	4,920,696.66
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	321,984,645.37	190,869,817.52
未分配利润	7.4.7.12	511,183,319.48	265,062,341.72
净资产合计		833,167,964.85	455,932,159.24
负债和净资产总计		841,119,684.78	460,852,855.90

注： 报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 321,984,645.37 份，其中大成标普 500 等权重指数(QDII)A 基金份额总额为 285,403,996.15 份，基金份额净值 2.5881 元。大成标普 500 等权重指数(QDII)C 基金份额总额为 36,580,649.22 份，基金份额净值 2.5838 元。

7.2 利润表

会计主体：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		81,121,653.21	55,188,293.79
1. 利息收入		140,357.06	59,027.89
其中：存款利息收入	7.4.7.13	140,357.06	59,027.89
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）		45,844,828.18	13,201,988.08
其中：股票投资收益	7.4.7.14	34,771,688.93	6,393,039.13
基金投资收益	7.4.7.15	-	-
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	11,073,139.25	6,808,948.95
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	37,019,276.84	41,674,338.36
4. 汇兑收益（损失以“-”		-2,107,993.93	101,354.01

号填列)			
5. 其他收入（损失以“-”号填列)	7. 4. 7. 22	225, 185. 06	151, 585. 45
减：二、营业总支出		9, 307, 974. 10	5, 264, 856. 07
1. 管理人报酬	7. 4. 10. 2. 1	6, 950, 982. 95	3, 864, 170. 04
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7. 4. 10. 2. 2	1, 737, 745. 74	966, 042. 50
3. 销售服务费	7. 4. 10. 2. 3	145, 531. 36	3, 650. 32
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		-	-
8. 其他费用	7. 4. 7. 24	473, 714. 05	430, 993. 21
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列)		71, 813, 679. 11	49, 923, 437. 72
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列)		71, 813, 679. 11	49, 923, 437. 72
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		71, 813, 679. 11	49, 923, 437. 72

7.3 净资产变动表

会计主体：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期			
	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	190, 869, 817. 52	-	265, 062, 341. 72	455, 932, 159. 24
二、本期期初净资产	190, 869, 817. 52	-	265, 062, 341. 72	455, 932, 159. 24
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	131, 114, 827. 85	-	246, 120, 977. 76	377, 235, 805. 61
（一）、综合收益总额	-	-	71, 813, 679. 11	71, 813, 679. 11
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数	131, 114, 827. 85	-	192, 154, 623. 34	323, 269, 451. 19

(净资产减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	269,685,517.17	-	398,278,540.18	667,964,057.35
2. 基金赎回款	-138,570,689.32	-	-206,123,916.84	-344,694,606.16
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-17,847,324.69	-17,847,324.69
四、本期期末净资产	321,984,645.37	-	511,183,319.48	833,167,964.85
项目	上年度可比期间 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	162,940,929.31	-	192,162,727.82	355,103,657.13
二、本期期初净资产	162,940,929.31	-	192,162,727.82	355,103,657.13
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	27,928,888.21	-	72,899,613.90	100,828,502.11
(一)、综合收益总额	-	-	49,923,437.72	49,923,437.72
(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)	27,928,888.21	-	34,803,235.33	62,732,123.54
其中：1. 基金申购款	103,031,498.91	-	126,596,269.92	229,627,768.83
2. 基金赎回款	-75,102,610.70	-	-91,793,034.59	-166,895,645.29
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-11,827,059.15	-11,827,059.15
四、本期期末净资产	190,869,817.52	-	265,062,341.72	455,932,159.24

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：

<u>谭晓冈</u>	<u>范瑛</u>	<u>梁靖</u>
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

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

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

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

额净值和基金份额累计净值。

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

本财务报表由本基金的基金管理人大成基金管理有限公司于 2025 年 3 月 28 日批准报出。

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》、本基金基金合同和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的相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 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。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资和基金投资，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

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

(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，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。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融工具，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

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产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

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

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。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。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由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资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适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

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扣除按票面利率(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后的净额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

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

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

无。

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

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

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[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 如基金取得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。

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

(5) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(6) 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	61,453,622.90	31,359,238.59

等于：本金	61,447,993.62	31,357,220.48
加：应计利息	5,629.28	2,018.11
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	61,453,622.90	31,359,238.59

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		657,530,916.75	-	770,025,843.25	112,494,926.50
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		657,530,916.75	-	770,025,843.25	112,494,926.50
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		344,975,425.78	-	420,451,075.44	75,475,649.66
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	344,975,425.78	-	420,451,075.44	75,475,649.66

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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	16,677.84	7,977.14
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
其他	3,937.09	3,879.19
预提费用	175,000.00	180,000.00
合计	195,614.93	191,856.33

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

大成标普 500 等权重指数 (QDII) A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	182,508,938.23	182,508,938.23
本期申购	196,334,636.96	196,334,636.96
本期赎回（以“-”号填列）	-93,439,579.04	-93,439,579.04
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	285,403,996.15	285,403,996.15

大成标普 500 等权重指数 (QDII) C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,360,879.29	8,360,879.29
本期申购	73,350,880.21	73,350,880.21
本期赎回（以“-”号填列）	-45,131,110.28	-45,131,110.28
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	36,580,649.22	36,580,649.22

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

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

大成标普 500 等权重指数(QDII)A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	126,645,751.79	126,782,574.23	253,428,326.02
本期期初	126,645,751.79	126,782,574.23	253,428,326.02
本期利润	32,218,201.19	36,672,278.68	68,890,479.87
本期基金份额交易产生的变动数	70,956,246.30	77,157,452.99	148,113,699.29
其中：基金申购款	134,309,321.93	151,894,271.20	286,203,593.13
基金赎回款	-63,353,075.63	-74,736,818.21	-138,089,893.84
本期已分配利润	-17,185,039.78	-	-17,185,039.78
本期末	212,635,159.50	240,612,305.90	453,247,465.40

大成标普 500 等权重指数(QDII)C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,786,784.04	5,847,231.66	11,634,015.70
本期期初	5,786,784.04	5,847,231.66	11,634,015.70
本期利润	2,576,201.08	346,998.16	2,923,199.24
本期基金份额交易产生的变动数	19,222,349.95	24,818,574.10	44,040,924.05
其中：基金申购款	49,806,447.22	62,268,499.83	112,074,947.05
基金赎回款	-30,584,097.27	-37,449,925.73	-68,034,023.00
本期已分配利润	-662,284.91	-	-662,284.91
本期末	26,923,050.16	31,012,803.92	57,935,854.08

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	140,305.70	59,027.89
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	51.36	-
合计	140,357.06	59,027.89

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 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 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	34,771,688.93	6,393,039.13
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	34,771,688.93	6,393,039.13

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 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
卖出股票成交总额	159,345,257.25	70,683,906.77
减：卖出股票成本总额	124,394,736.99	64,234,606.63
减：交易费用	178,831.33	56,261.01
买卖股票差价收入	34,771,688.93	6,393,039.13

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

无。

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 资产支持证券投资基金投资收益

7.4.7.17.1 资产支持证券投资基金投资收益项目构成

无。

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

无。

7.4.7.17.3 资产支持证券投资基金投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.17.4 资产支持证券投资基金投资收益——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	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月

	31 日	31 日
股票投资产生的股利收益	11,073,139.25	6,808,948.95
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	11,073,139.25	6,808,948.95

7.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	37,019,276.84	41,674,338.36
股票投资	37,019,276.84	41,674,338.36
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	37,019,276.84	41,674,338.36

7.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	224,437.39	151,585.45
其他	747.67	-
合计	225,185.06	151,585.45

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
----	---	--

审计费用	55,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	275,778.84	240,022.60
银行划款手续费	22,935.21	9,533.22
其他	-	1,437.39
合计	473,714.05	430,993.21

7.4.7.25 分部报告

无。

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

本基金的基金管理人于 2025 年 1 月 16 日宣告 2024 年度第 1 次分红，向截至 2025 年 1 月 20 日止在本基金注册登记人登记在册的全体持有人，A 类基金按每 10 份基金份额派发红利 0.7451 元，C 类基金按每 10 份基金份额派发红利 0.7360 元。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
中国银行（香港）有限公司（“中银香港”）	境外资产托管人
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
大成国际资产管理有限公司（“大成国际”）	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司（“大成创新资本”）	基金管理人的合营企业

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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	6,950,982.95	3,864,170.04
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,972,271.54	1,431,353.05
应支付基金管理人的净管理费	4,978,711.41	2,432,816.99
应支付投资顾问的投资顾问费	-	-

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

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.00\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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	1,737,745.74	966,042.50

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

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
-------------	--

方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成标普 500 等权重 指数 (QDII) A	大成标普 500 等权重 指数 (QDII) C	合计
大成基金	-	4,649.38	4,649.38
合计	-	4,649.38	4,649.38
获得销售服务费的各关联 方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成标普 500 等权重 指数 (QDII) A	大成标普 500 等权重 指数 (QDII) C	合计
大成基金	-	21.75	21.75
合计	-	21.75	21.75

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

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

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

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
	大成标普 500 等权重指数 (QDII) A	大成标普 500 等权重指数 (QDII) C
基金合同生效日（2011 年 3	-	-

月 23 日) 持有的基金份额		
报告期初持有的基金份额	-	4,340.28
报告期间申购/买入总份额	-	0.00
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份 额	-	0.00
报告期末持有的基金份额	-	4,340.28
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	0.00%
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 8 月 30 日 (基金合同生 效日) 至 2023 年 12 月 31 日
	大成标普 500 等权重指数 (QDII)A	大成标普 500 等权重指数 (QDII)C
基金合同生效日 (2011 年 3 月 23 日) 持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	0.00
报告期间申购/买入总份额	-	4,340.28
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份 额	-	0.00
报告期末持有的基金份额	-	4,340.28
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	0.00%

注: 基金管理人大成基金投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 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	47,770,589.76	140,305.70	19,756,173.95	59,027.89
中银香港	13,683,033.14	-	11,603,064.64	-

注: 本基金的银行存款由基金托管人和境外资产托管人保管, 按银行约定利率计息。

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

单位：人民币元

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

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

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

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

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

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

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

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

本期末，本基金无债券投资(上年度末：同)。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

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

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。

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	47,770,589.76	-	-	13,683,033.14	61,453,622.90
交易性金融资产	-	-	-	770,025,843.25	770,025,843.25
应收股利	-	-	-	789,805.31	789,805.31
应收申购款	125,381.69	-	-	8,725,031.63	8,850,413.32
资产总计	47,895,971.45	-	-	793,223,713.33	841,119,684.78
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,852,047.19	6,852,047.19
应付管理人报酬	-	-	-	705,755.73	705,755.73
应付托管费	-	-	-	176,438.93	176,438.93
应付销售服务费	-	-	-	21,863.15	21,863.15
其他负债	-	-	-	195,614.93	195,614.93
负债总计	-	-	-	7,951,719.93	7,951,719.93
利率敏感度缺口	47,895,971.45	-	-	-785,271,993.40	833,167,964.85
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	19,756,173.95	-	-	11,603,064.64	31,359,238.59
交易性金融资产	-	-	-	420,451,075.44	420,451,075.44
应收股利	-	-	-	534,003.68	534,003.68
应收申购款	13,163.18	-	-	2,979,093.22	2,992,256.40
应收清算款	-	-	-	5,516,281.79	5,516,281.79
资产总计	19,769,337.13	-	-	441,083,518.77	460,852,855.90
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,264,000.73	4,264,000.73
应付管理人报酬	-	-	-	369,415.03	369,415.03
应付托管费	-	-	-	92,353.74	92,353.74
应付销售服务费	-	-	-	3,070.83	3,070.83
其他负债	-	-	-	191,856.33	191,856.33
负债总计	-	-	-	4,920,696.66	4,920,696.66
利率敏感度缺口	19,769,337.13	-	-	-436,162,822.11	455,932,159.24

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合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

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

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

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
货币资金	13,684,938.78	-	-	13,684,938.78
交易性金融资产	770,025,843.25	-	-	770,025,843.25
应收股利	789,805.31	-	-	789,805.31
资产合计	784,500,587.34	-	-	784,500,587.34
以外币计价的负债				
其他负债	3,937.09	-	-	3,937.09
负债合计	3,937.09	-	-	3,937.09
资产负债表外 外汇风险敞口净额	784,496,650.25	-	-	784,496,650.25
项目	上年度末			

	2023 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
货币资金	11,603,064.64	-	-	11,603,064.64
交易性金融资产	420,451,075.44	-	-	420,451,075.44
应收股利	534,003.68	-	-	534,003.68
应收清算款	5,516,281.79	-	-	5,516,281.79
资产合计	438,104,425.55	-	-	438,104,425.55
以外币计价的负债				
其他负债	3,879.19	-	-	3,879.19
负债合计	3,879.19	-	-	3,879.19
资产负债表外汇风险敞口净额	438,100,546.36	-	-	438,100,546.36

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%	39,224,832.45	21,905,027.32
	所有外币相对人民币贬值 5%	-39,224,832.45	-21,905,027.32

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

本基金的基金管理人通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。

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

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 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	770,025,843.25	92.42	420,451,075.44	92.22
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	770,025,843.25	92.42	420,451,075.44	92.22

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变
----	----------------------

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	38,501,754.10	21,130,686.25
	业绩比较基准下降 5%	-38,501,754.10	-21,130,686.25

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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	770,025,843.25	420,451,075.44
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	770,025,843.25	420,451,075.44

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证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；对于定期开放的基金投资，本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次；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，确定相关投资的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

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具(上年度末：同)。

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货币资金、应收款项和其他金融负债等，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	770,025,843.25	91.55
	其中：普通股	770,025,843.25	91.55
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-

7	银行存款和结算备付金合计	61,453,622.90	7.31
8	其他各项资产	9,640,218.63	1.15
9	合计	841,119,684.78	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	770,025,843.25	92.42
合计	770,025,843.25	92.42

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

8.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
通讯	36,940,195.53	4.43
非必需消费品	76,168,151.18	9.14
必需消费品	58,674,378.86	7.04
能源	37,111,374.40	4.45
金融	119,722,450.12	14.37
房地产	47,385,122.82	5.69
医疗保健	94,630,457.71	11.36
工业	110,163,639.35	13.22
材料	41,939,351.98	5.03
科技	98,389,551.20	11.81
公用事业	48,901,170.10	5.87
政府	-	-
合计	770,025,843.25	92.42

注：以上分类采用彭博行业分类标准。

8.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

无。

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

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	BROAD COM INC	博通股份有限公司	AVGO US	纳斯达克证券交易所	美国	1,232	2,053,200.26	0.25
2	DARDE N	达登餐饮公司	DRI US	美国纽约证券	美国	1,382	1,854,647.31	0.22

	RESTAURANTS INC			交易所				
3	DOLLAR TREE INC	美元树公司	DLTR US	纳斯达克证券交易所	美国	3,239	1,744,845.08	0.21
4	BOEING CO/TH E	波音	BA US	美国纽约证券交易所	美国	1,357	1,726,574.61	0.21
5	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	西氏医药服务公司	WST US	美国纽约证券交易所	美国	729	1,716,526.95	0.21
6	APTIV PLC	安波福公共有限公司	APTIV US	美国纽约证券交易所	美国	3,939	1,712,497.71	0.21
7	ENTERGY CORP	Entergy 公司	ETR US	美国纽约证券交易所	美国	3,138	1,710,286.84	0.21
8	JABIL INC	捷普集团	JBL US	美国纽约证券交易所	美国	1,649	1,705,743.34	0.20
9	TRANS Digm GROUP INC	TransDigm 集团公司	TDG US	美国纽约证券交易所	美国	186	1,694,407.09	0.20
10	RALPH LAUREN CORP	拉夫劳伦	RL US	美国纽约证券交易所	美国	1,020	1,693,584.16	0.20
11	CENTENE CORP	Centene 公司	CNC US	美国纽约证券交易所	美国	3,875	1,687,458.93	0.20
12	ULTA BEAUTY INC	Ulta 美容产品公司	ULTA US	纳斯达克证券交易所	美国	539	1,685,156.99	0.20
13	WILLIS TOWERS WATSON PLC	韦莱韬睿惠悦公共有限公司	WTW US	纳斯达克证券交易所	美国	748	1,684,267.42	0.20

14	GLOBE LIFE INC	Globe Life 股份有限公司	GL US	美国 纽约 证券 交易所	美国	2,098	1,681,862.47	0.20
15	VERIS IGN INC	威瑞信 股份有限公司	VRSN US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	1,130	1,681,113.73	0.20
16	VISA INC-C LASS A SHARES	维萨公 司	V US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	739	1,678,876.41	0.20
17	SEMPRA	Sempra 公司	SRE US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	2,654	1,673,523.35	0.20
18	ARTHUR J GALLAGHER & CO	亚瑟加 拉格尔 有限公司	AJG US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	818	1,669,069.56	0.20
19	CHUBB LTD	邱博保 险集团	CB US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	840	1,668,370.13	0.20
20	EVEREST GROUP LTD	Everest 集团 有限公司	EG US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	640	1,667,524.78	0.20
21	PFIZER INC	辉瑞制 药	PFE US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	8,739	1,666,599.41	0.20
22	COTERRA ENERGY INC	Coterra 能源 股份有限公司	CTRA US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	9,069	1,664,993.45	0.20
23	LABCORP HOLDINGS INC	Labcorp 控股 股份有限公司	LH US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	1,010	1,664,928.33	0.20
24	ALLSTATE CORP	好事达 保险公 司	ALL US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	1,200	1,663,021.96	0.20
25	INTEL CORP	英特尔	INTC US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	11,532	1,662,077.41	0.20

				交易所				
26	TAPES TRY INC	TPR-DR S-RS 公司	TPR US	美国 纽 约 证 券 交易所	美国	3,539	1,661,978.71	0.20
27	TERAD YNE INC	泰瑞达	TER US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	1,834	1,660,069.54	0.20
28	GILEA D SCIEN CES INC	吉利德 科学	GILD US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	2,494	1,655,997.31	0.20
29	GENER AL DYNAM ICS CORP	通用动 力	GD US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	874	1,655,418.50	0.20
30	PAYCH EX INC	Payche x 公司	PAYX US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	1,642	1,655,066.13	0.20
31	CHURC H & DWIGH T CO INC	切迟杜 威股份 有限公司	CHD US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	2,197	1,653,676.11	0.20
32	PALAN TIR TECHN OLOGI ES INC-A	Palant ir 科 技股份 有限公司	PLTR US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	3,040	1,652,722.42	0.20
33	CME GROUP INC	芝加哥 商业交 易所	CME US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	990	1,652,668.51	0.20
34	DECKE RS OUTDO OR CORP	德克斯 户外用 品公司	DECK US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	1,132	1,652,597.92	0.20
35	JACOB S SOLUT IONS INC	嘉科解 决方案 股份有 限公司	J US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	1,717	1,649,202.55	0.20

36	APPLE INC	苹果公司	AAPL US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	916	1,648,909.12	0.20
37	EVERG Y INC	Evergy 股份有 限公司	EVRG US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	3,726	1,648,553.87	0.20
38	MATCH GROUP INC	Match 集团股 份有限 公司	MTCH US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	7,004	1,646,868.48	0.20
39	PRUDE NTIAL FINAN CIAL INC	保德信 金融集 团	PRU US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	1,932	1,646,143.31	0.20
40	CLORO X COMPA NY	高乐氏 公司	CLX US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	1,409	1,644,962.47	0.20
41	METLI FE INC	大都会 集团	MET US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	2,793	1,643,921.23	0.20
42	AMERI CAN ELECT RIC POWER	美国电 力	AEP US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	2,478	1,642,879.64	0.20
43	ROSS STORE S INC	罗斯百 货股份 有限公司	ROST US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	1,508	1,639,783.02	0.20
44	DUKE ENERG Y CORP	杜克能 源	DUK US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	2,117	1,639,570.38	0.20
45	TRAVE LERS COS INC/T HE	旅行家 集团	TRV US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	946	1,638,106.54	0.20
46	BERKS HIRE HATHA WAY INC-C	伯克希 尔哈撒 韦公司	BRK/B US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	502	1,635,695.69	0.20

	L B							
47	APA CORP	APA 公司	APA US	纳斯达克证券交易所	美国	9,852	1,635,236.50	0.20
48	JACK HENRY & ASSOCIATES INC	Jack Henry & Associates 公司	JKHY US	纳斯达克证券交易所	美国	1,297	1,634,384.10	0.20
49	ANSYS INC	ANSYS 股份有限公司	ANSS US	纳斯达克证券交易所	美国	674	1,634,357.64	0.20
50	ARISTA NETWORKS INC	Arista 网络股份有限公司	ANET US	美国纽约证券交易所	美国	2,056	1,633,561.60	0.20
51	EXPEDIA GROUP INC	亿客行集团股份有限公司	EXPE US	纳斯达克证券交易所	美国	1,219	1,632,746.36	0.20
52	MCKESSON CORP	McKesson 公司	MCK US	美国纽约证券交易所	美国	398	1,630,502.94	0.20
53	VIATRIS INC	晖致	VTRS US	纳斯达克证券交易所	美国	18,198	1,628,640.56	0.20
54	UNITED PARCEL SERVICE-CLB	联合包裹服务股份有限公司	UPS US	美国纽约证券交易所	美国	1,796	1,627,997.20	0.20
55	BECTON DICKINSON AND CO	碧迪	BDX US	美国纽约证券交易所	美国	997	1,625,939.81	0.20
56	SIMON PROPERTY GROUP	西蒙房地产集团公司	SPG US	美国纽约证券交易所	美国	1,313	1,625,381.56	0.20

	INC							
57	ASSURANT INC	安信龙集团	AIZ US	美国纽约证券交易所	美国	1,060	1,624,673.29	0.19
58	KROGER CO	克罗格公司	KR US	美国纽约证券交易所	美国	3,695	1,624,213.59	0.19
59	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	Thermo Fisher Scientific 公司	TMO US	美国纽约证券交易所	美国	434	1,622,995.66	0.19
60	EXELON CORP	Exelon 公司	EXC US	纳斯达克证券交易所	美国	5,998	1,622,887.11	0.19
61	GENERAL MOTOR S CO	通用汽车公司	GM US	美国纽约证券交易所	美国	4,236	1,622,074.82	0.19
62	INTERNATIONAL PAPER CO	国际纸业	IP US	美国纽约证券交易所	美国	4,185	1,619,091.49	0.19
63	DELL TECHNOLOGIES INC	戴尔科技公司	DELL US	美国纽约证券交易所	美国	1,954	1,618,676.44	0.19
64	CONOCOPHILIPS	康菲石油	COP US	美国纽约证券交易所	美国	2,270	1,618,223.14	0.19
65	PEPSICO INC	百事可乐	PEP US	纳斯达克证券交易所	美国	1,480	1,617,740.79	0.19
66	KLA CORP	KLA 公司	KLAC US	纳斯达克证券交易所	美国	357	1,617,051.00	0.19
67	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	西方石油	OXY US	美国纽约证券交易所	美国	4,548	1,615,353.38	0.19

68	CENCORA INC	Cencora 股份有限公司	COR US	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,000	1,615,089.71	0.19
69	ELI LILLY & CO	礼来	LLY US	美国 纽约 证券 交易所	美国	291	1,614,888.44	0.19
70	ABBVIE INC	艾伯维 股份有限公司	ABBV US	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,264	1,614,606.65	0.19
71	PG & E CORP	太平洋 煤气电 力	PCG US	美国 纽约 证券 交易所	美国	11,130	1,614,539.08	0.19
72	YUM! BRANDS INC	百胜餐 饮集团	YUM US	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,674	1,614,398.48	0.19
73	EQUINIX INC	Equinix 有限公司	EQIX US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	238	1,613,133.17	0.19
74	F5 INC	F5 股 份有 限公 司	FFIV US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	892	1,612,438.92	0.19
75	CELANESE CORP	塞拉尼 斯公司	CE US	美国 纽约 证券 交易所	美国	3,240	1,611,929.69	0.19
76	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE, INC.	Take-Two 互 动软件 股份有 限公司	TTWO US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	1,218	1,611,707.14	0.19
77	VERISK ANALYTICS INC	Verisk 分析公 司	VRSK US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	814	1,611,639.42	0.19
78	KINDER MORGAN INC	特拉华 州金德 摩根公 司	KMI US	美国 纽约 证券 交易所	美国	8,181	1,611,347.43	0.19
79	ACCENTURE	埃森哲 公司	ACN US	美国 纽约 证券 交易所	美国	637	1,610,850.21	0.19

	PLC-C L A			交易所				
80	LOCKH EED MARTI N CORP	洛克希 德马丁	LMT US	美国纽 约证券 交易所	美国	460	1,606,840.30	0.19
81	EDWAR DS LIFES CIENC ES CORP	爱德华 生命科学公司	EW US	美国纽 约证券 交易所	美国	3,015	1,604,454.11	0.19
82	DAVIT A INC	DaVita 股份有限公司	DVA US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,492	1,603,937.63	0.19
83	EQT CORP	EQT 公 司	EQT US	美国纽 约证券 交易所	美国	4,837	1,603,258.11	0.19
84	ERIE INDEM NITY COMPA NY-CL A	伊利赔 偿公司	ERIE US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	541	1,603,131.31	0.19
85	NISOU RCE INC	NiSour ce 公 司	NI US	美国纽 约证券 交易所	美国	6,065	1,602,649.47	0.19
86	ROCKW ELL AUTOM ATION INC	罗克韦 尔自动化	ROK US	美国纽 约证券 交易所	美国	780	1,602,410.81	0.19
87	EOG RESOU RCES INC	EOG 资 源	EOG US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,818	1,601,938.10	0.19
88	CISCO SYSTE MS INC	思科	CSCO US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	3,763	1,601,356.99	0.19
89	CENTE RPOIN T ENERG Y INC	中点能 源	CNP US	美国纽 约证券 交易所	美国	7,019	1,600,949.19	0.19

90	BLACK ROCK FINAN CE INC	贝莱德 股份有 限公司	BLK US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	217	1,599,051.46	0.19
91	MONST ER BEVER AGE CORP	怪兽饮 料公司	MNST US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	4,232	1,598,943.99	0.19
92	CARDI NAL HEALT H INC	嘉德诺 健康集 团	CAH US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	1,880	1,598,323.49	0.19
93	KIMCO REALT Y CORP	Kimco Realty 公司	KIM US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	9,489	1,598,177.35	0.19
94	FORTI VE CORP	福迪威 公司	FTV US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	2,964	1,597,981.32	0.19
95	ESSEX PROPE RTY TRUST INC	埃塞克 斯房地 产信托 公司	ESS US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	778	1,596,344.67	0.19
96	FISER V INC	Fiserv 公司	FI US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	1,081	1,596,249.06	0.19
97	SMURF IT WESTR OCK PLC	Smurfi t WestRo ck 公 共有限 公司	SW US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	4,122	1,595,903.30	0.19
98	GLOBA L PAYME NTS INC	环汇有 限公司	GPN US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	1,981	1,595,759.10	0.19
99	REPUB LIC SERVI CES INC	公共服 务公司	RSG US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	1,103	1,595,117.03	0.19
100	ALTRI	高特利	MO US	美 国 纽	美国	4,242	1,594,489.05	0.19

	A GROUP INC			约 证 券 交 易 所				
101	LULUL EMON ATHLE TICA INC	Lulule mon Athlet ica 股 份有限 公司	LULU US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	580	1, 594, 371. 31	0. 19
102	STRYK ER CORP	史赛克	SYK US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	616	1, 594, 320. 99	0. 19
103	MARRI OTT INTER NATIO NAL -CL A	万豪国际	MAR US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	795	1, 594, 080. 18	0. 19
104	ZEBRA TECHN OLOGI ES CORP- CL A	斑马技术公司	ZBRA US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	574	1, 593, 598. 41	0. 19
105	AMERI CAN WATER WORKS CO INC	美国自来 水股份有 限公司	AWK US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1, 780	1, 592, 893. 37	0. 19
106	KELLA NOVA	Kellan ova 公 司	K US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2, 734	1, 591, 310. 34	0. 19
107	SNAP- ON INC	实耐宝	SNA US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	652	1, 591, 087. 36	0. 19
108	TE CONNE CTIVI TY PLC	TE Conne ctivity 公共有 限公司	TEL US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1, 548	1, 590, 919. 15	0. 19
109	KIMBE RLY-C LARK CORP	金佰利	KMB US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1, 688	1, 590, 041. 88	0. 19

110	CORTE VA INC	科迪华 公司	CTVA US	美国 纽 约 证 券 交易 所	美国	3,881	1,589,080.36	0.19
111	TJX COMPA NIES INC	TJX 公 司	TJX US	美国 纽 约 证 券 交易 所	美国	1,829	1,588,359.57	0.19
112	AUTOZ ONE INC	AutoZo ne 股 份有限 公司	AZO US	美国 纽 约 证 券 交易 所	美国	69	1,588,190.72	0.19
113	HCA HEALT HCARE INC	HCA 医 疗保健 有限公 司	HCA US	美国 纽 约 证 券 交易 所	美国	736	1,587,992.32	0.19
114	JUNIP ER NETWO RKS INC	瞻博网 络股份 有限公 司	JNPR US	美国 纽 约 证 券 交易 所	美国	5,896	1,587,236.10	0.19
115	SOUTH WEST AIRLI NES CO	西南航 空	LUV US	美国 纽 约 证 券 交易 所	美国	6,566	1,586,831.54	0.19
116	SYSCO CORP	Sysco 公司	SYU US	美国 纽 约 证 券 交易 所	美国	2,887	1,586,767.56	0.19
117	AGILE NT TECHN OLOGI ES INC	安捷伦	A US	美国 纽 约 证 券 交易 所	美国	1,643	1,586,628.10	0.19
118	CONAG RA BRAND S INC	康尼格 拉品牌 股份有 限公司	CAG US	美国 纽 约 证 券 交易 所	美国	7,951	1,586,050.37	0.19
119	MOODY 'S CORP	穆迪	MCO US	美国 纽 约 证 券 交易 所	美国	466	1,585,692.18	0.19
120	FEDEX CORP	联邦快 递	FDX US	美国 纽 约 证 券 交易 所	美国	784	1,585,493.06	0.19
121	DIAMO NDBAC	Diamon dback	FANG US	纳 斯 达 克 证 券	美国	1,345	1,583,973.64	0.19

	K ENERG Y INC	能源股 份有限 公司		交易所				
122	LOEWS CORP	罗斯公 司	L US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	2,601	1,583,451.34	0.19
123	NORFO LK SOUTH ERN CORP	诺福克 南方	NSC US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	938	1,582,516.20	0.19
124	BRIST OL-MY ERS SQUIB B CO	百时美 施贵宝 公司	BMV US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	3,892	1,582,393.42	0.19
125	PHILI P MORRI S INTER NATIO NAL	菲利普 莫里斯 国际集 团公司	PM US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	1,829	1,582,311.69	0.19
126	DTE ENERG Y COMPA NY	DTE 能 源	DTE US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	1,822	1,581,494.72	0.19
127	CORNI NG INC	康宁公 司	GLW US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	4,629	1,581,232.92	0.19
128	CMS ENERG Y CORP	CMS 能 源	CMS US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	3,299	1,580,573.53	0.19
129	SYNOP SYS INC	新思科 技公司	SNPS US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	453	1,580,499.71	0.19
130	MERCK & CO. INC.	默克	MRK US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	2,210	1,580,375.49	0.19
131	DIGIT AL REALT Y	数字房 地产信 托有限 公司	DLR US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	1,239	1,579,376.81	0.19

	TRUST INC							
132	CF INDUS TRIES HOLDI NGS INC	CF 工 业控股 股份有 限公司	CF US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	2,575	1,579,284.29	0.19
133	HORME L FOODS CORP	荷美尔 食品有 限公司	HRL US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	7,003	1,579,177.26	0.19
134	REGEN CY CENTE RS CORP	Regenc y Center s 公司	REG US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	2,971	1,578,903.52	0.19
135	FEDER AL REALT Y INVS TRUST	联邦房 地产投 资信托 公司	FRT US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	1,962	1,578,902.59	0.19
136	TELED YNE TECHN OLOGI ES INC	Teledy ne 科 技股份 有限公 司	TDY US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	473	1,578,094.54	0.19
137	FACTS ET RESEA RCH SYSTE MS INC	FactSe t 研究 系统股 份有限 公司	FDS US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	457	1,577,767.25	0.19
138	AON PLC-C LASS A	怡安集 团	AON US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	611	1,577,471.09	0.19
139	QUANT A SERVI CES INC	Quanta 服务股 份有限 公司	PWR US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	694	1,576,694.31	0.19
140	3M CO	3M 公 司	MMM US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	1,699	1,576,587.99	0.19

141	NXP SEMIC ONDUC TORS NV	恩智浦 半导体 公司	NXPI US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	1,055	1,576,284.93	0.19
142	CONST ELLAT ION ENERG Y	美国联 合能源 公司	CEG US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	980	1,575,954.62	0.19
143	ATMOS ENERG Y CORP	Atmos 能源公 司	ATO US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	1,574	1,575,776.21	0.19
144	AMETE K INC	阿美特 克股份 有限公 司	AME US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	1,216	1,575,669.68	0.19
145	AMERE N CORPO RATIO N	Ameren 公司	AEE US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	2,459	1,575,663.21	0.19
146	TARGE T CORP	塔吉特 公司	TGT US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	1,621	1,575,170.95	0.19
147	HP INC	惠普	HPQ US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	6,715	1,575,053.56	0.19
148	COCA- COLA CO/TH E	可口可 乐	KO US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	3,519	1,574,927.69	0.19
149	NASDA Q INC	纳斯达 克股份 有限公 司	NDAQ US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	2,830	1,572,730.63	0.19
150	DOMIN ION ENERG Y INC	Domini on 能 源股份 有限公 司	D US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	4,062	1,572,673.26	0.19
151	AFLAC INC	家庭人 寿保险	AFL US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	2,115	1,572,646.52	0.19

152	SKYWORKS SOLUTIONS INC	思佳讯解决方案公司	SWKS US	纳斯达克证券交易所	美国	2,466	1,571,994.39	0.19
153	SBA COMMUNICATIONS CORP	SBA 通信公司	SBAC US	纳斯达克证券交易所	美国	1,073	1,571,940.62	0.19
154	PPL CORP	PPL 公司	PPL US	美国纽约证券交易所	美国	6,736	1,571,747.69	0.19
155	CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	CrowdStrike 控股股份有限公司	CRWD US	纳斯达克证券交易所	美国	639	1,571,673.50	0.19
156	DEERE & CO	迪尔	DE US	美国纽约证券交易所	美国	516	1,571,594.14	0.19
157	FIRST ENERGY CORP	第一能源	FE US	美国纽约证券交易所	美国	5,495	1,571,320.26	0.19
158	CINCINNATI FINANCIAL CORP	辛辛那提金融	CINF US	纳斯达克证券交易所	美国	1,521	1,571,152.05	0.19
159	T-MOBILE US INC	T-Mobile US 股份有限公司	TMUS US	纳斯达克证券交易所	美国	990	1,570,828.58	0.19
160	XCEL ENERGY INC	Xcel 能源	XEL US	纳斯达克证券交易所	美国	3,236	1,570,627.45	0.19
161	BOSTON SCIENTIFIC CORP	波士顿科学	BSX US	美国纽约证券交易所	美国	2,446	1,570,498.05	0.19
162	ABBOT	雅培制	ABT US	美国纽	美国	1,931	1,570,057.33	0.19

	T LABOR ATORI ES	药		约 证 券 交 易 所				
163	MARSH & MCLEN NAN COS	Marsh & McLenn an 股 份有限 公司	MMC US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,028	1,569,640.91	0.19
164	PACKA GING CORP OF AMERI CA	美国包 装公司	PKG US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	969	1,568,156.43	0.19
165	KEYSI GHT TECHN OLOGI ES INC	是德科 技公司	KEYS US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,358	1,568,045.52	0.19
166	WASTE MANAG EMENT INC	废品管 理	WM US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,081	1,568,041.56	0.19
167	RTX CORP	RTX 公 司	RTX US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,885	1,568,021.51	0.19
168	KKR & CO INC	KKR & Co 有 限公司	KKR US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,474	1,567,210.22	0.19
169	GENER AL ELECT RIC	通用电 气航空 航天	GE US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,307	1,567,031.88	0.19
170	STATE STREE T CORP	道富集 团	STT US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,221	1,567,007.58	0.19
171	SOUTH ERN CO/TH E	南方公 司	SO US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,648	1,566,951.59	0.19
172	AMERI CAN	美国国 际集团	AIG US	美 国 纽 约 证 券	美国	2,994	1,566,806.67	0.19

	INTERNATIONAL GROUP			交易所				
173	THE CIGNA GROUP	信诺集团	CI US	美国纽约证券交易所	美国	789	1,566,168.77	0.19
174	ZIMMER BIOMEDICAL HOLDINGS INC	捷迈邦美控股有限公司	ZBH US	美国纽约证券交易所	美国	2,062	1,565,698.65	0.19
175	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INCORPORATED	公共服务企业集团	PEG US	美国纽约证券交易所	美国	2,577	1,565,135.58	0.19
176	LEIDOS HOLDINGS INC	Leidos 控股公司	LDOS US	美国纽约证券交易所	美国	1,511	1,564,732.53	0.19
177	INTL BUSINESS MACHINES CORP	国际商业机器公司	IBM US	美国纽约证券交易所	美国	990	1,564,423.71	0.19
178	BIO-TECHNE CORP	Bio-technique 公司	TECH US	纳斯达克证券交易所	美国	3,020	1,563,696.97	0.19
179	HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES	Huntington Ingalls 工业公司	HII US	美国纽约证券交易所	美国	1,151	1,563,509.13	0.19

180	MASTERCARD INC – A	万事达股份有限公司	MA US	美国 纽约 证券 交易所	美国	413	1,563,285.86	0.19
181	INTUIT INC	Intuit 股份有限公司	INTU US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	346	1,563,196.65	0.19
182	HUNT (JB) TRANS PRT SVCS INC	JB Hunt 运输服务股份有限公司	JBHT US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	1,274	1,562,907.97	0.19
183	JOHNSON & JOHNSON	强生	JNJ US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	1,503	1,562,498.37	0.19
184	AT&T INC	美国电话电报公司	T US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	9,546	1,562,488.02	0.19
185	EQUITY RESIDENTIAL	公寓物业权益信托	EQR US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	3,029	1,562,478.10	0.19
186	UBER TECHNOLOGIES INC	优步技术股份有限公司	UBER US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	3,603	1,562,276.25	0.19
187	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	霍尼韦尔	HON US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	962	1,562,083.74	0.19
188	NORTHROP GRUMMAN CORP	诺斯洛普格鲁门公司	NOC US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	463	1,561,904.68	0.19
189	BEST BUY CO INC	百思买	BBY US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	2,532	1,561,648.27	0.19
190	MORGAN	摩根士	MS US	美 国 纽	美国	1,728	1,561,637.92	0.19

	N STANL EY	丹利		约 证 券 交 易 所				
191	OTIS WORLD WIDE CORP	奥的斯 电梯公 司	OTIS US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,343	1,559,776.63	0.19
192	JPMOR GAN CHASE & CO	摩根大 通	JPM US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	905	1,559,433.88	0.19
193	PARAM OUNT GLOBA L-CLA SS B	派拉蒙 全球	PARA US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	20,735	1,559,078.42	0.19
194	WEC ENERG Y GROUP INC	WEC 能 源集团 股份有 限公司	WEC US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,306	1,558,849.40	0.19
195	PROGR ESSIV E CORP	前进保 险公司	PGR US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	904	1,557,060.92	0.19
196	PROCT ER & GAMBL E CO/TH E	宝洁	PG US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,292	1,557,034.76	0.19
197	MSCI INC	MSCI 明晟	MSCI US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	361	1,557,033.39	0.19
198	GARTN ER INC	Gartne r 公司	IT US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	447	1,556,706.17	0.19
199	KRAFT HEINZ CO/TH E	卡夫亨 氏公司	KHC US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	7,046	1,555,445.11	0.19
200	ARCH CAPIT AL GROUP	阿契资 本集团	ACGL US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,343	1,555,397.60	0.19

	LTD							
201	AMERICAN EXPRESS CO	美国运通	AXP US	美国纽约证券交易所	美国	729	1,555,281.58	0.19
202	UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	美国联合航空控股股份有限公司	UAL US	纳斯达克证券交易所	美国	2,228	1,555,129.83	0.19
203	WELLS FARGO & CO	富国银行	WFC US	美国纽约证券交易所	美国	3,079	1,554,627.79	0.19
204	EBAY INC	eBay 股份有限公司	EBAY US	纳斯达克证券交易所	美国	3,490	1,554,171.62	0.19
205	CATERPILLAR INC	卡特彼勒	CAT US	美国纽约证券交易所	美国	596	1,554,167.73	0.19
206	HALLIBURTON CO	哈利伯顿	HAL US	美国纽约证券交易所	美国	7,946	1,553,066.33	0.19
207	STERIS PLC	思泰瑞医疗公共有限公司	STE US	美国纽约证券交易所	美国	1,051	1,553,007.53	0.19
208	WELLTOWER INC	Welltower 公司	WELL US	美国纽约证券交易所	美国	1,714	1,552,805.25	0.19
209	UDR INC	UDR 公司	UDR US	美国纽约证券交易所	美国	4,976	1,552,753.06	0.19
210	COLGATE-PALMOLIVE CO	高露洁棕榄	CL US	美国纽约证券交易所	美国	2,376	1,552,709.93	0.19
211	BROWN & BROWN INC	Brown & Brown 股份有限公司	BRO US	美国纽约证券交易所	美国	2,117	1,552,524.32	0.19
212	ALLEG	安朗杰	ALLE	美国纽	美国	1,652	1,551,855.95	0.19

	ION PLC	公共有 限公司	US	约 证 券 交 易 所				
212	RESME D INC	瑞思迈 股份有 限公司	RMD US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	944	1,551,855.95	0.19
214	ALLIA NT ENERG Y CORP	Allian t 能源 公司	LNT US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	3,649	1,551,270.09	0.19
215	WABTE C CORP	西屋制 动公司	WAB US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,138	1,550,921.88	0.19
216	EDISO N INTER NATIO NAL	爱迪生 国际	EIX US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,702	1,550,736.85	0.19
217	MCDON ALD'S CORP	麦当劳	MCD US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	744	1,550,380.89	0.19
218	CITIG ROUP INC	花旗集 团	C US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,064	1,550,357.88	0.19
219	ANALO G DEVIC ES INC	亚德诺 半导体	ADI US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,015	1,550,156.18	0.19
220	TEXAS INSTR UMENT S INC	德州仪 器	TXN US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,150	1,550,081.42	0.19
221	WILLI AMS COS INC	威廉姆 斯公司	WMB US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,980	1,548,364.11	0.19
222	WARNE R BROS DISCO VERY INC	华纳兄 弟探索 股份有 限公司	WBD US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	20,377	1,548,272.74	0.19
223	IQVIA HOLDI NGS INC	艾昆纬	IQV US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,096	1,548,201.36	0.19

224	MID-A MERIC A APART MENT COMMU NITIE S, INC.	MID-AM ERICA APARTM ENT COMM 公司	MAA US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	1,392	1,546,666.50	0.19
225	CDW CORP	特拉华 公司	CDW US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	1,236	1,546,321.45	0.19
226	UNION PACIF IC CORP	联合太 平洋	UNP US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	943	1,545,805.90	0.19
227	PARKE R HANNI FIN CORP	派克汉 尼汾公 司	PH US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	338	1,545,348.86	0.19
228	AUTOM ATIC DATA PROCE SSING	ADP 公 司	ADP US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	734	1,544,527.08	0.19
229	DANAH ER CORP	丹纳赫	DHR US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	936	1,544,491.00	0.19
230	HEWLE TT PACKA RD ENTER PRISE	慧与公 司	HPE US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	10,063	1,544,392.16	0.19
231	COOPE R COS INC/T HE	库柏股 份有限 公司	COO US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	2,337	1,544,358.80	0.19
232	NORTH ERN TRUST CORP	北美信 托	NTRS US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	2,096	1,544,355.86	0.19
233	PPG	PPG 工	PPG US	美 国 纽	美国	1,798	1,543,860.58	0.19

	INDUSTRIES INC	业		约 证 券 交 易 所				
234	THE CAMPBELL'S COMPANY	金宝汤公司	CPB US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	5,127	1,543,484.33	0.19
235	PUBLIC STORAGE	公共存储	PSA US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	717	1,543,338.55	0.19
236	GENERAL MILLS INC	通用磨坊	GIS US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,366	1,542,988.77	0.19
237	APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	阿波罗全球管理股份有限公司	APO US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,299	1,542,219.75	0.19
238	CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	Cadence 设计系统股份有限公司	CDNS US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	714	1,542,116.24	0.19
239	EPAM SYSTEMS INC	EPAM 系统公司	EPAM US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	917	1,541,285.98	0.18
240	JM SMUCKER CO/THE	JM 斯马克公司	SJM US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,946	1,540,427.54	0.18
241	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	Discover 金融服务公司	DFS US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,237	1,540,369.96	0.18
242	AVALONBAY	Avalon Bay 社	AVB US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	974	1,540,120.31	0.18

	COMMUNITIES INC	社区股份有限公司		交易所				
243	LYONDELLBASELL INDUSTRIAL	利安德巴塞尔工业公司	LYB US	美国纽约证券交易所	美国	2,884	1,539,717.04	0.18
244	TRUIST FINANCIAL CORP	Truist 金融公司	TFC US	美国纽约证券交易所	美国	4,937	1,539,518.49	0.18
245	WALT DISNEY CO/THE	华特迪士尼公司	DIS US	美国纽约证券交易所	美国	1,923	1,539,223.70	0.18
246	BIOGEN INC	渤健公司	BIIB US	纳斯达克证券交易所	美国	1,400	1,538,950.18	0.18
247	SCHLUMBERGER LTD	斯伦贝谢公众有限公司	SLB US	美国纽约证券交易所	美国	5,582	1,538,417.37	0.18
248	TYLER TECHNOLOGIES INC	Tyler 科技公司	TYL US	美国纽约证券交易所	美国	371	1,537,839.14	0.18
249	MODERNA INC	莫德纳公司	MRNA US	纳斯达克证券交易所	美国	5,144	1,537,509.05	0.18
250	MARTIN MARIETTA MATERIALS	Martin Marietta 材料股份有限公司	MLM US	美国纽约证券交易所	美国	414	1,537,102.76	0.18
251	VENTAS INC	Ventas 公司	VTR US	美国纽约证券交易所	美国	3,631	1,537,092.62	0.18
252	EQUIFAX INC	Equifax 股份有限公司	EFX US	美国纽约证券交易所	美国	839	1,537,017.58	0.18

		司						
253	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	信安金融	PFG US	纳斯达克证券交易所	美国	2,761	1,536,369.62	0.18
254	LOWE'S COS INC	劳氏	LOW US	美国纽约证券交易所	美国	866	1,536,368.11	0.18
255	US BANCORP	美国合众银行	USB US	美国纽约证券交易所	美国	4,468	1,536,193.00	0.18
256	REGENERON PHARMACEUTICALS	再生元制药股份有限公司	REGN US	纳斯达克证券交易所	美国	300	1,536,153.89	0.18
257	NEXTERA ENERGY INC	新纪元能源公司	NEE US	美国纽约证券交易所	美国	2,980	1,535,702.46	0.18
258	MOLINA HEALTHCARE INC	Molina Health care 股份有限公司	MOH US	美国纽约证券交易所	美国	734	1,535,662.92	0.18
259	QUEST DIAGNOSTICS INC	Quest Diagnostics 股份有限公司	DGX US	美国纽约证券交易所	美国	1,416	1,535,569.91	0.18
260	HESS CORP	赫斯公司	HES US	美国纽约证券交易所	美国	1,606	1,535,543.31	0.18
261	TELEFLEX INC	泰利福公司	TFX US	美国纽约证券交易所	美国	1,200	1,535,269.72	0.18
262	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	布罗德里奇金融解决方案股份有限公司	BR US	美国纽约证券交易所	美国	944	1,534,212.74	0.18
263	WR	WR	WRB US	美国纽	美国	3,647	1,534,165.87	0.18

	BERKLEY CORP	Berkley 公司		约 证 券 交 易 所				
264	HARTFORD INSURANCE GROUP INC	哈特福德金融服务	HIG US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,950	1,533,501.37	0.18
265	VALERO ENERGY CORP	Valero 能源	VLO US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,740	1,533,333.16	0.18
266	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	罗宾逊全球物流有限公司	CHRW US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,064	1,532,944.13	0.18
267	DOW INC	陶氏公司	DOW US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	5,312	1,532,355.25	0.18
268	DEXCOM INC	Dexcom 股份有限公司	DXCM US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,740	1,531,774.72	0.18
269	MOTOROLA SOLUTIONS INC	摩托罗拉解决方案股份有限公司	MSI US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	461	1,531,761.99	0.18
270	VERALTO CORP	Veralto 公司	VLTO US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,092	1,531,633.83	0.18
271	MOSAIC CO/TH E	Mosaic 公司	MOS US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	8,667	1,531,379.79	0.18
272	GOLDMAN SACHS GROUP INC	高盛	GS US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	372	1,531,234.44	0.18
273	BAKER HUGHES	贝克休斯公司	BKR US	纳 斯 达 克 证 券	美国	5,192	1,530,955.53	0.18

	S CO			交易所				
274	AMERI PRISE FINAN CIAL INC	阿默普 莱斯金 融公司	AMP US	美国纽 约证券 交易所	美国	400	1,530,927.92	0.18
275	KEURI G DR PEPPE R INC	Keurig Dr Pepper 有限公 司	KDP US	纳斯达 克证券 交易所	美国	6,629	1,530,579.14	0.18
276	REALT Y INCOM E CORP	Realty Income 公司	O US	美国纽 约证券 交易所	美国	3,985	1,529,970.79	0.18
277	CHEVR ON CORP	雪佛龙	CVX US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,469	1,529,475.58	0.18
278	S&P GLOBA L INC	标普全 球	SPGI US	美国纽 约证券 交易所	美国	427	1,528,676.59	0.18
279	MOLSO N COORS BEVER AGE CO - B	莫尔森 库尔斯 饮料公 司	TAP US	美国纽 约证券 交易所	美国	3,710	1,528,665.02	0.18
280	NVR INC	NVR 股 份有限 公司	NVR US	美国纽 约证券 交易所	美国	26	1,528,623.32	0.18
281	CBOE GLOBA L MARKE TS INC	Cboe 环球市 场公司	CBOE US	巴兹全 球市场	美国	1,088	1,528,219.34	0.18
282	BANK OF NEW YORK MELLO N CORP	纽约梅 隆银行	BK US	美国纽 约证券 交易所	美国	2,767	1,528,171.96	0.18
283	COSTC O WHOLE SALE	开市客	COST US	纳斯达 克证券 交易所	美国	232	1,528,071.54	0.18

	CORP							
284	NVIDIA CORP	英伟达	NVDA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,582	1,527,152.43	0.18
285	INTUITIVE SURGICAL INC	直觉外科手术公司	ISRG US	纳斯达克证券交易所	美国	407	1,527,087.31	0.18
286	MEDTRONIC PLC	美敦力	MDT US	美国纽约证券交易所	美国	2,659	1,526,822.77	0.18
287	FORTINET INC	Fortinet 股份有限公司	FTNT US	纳斯达克证券交易所	美国	2,248	1,526,751.75	0.18
288	CAMDEN PROPERT Y TRUST	Camden 房地产信托公司	CPT US	美国纽约证券交易所	美国	1,830	1,526,479.74	0.18
289	TEXAS PACIFIC LAND CORP	德克萨斯州太平洋土地公司	TPL US	美国纽约证券交易所	美国	192	1,526,415.91	0.18
290	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	国际香料	IFF US	美国纽约证券交易所	美国	2,510	1,525,525.84	0.18
291	WATERS CORP	沃特世公司	WAT US	美国纽约证券交易所	美国	572	1,525,382.51	0.18
292	ONEOK INC	Oneok 股份有限公司	OKE US	美国纽约证券交易所	美国	2,113	1,524,984.56	0.18
293	CONSOLIDATED EDISON INC	联合爱迪生	ED US	美国纽约证券交易所	美国	2,377	1,524,657.56	0.18
294	HILTON	希尔顿全球控	HLT US	美国纽约证券	美国	858	1,524,395.68	0.18

	WORLD WIDE HOLDI NGS INC	股股份 有限公 司		交易所				
295	MARKE TAXES S HOLDI NGS INC	Market Axess 控股公 司	MKTX US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	938	1, 524, 124. 25	0. 18
296	RAYMO ND JAMES FINAN CIAL INC	Raymon d James 金融股 份有限 公司	RJF US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	1, 365	1, 524, 123. 74	0. 18
297	LIVE NATIO N ENTER TAINM ENT INC	Live Nation 娱乐公 司	LYV US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	1, 637	1, 523, 879. 70	0. 18
298	COGNI ZANT TECH SOLUT IONS- A	高知特 科技解 决方案 公司	CTSH US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	2, 756	1, 523, 483. 62	0. 18
299	AUTOD ESK INC	欧特克	ADSK US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	717	1, 523, 392. 25	0. 18
300	EXXON MOBIL CORP	埃克森 美孚石 油公司	XOM US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	1, 970	1, 523, 314. 69	0. 18
301	QUALC OMM INC	高通公 司	QCOM US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	1, 379	1, 522, 804. 89	0. 18
302	KENVU E INC	Kenvue 公司	KVUE US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	9, 922	1, 522, 752. 56	0. 18
303	INVIT ATION	邀请家 园公司	INVH US	美 国 纽 约 证 券	美国	6, 623	1, 522, 052. 48	0. 18

	HOMES INC			交易所				
304	BALL CORP	波尔	BALL US	美国 纽 约 证 券 交易所	美国	3,840	1,521,778.53	0.18
305	METTL ER-TO LEDO INTER NATIO NAL	梅特勒 -托利 多国际 股份有 限公司	MTD US	美国 纽 约 证 券 交易所	美国	173	1,521,760.13	0.18
306	CSX CORP	CSX 公 司	CSX US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	6,560	1,521,721.02	0.18
307	HUMAN A INC	Humana 股份有 限公司	HUM US	美国 纽 约 证 券 交易所	美国	834	1,521,023.32	0.18
308	NIKE INC -CL B	耐克公 司	NKE US	美国 纽 约 证 券 交易所	美国	2,796	1,520,873.65	0.18
309	CAPIT AL ONE FINAN CIAL CORP	第一资 本金融	COF US	美国 纽 约 证 券 交易所	美国	1,185	1,518,975.05	0.18
310	STANL EY BLACK & DECKE R INC	史丹利 百得公 司	SWK US	美国 纽 约 证 券 交易所	美国	2,631	1,518,499.11	0.18
311	TARGA RESOU RCES CORP	Targa 资源公 司	TRGP US	美国 纽 约 证 券 交易所	美国	1,183	1,517,942.08	0.18
312	EVERS OURCE ENERG Y	Eversource 能源公 司	ES US	美国 纽 约 证 券 交易所	美国	3,675	1,517,149.56	0.18
313	REVVIT TY INC	Revvit y 股份 有限公司	RVTY US	美国 纽 约 证 券 交易所	美国	1,890	1,516,341.94	0.18
314	GE	通用电	GEV US	美国 纽	美国	641	1,515,631.94	0.18

	VERNO VA INC	气 Vernov a 股份 有限公 司		约 证 券 交 易 所				
315	HERSH EY CO/TH E	好时公 司	HSY US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,245	1,515,607.65	0.18
316	AKAMA I TECHN OLOGI ES INC	阿卡迈 技术公 司	AKAM US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,204	1,515,405.29	0.18
317	WW GRAIN GER INC	固安捷 股份有 限公司	GWW US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	200	1,515,386.60	0.18
318	GEN DIGIT AL INC	Gen Digita l 股份 有限公 司	GEN US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	7,694	1,514,320.71	0.18
319	ELEVA NCE HEALT H INC	Elevan ce 健 康股份 有限公 司	ELV US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	571	1,514,178.23	0.18
320	TRIMB LE INC	天宝股 份有限 公司	TRMB US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,981	1,514,146.32	0.18
321	ARCHE R-DAN IELS- MIDLA ND CO	Archer -Danie ls-Mid land 公司	ADM US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	4,166	1,512,916.09	0.18
322	NETAP P INC	美国网 域存储 技术有 限公司	NTAP US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,813	1,512,820.63	0.18
323	HOLOG IC INC	豪洛捷 公司	HOLX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,919	1,512,660.12	0.18
324	INSUL	Insule	PODD	纳 斯 达	美国	806	1,512,600.52	0.18

	ET CORP	t 股份 有限公司	US	克 证 券 交易所				
325	ECOLA B INC	艺康集 团	ECL US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	898	1, 512, 578. 53	0. 18
326	POOL CORP	Pool 公司	POOL US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	617	1, 512, 151. 68	0. 18
327	CHARL ES RIVER LABOR ATORI ES	查理斯 河实验 室国际 有限公司	CRL US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	1, 139	1, 511, 428. 67	0. 18
328	BANK OF AMERI CA CORP	美国银 行公司	BAC US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	4, 784	1, 511, 409. 98	0. 18
329	PINNA CLE WEST CAPIT AL	Pinnac le 西 部资本	PNW US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	2, 480	1, 511, 214. 46	0. 18
330	CBRE GROUP INC – A	世邦魏 理仕	CBRE US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	1, 601	1, 510, 967. 82	0. 18
331	HEALT HPEAK PROPE RTIES INC	Health peak Proper ties 公司	DOC US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	10, 366	1, 510, 418. 13	0. 18
332	CHART ER COMMU NICAT IONS INC–A	Charte r 通信 公司	CHTR US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	613	1, 510, 412. 30	0. 18
333	DELTA AIR LINES INC	达美航 空有限 公司	DAL US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	3, 473	1, 510, 401. 45	0. 18

334	AMGEN INC	安进公 司	AMGN US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	806	1,510,109.17	0.18
335	INCYT E CORP	因赛特 公司	INCY US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	3,041	1,509,864.98	0.18
336	AMAZO N.COM INC	亚马逊 公司	AMZN US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	957	1,509,249.36	0.18
337	VERIZ ON COMMU NICAT IONS INC	Verizo n 通信 股份有 限公司	VZ US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	5,250	1,509,186.61	0.18
338	FASTE NAL CO	法思诺 公司	FAST US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	2,919	1,508,883.19	0.18
339	LKQ CORP	LKQ 公 司	LKQ US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	5,710	1,508,431.83	0.18
340	WALMA RT INC	沃尔玛 股份有 限公司	WMT US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	2,321	1,507,424.37	0.18
341	FORD MOTOR CO	福特汽 车	F US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	21,180	1,507,278.09	0.18
342	TESLA INC	特斯拉 公司	TSLA US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	519	1,506,638.03	0.18
343	APPLI ED MATER IALS INC	应用材 料	AMAT US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	1,288	1,505,735.75	0.18
344	NETFL IX INC	奈飞公 司	NFLX US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	235	1,505,683.70	0.18
345	DOLLA R GENER AL CORP	达乐公 司	DG US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	2,762	1,505,357.64	0.18
346	DOVER	都福	DOV US	美 国 纽	美国	1,116	1,504,974.93	0.18

	CORP			约 证 券 交 易 所				
347	INVE CO LTD	景顺有 限公司	IVZ US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	11,976	1,504,823.11	0.18
348	LINDE PLC	Linde 公司	LIN US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	500	1,504,783.71	0.18
349	ORACL E CORP	甲骨文	ORCL US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,256	1,504,530.97	0.18
350	WALGR EENS BOOTS ALLIA NCE INC	沃博联 股份有 限公司	WBA US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	22,431	1,504,397.19	0.18
351	GENUI NE PARTS CO	原配部 件	GPC US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,792	1,504,057.11	0.18
352	SYNCH RONY FINAN CIAL	同步金 融公司	SYF US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,217	1,503,130.38	0.18
353	PNC FINAN CIAL SERVI CES GROUP	PNC 财 务服务	PNC US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,084	1,502,730.71	0.18
354	UNITE DHEAL TH GROUP INC	联合健 康集团	UNH US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	413	1,501,801.82	0.18
355	MONOL ITHIC POWER SYSTE MS INC	芯源系 统有限 公司	MPWR US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	353	1,501,441.83	0.18
356	AVERY DENNI SON	艾利丹 尼森	AVY US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,116	1,501,204.47	0.18

	CORP							
357	GODADDY INC - CLASS A	GoDaddy 股份有限公司	GDDY US	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,058	1,501,063.43	0.18
358	AES CORP	爱伊斯科公司	AES US	美国 纽约 证券 交易所	美国	16,224	1,500,958.62	0.18
359	FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	繁德信息技术有限公司	FIS US	美国 纽约 证券 交易所	美国	2,585	1,500,869.27	0.18
360	WORKDAY INC-CLASS A	Workday 股份有限公司	WDAY US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	809	1,500,551.69	0.18
361	EMERSON ELECTRIC CO	艾默生电气	EMR US	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,684	1,500,205.57	0.18
362	CITIZENS FINANCIAL GROUP	公民金融集团股份有限公司	CFG US	美国 纽约 证券 交易所	美国	4,769	1,500,157.55	0.18
363	AIRBNB INC-CLASS A	爱彼迎股份有限公司	ABNB US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	1,588	1,500,068.70	0.18
364	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	亿滋国际	MDLZ US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	3,493	1,499,765.42	0.18
365	HOME DEPOT INC	家得宝	HD US	美国 纽约 证券 交易所	美国	536	1,498,771.62	0.18
366	ROLLINS INC	Rollins 公司	ROL US	美国 纽约 证券 交易所	美国	4,498	1,498,654.17	0.18

				交易所				
367	IDEXX LABOR ATORI ES INC	爱德士 股份有 限公司	IDXX US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	504	1,497,873.94	0.18
368	COMCA ST CORP- CLASS A	康卡斯 特公司	CMCSA US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	5,552	1,497,822.18	0.18
369	NRG ENERG Y INC	NRG 能 源股份 有限公 司	NRG US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	2,309	1,497,472.97	0.18
370	GE HEALT HCARE TECHN OLOGI ES INC	GE Health Care Techno logies 公司	GEHC US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	2,664	1,497,138.99	0.18
371	MICRO SOFT CORP	微软	MSFT US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	494	1,496,775.84	0.18
372	AMPHE NOL CORP- CL A	安费诺 公司	APH US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	2,998	1,496,704.67	0.18
373	VISTR A CORP	Vistra 公司	VST US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	1,510	1,496,507.71	0.18
374	PROLO GIS INC	安博	PLD US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	1,969	1,496,073.53	0.18
375	ALEXA NDRIA REAL ESTAT E EQUIT IES, I NC	亚历山 大房地 产股份 有限公 司	ARE US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	2,132	1,495,018.99	0.18
376	AIR PRODU CTS &	空气产 品公司	APD US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	717	1,494,890.18	0.18

	CHEMICALS INC							
377	LAS VEGAS SANDS CORP	拉斯维加斯金沙公司	LVS US	美国纽约证券交易所	美国	4,049	1,494,875.51	0.18
378	ROPER TECHNOLOGIES INC	儒博技术公司	ROP US	纳斯达克证券交易所	美国	400	1,494,755.90	0.18
379	HOST HOTEL S & RESORTS INC	Host 酒店及度假股份有限公司	HST US	纳斯达克证券交易所	美国	11,859	1,493,531.57	0.18
380	HOWMET AEROSPACE INC	Howmet 航空航天股份有限公司	HWM US	美国纽约证券交易所	美国	1,899	1,492,984.89	0.18
381	SALESFORCE INC	Salesforce 股份有限公司	CRM US	美国纽约证券交易所	美国	621	1,492,447.92	0.18
382	DEVON ENERGY CORP	戴文能源	DVN US	美国纽约证券交易所	美国	6,343	1,492,357.77	0.18
383	FIFTH THIRD BANKCORP	五三银行	FITB US	纳斯达克证券交易所	美国	4,910	1,492,274.46	0.18
384	INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	洲际交易所 (ICE)	ICE US	美国纽约证券交易所	美国	1,393	1,492,102.87	0.18
385	CUMMINS INC	康明斯	CMI US	美国纽约证券交易所	美国	595	1,490,996.36	0.18
386	UNIVERSAL	Universal 保	UHS US	美国纽约证券	美国	1,156	1,490,942.59	0.18

	HEALTH SERVICES-B	健服务股份有限公司		交易所				
387	BAXTER INTERNATIONAL INC	百特	BAX US	美国纽约证券交易所	美国	7,112	1,490,772.95	0.18
388	XYLEM INC	赛莱默公司	XYL US	美国纽约证券交易所	美国	1,787	1,490,354.73	0.18
389	PAYPAL HOLDINGS INC	Paypal 控股股份有限公司	PYPL US	纳斯达克证券交易所	美国	2,429	1,490,264.22	0.18
390	CARMAX INC	CarMax 股份有限公司	KMX US	美国纽约证券交易所	美国	2,534	1,489,291.56	0.18
391	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	皇家加勒比国际游轮有限公司	RCL US	美国纽约证券交易所	美国	898	1,489,146.21	0.18
392	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	江森自控国际有限公司	JCI US	美国纽约证券交易所	美国	2,624	1,488,806.20	0.18
393	AMCOR PLC	安姆科公司	AMCR US	美国纽约证券交易所	美国	22,004	1,488,413.14	0.18
394	MGM RESORTS INTERNATIONAL	美高梅国际酒店集团	MGM US	美国纽约证券交易所	美国	5,968	1,486,497.86	0.18
395	EXTRASPACE	Extra Space	EXR US	美国纽约证券交易所	美国	1,382	1,486,181.57	0.18

	STORAGE INC	Storage 有限公司		交易所				
396	MCCORMICK & CO-NORTH VTG SHRS	味好美股份有限公司	MKC US	美国 纽约 证券 交易所	美国	2,710	1,485,198.20	0.18
397	SOLVENTUM CORP	Solventum 公司	SOLV US	美国 纽约 证券 交易所	美国	3,127	1,484,905.06	0.18
398	TRANE TECHNOLOGIES PLC	特灵科技公共有限公司	TT US	美国 纽约 证券 交易所	美国	559	1,484,164.87	0.18
399	CARNIVAL CORP	嘉年华公司	CCL US	美国 纽约 证券 交易所	美国	8,285	1,484,132.88	0.18
400	KEYCORP	KeyCorp 公司	KEY US	美国 纽约 证券 交易所	美国	12,041	1,483,561.69	0.18
401	SMITH (A.O.) CORP	A.O. 史密斯公司	AOS US	美国 纽约 证券 交易所	美国	3,025	1,483,220.31	0.18
402	HUNTINGTON BANCSHARES INC	俄亥俄州亨廷顿银行控股公司	HBAN US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	12,679	1,482,875.84	0.18
403	NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS	挪威邮轮控股有限公司	NCLH US	美国 纽约 证券 交易所	美国	8,017	1,482,804.53	0.18
404	OMNICOM GROUP	Omnicom 集团	OMC US	美国 纽约 证券 交易所	美国	2,394	1,480,664.91	0.18
405	GARMIN LTD	佳明有限公司	GRMN US	美国 纽约 证券 交易所	美国	998	1,479,714.03	0.18
406	VICI PROPERTIES	VICI Properties	VICI US	美国 纽约 证券 交易所	美国	7,042	1,478,631.02	0.18

	INC	股份有 限公司						
407	HUBBEL INC	哈贝尔 公司	HUBB US	美国纽 约证券 交易所	美国	491	1,478,474.10	0.18
408	MICRO CHIP TECHN OLOGY INC	微芯科 技股份 有限公 司	MCHP US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	3,584	1,477,520.99	0.18
409	TEXTR ON INC	德事隆	TXT US	美国纽 约证券 交易所	美国	2,684	1,475,772.48	0.18
410	INGER SOLL- RAND INC	英格索 兰股份 有限公 司	IR US	美国纽 约证券 交易所	美国	2,269	1,475,445.98	0.18
411	INTER PUBLI C GROUP OF COS INC	Interp ublic 集团	IPG US	美国纽 约证券 交易所	美国	7,325	1,475,393.94	0.18
412	DUPON T DE NEMOU RS INC	杜邦公 司	DD US	美国纽 约证券 交易所	美国	2,691	1,474,978.81	0.18
413	O'REIL LY AUTOM OTIVE INC	O'Reil ly 汽 车股份 有限公 司	ORLY US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	173	1,474,652.82	0.18
414	ILLIN OIS TOOL WORKS	伊利诺 伊工具 股份有 限公司	ITW US	美国纽 约证券 交易所	美国	809	1,474,556.78	0.18
415	M & T BANK CORP	M&T 银 行	MTB US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,091	1,474,476.77	0.18
416	BXP INC	波士顿 地产公 司	BXP US	美国纽 约证券 交易所	美国	2,756	1,473,163.09	0.18
417	TRACT OR	拖拉机 供应公	TSCO US	纳 斯 达 克 证 券	美国	3,861	1,472,649.12	0.18

	SUPPLY COMPANY	司		交易所				
418	IRON MOUNTAIN INC	美国铁山公司	IRM US	美国纽约证券交易所	美国	1,949	1,472,611.24	0.18
419	T ROWE PRICE GROUP INC	普徠仕	TROW US	纳斯达克证券交易所	美国	1,811	1,472,227.38	0.18
420	ADVANCED MICRO DEVICES	AMD 公司	AMD US	纳斯达克证券交易所	美国	1,694	1,470,877.90	0.18
421	DAYFORCE INC	Dayforce 股份有限公司	DAY US	美国纽约证券交易所	美国	2,816	1,470,417.70	0.18
422	TYSON FOODS INC-CLASS A	泰森食品公司	TSN US	美国纽约证券交易所	美国	3,560	1,469,930.04	0.18
423	ON SEMICONDUCTOR	安森美半导体公司	ON US	纳斯达克证券交易所	美国	3,243	1,469,820.41	0.18
424	CORPAY INC	Corpay 股份有限公司	CPAY US	美国纽约证券交易所	美国	604	1,469,349.79	0.18
425	STARBUCKS CORP	星巴克	SBUX US	纳斯达克证券交易所	美国	2,240	1,469,308.96	0.18
426	CARRIER GLOBAL CORP	开利全球公司	CARR US	美国纽约证券交易所	美国	2,991	1,467,624.43	0.18
427	REGIONS FINANCIAL CORP	Regions 金融公司	RF US	美国纽约证券交易所	美国	8,680	1,467,537.74	0.18

428	LENNO X INTER NATIO NAL INC	雷诺士 国际有 限公司	LII US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	335	1,467,263.86	0.18
429	ENPHA SE ENERG Y INC	Enphas e 能源 股份有 限公司	ENPH US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	2,970	1,466,286.96	0.18
430	AXON ENTER PRISE INC	Axon Enterp rise 股份有 限公司	AXON US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	343	1,465,367.99	0.18
431	META PLATF ORMS INC-C LASS A	Meta 平台股 份有限 公司	META US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	348	1,464,690.27	0.18
432	BOOKI NG HOLDI NGS INC	Bookin g 控股 股份有 限公司	BKNG US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	41	1,464,314.60	0.18
433	LAM RESEA RCH CORP	泛林集 团	LRCX US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	2,818	1,463,156.70	0.18
434	SERVI CENOW INC	Servic eNow 公司	NOW US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	192	1,463,148.79	0.18
435	SEAGA TE TECHN OLOGY HOLDI NGS	Seagat e Techno logy 控股公 共有限 公司	STX US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	2,358	1,462,975.84	0.18
436	ESTEE LAUDE R COMPA NIES-	雅诗兰 黛	EL US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	2,714	1,462,808.63	0.18

	CL A							
437	COSTA R GROUP INC	CoStar 集团股 份有限 公司	CSGP US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	2,842	1,462,543.09	0.18
438	FIRST SOLAR INC	福思第 一太阳 能公司	FSLR US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	1,154	1,461,983.69	0.18
439	CONST ELLAT ION BRAND S INC-A	星座品 牌股份 有限公 司	STZ US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	919	1,459,956.85	0.18
440	PENTA IR PLC	Pentair 公 共有限 公司	PNR US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	2,018	1,459,903.08	0.18
441	EXPED ITORS INTL WASH INC	华盛顿 康捷国 际物流 公司	EXPD US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	1,831	1,457,950.35	0.17
442	CHIPOT LE MEXIC AN GRILL INC	Chipotle Mexican Grill 股份有 限公司	CMG US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	3,362	1,457,294.27	0.17
443	VULCA N MATER IALS CO	Vulcan 材料	VMC US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	788	1,457,068.84	0.17
444	ZOETIS INC	硕腾股 份有限 公司	ZTS US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	1,244	1,456,980.28	0.17
445	EASTM AN CHEMI CAL CO	伊士曼 化工	EMN US	美 国 纽 约 证 券 交易 所	美国	2,219	1,456,650.76	0.17
446	L3HARRIS	L3Harris	LHX US	美 国 纽 约 证 券	美国	963	1,455,648.41	0.17

	TECHNOLOGIES INC	Technologies 股份有限公司		交易所				
447	AMERICAN TOWER CORP	美国发射塔公司	AMT US	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,104	1,455,540.59	0.17
448	DOMIN O'S PIZZA INC	达美乐 披萨公 司	DPZ US	美国 纽约 证券 交易所	美国	482	1,454,388.14	0.17
449	MARATHON PETROLEUM CORP	马拉松 石油公 司	MPC US	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,450	1,454,033.61	0.17
450	BUNGE GLOBAL SA	Bunge Global SA 公 司	BG US	美国 纽约 证券 交易所	美国	2,600	1,453,321.96	0.17
451	IDEX CORP	艺达思 集团	IEX US	美国 纽约 证券 交易所	美国	966	1,453,308.59	0.17
452	EATON CORP PLC	伊顿	ETN US	美国 纽约 证券 交易所	美国	609	1,452,839.11	0.17
453	COPART INC	Copart 股份有 限公司	CPRT US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	3,521	1,452,561.35	0.17
454	CROWN CASTLE INC	冠城股 份有限 公司	CCI US	美国 纽约 证券 交易所	美国	2,223	1,450,327.85	0.17
455	MASCO CORP	马斯可	MAS US	美国 纽约 证券 交易所	美国	2,778	1,449,177.56	0.17
456	PALO ALTO NETWORKS INC	Palo Alto Networks 股份有 限公司	PANW US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	1,106	1,446,649.40	0.17
457	SHERWIN-WI	宣伟公 司	SHW US	美国 纽约 证券	美国	592	1,446,583.26	0.17

	LLIAM S CO/TH E			交易所				
458	BORGW ARNER INC	博格华 纳股份 有限公 司	BWA US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	6,328	1,446,069.73	0.17
459	WEYER HAEUS ER CO	惠好	WY US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	7,137	1,444,196.64	0.17
460	PTC INC	PTC 公 司	PTC US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	1,092	1,443,330.37	0.17
461	DR HORTO N INC	霍顿房 屋公司	DHI US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	1,434	1,441,287.71	0.17
462	MOHAW K INDUS TRIES INC	Mohawk 工业股 份有限 公司	MHK US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	1,683	1,441,243.94	0.17
463	HENRY SCHEI N INC	亨利香 恩公司	HSIC US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	2,896	1,440,578.36	0.17
464	PHILL IPS 66	Phillips 66 公 司	PSX US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	1,759	1,440,575.99	0.17
465	FRANK LIN RESOU RCES INC	富兰克 林资源	BEN US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	9,847	1,436,210.91	0.17
466	OLD DOMIN ION FREIG HT LINE	Old Domini on Freigh t Line 股份有 限公司	ODFL US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	1,132	1,435,414.22	0.17
467	WYNN RESOR TS LTD	永利度 假村有 限公司	WYNN US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	2,315	1,433,801.14	0.17
468	VERTE	福泰制	VRTX	纳 斯 达	美国	495	1,432,910.50	0.17

	X PHARM ACEUT ICALS INC	药	US	克 证 券 交 易 所				
469	FAIR ISAAC CORP	费埃哲 公司	FICO US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	100	1,431,160.12	0.17
470	GENER AC HOLDI NGS INC	Genera c 控股 公司	GNRC US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,283	1,429,982.30	0.17
471	CAESA RS ENTER TAINM ENT INC	凯撒娱 乐集团	CZR US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	5,941	1,427,244.02	0.17
472	STEEL DYNAM ICS INC	Steel Dynami cs 股 份有限 公司	STLD US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,737	1,424,306.63	0.17
473	SCHWA B (CHAR LES) CORP	嘉信理 财	SCHW US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,675	1,423,136.07	0.17
474	PACCA R INC	帕卡	PCAR US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,903	1,422,944.21	0.17
475	BLACK STONE INC	黑石集 团股份 有限公 司	BX US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,145	1,419,140.40	0.17
476	PULTE GROUP INC	Pulte 集团公 司	PHM US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,808	1,415,332.70	0.17
477	ELECT RONIC ARTS INC	电子艺 界	EA US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,345	1,414,486.63	0.17
478	LAMB	蓝威斯	LW US	美 国 纽	美国	2,941	1,412,858.67	0.17

	WESTON HOLDINGS INC	顿控股股份有限公司		约 证 券 交易所				
479	UNITED RENTALS INC	联合租赁公司	URI US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	279	1,412,799.22	0.17
480	NUCOR CORP	纽柯公司	NUE US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	1,676	1,406,093.88	0.17
481	FREIGHT-MCMORAN INC	自由港迈克墨伦股份有限公司	FCX US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	5,127	1,403,435.61	0.17
482	NEWMONT CORP	纽蒙黄金公司	NEM US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	5,214	1,395,017.42	0.17
483	ALIGN TECHNOLOGY INC	Align 科技股份有限公司	ALGN US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	920	1,378,945.02	0.17
484	HASBRO INC	孩之宝	HAS US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	3,424	1,376,117.39	0.17
485	CVS HEALTH CORP	CVS 健康公司	CVS US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	4,259	1,374,325.11	0.16
486	CINTAS CORP	Cintas 公司	CTAS US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	1,045	1,372,420.11	0.16
487	LENNAR CORP--A	Lennar 公司	LEN US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	1,394	1,366,513.26	0.16
488	FMC CORP	FMC 公司	FMC US	美 国 纽 约 证 券 交易所	美国	3,905	1,364,516.82	0.16
489	WESTERN DIGITAL	西部数据公司	WDC US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	3,177	1,361,802.92	0.16

	CORP							
490	PAYCOM SOFTWARE INC	Paycom 软件股份有限公司	PAYC US	美国 纽约 证券 交易所	美国	917	1,351,113.62	0.16
491	BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	百富门 公司	BF/B US	美国 纽约 证券 交易所	美国	4,901	1,338,048.63	0.16
492	NORDSON CORP	诺信公 司	NDSN US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	883	1,328,121.02	0.16
493	BUILDERS FIRST SOURCE INC	Builde rs FirstS ource 股份有 限公司	BLDR US	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,280	1,315,120.66	0.16
494	ALBEMARLE CORP	雅保公 司	ALB US	美国 纽约 证券 交易所	美国	2,123	1,313,664.57	0.16
495	MICRON TECHNOLOGY INC	美光科 技股份 有限公 司	MU US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	2,160	1,306,747.61	0.16
496	ADOBE INC	奥多比	ADBE US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	400	1,278,615.08	0.15
497	SUPER MICRO COMPUTER INC	Super Micro Comput er 股 份有限 公司	SMCI US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	5,758	1,261,591.80	0.15
498	NEWS CORP - CLASS A	新闻集 团	NWSA US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	5,717	1,131,786.12	0.14
499	FOX CORP -	福克斯 公司	FOXA US	纳 斯 达 克 证 券	美国	3,054	1,066,494.89	0.13

	CLASS A			交易所				
500	ALPHA BET INC-CL A	Alphabet 公司	GOOGL US	纳斯达克 证券 交易所	美国	620	843,673.75	0.10
501	ALPHA BET INC-CL C	Alphabet 公司	GOOG US	纳斯达克 证券 交易所	美国	505	691,324.24	0.08
502	FOX CORP - CLASS B	福克斯 公司	FOX US	纳斯达克 证券 交易所	美国	1,822	599,068.89	0.07
503	NEWS CORP - CLASS B	新闻集 团	NWS US	纳斯达克 证券 交易所	美国	1,689	369,456.95	0.04

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

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	占期初基金资产净值比例(%)
1	SUPER MICRO COMPUTER INC	SMCI US	2,407,244.96	0.53
2	CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	CRWD US	2,051,729.81	0.45
3	VISTRA CORP	VST US	2,026,583.50	0.44
4	ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	ERIE US	1,907,147.59	0.42
5	MODERNA INC	MRNA US	1,872,157.37	0.41
6	COOPER COS INC/THE	COO US	1,865,474.81	0.41
7	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	DOC US	1,846,016.96	0.40
8	CONOCOPHILLIPS	COP US	1,823,728.21	0.40
9	DECKERS OUTDOOR CORP	DECK US	1,764,581.13	0.39
10	EXXON MOBIL CORP	XOM US	1,742,328.88	0.38
11	INTEL CORP	INTC US	1,733,985.00	0.38
12	TEXAS PACIFIC LAND	TPL US	1,733,053.94	0.38

	CORP			
13	DELL TECHNOLOGIES INC	DELL US	1,643,749.52	0.36
14	CELANESE CORP	CE US	1,642,510.27	0.36
15	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	WBA US	1,627,647.88	0.36
16	PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	PLTR US	1,623,061.60	0.36
17	DOLLAR TREE INC	DLTR US	1,606,823.34	0.35
18	APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	APO US	1,599,098.46	0.35
19	WORKDAY INC-CLASS A	WDAY US	1,545,551.56	0.34
20	AMENTUM HOLDINGS INC	AMTM US	1,535,558.07	0.34

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

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	CATALENT INC	CTLT US	2,209,062.53	0.48
2	BATH & BODY WORKS INC	BBWI US	1,823,734.31	0.40
3	NVIDIA CORP	NVDA US	1,794,860.19	0.39
4	PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	PLTR US	1,589,219.27	0.35
5	UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	UAL US	1,579,060.81	0.35
6	BIO-RAD LABORATORIES-A	BIO US	1,555,843.52	0.34
7	AXON ENTERPRISE INC	AXON US	1,490,847.90	0.33
8	EXXON MOBIL CORP	XOM US	1,455,220.14	0.32
9	TESLA INC	TSLA US	1,421,154.12	0.31
10	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	PEAK US	1,365,555.60	0.30
11	GE VERNOVA INC	GEV US	1,333,272.61	0.29
12	COOPER COS INC/THE	COO US	1,292,530.13	0.28
13	MARATHON OIL CORP	MRO US	1,252,342.42	0.27
14	AMERICAN AIRLINES GROUP INC	AAL US	1,235,840.16	0.27
15	ZIONS BANCORP NA	ZION US	1,227,950.31	0.27
16	CONOCOPHILLIPS	COP US	1,184,633.27	0.26

17	VISTRA CORP	VST US	1,180,942.91	0.26
18	AMENTUM HOLDINGS INC	AMTM US	1,139,218.91	0.25
19	COMERICA INC	CMA US	1,131,777.06	0.25
20	ETSY INC	ETSY US	1,129,982.16	0.25

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

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	436,950,227.96
卖出收入（成交）总额	159,345,257.25

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

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

无。

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

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

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未超出基金合同规定的备选股票库。

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	789,805.31
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,850,413.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,640,218.63

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

8.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 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 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
大成标普 500 等权 重 指 数 (QDII)A	87,826	3,249.65	89,478,008.32	31.35	195,925,987.83	68.65
大成标普 500 等权 重 指 数 (QDII)C	38,949	939.19	3,360,081.28	9.19	33,220,567.94	90.81
合计	126,775	2,539.81	92,838,089.60	28.83	229,146,555.77	71.17

注：1、上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

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	大成标普 500 等权重指数 (QDII)A	27,542.92	0.0097
	大成标普 500 等权重指数 (QDII)C	530.65	0.0015
	合计	28,073.57	0.0087

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

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

9.4 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	大成标普 500 等权重指数 (QDII)A	大成标普 500 等权重指数 (QDII)C
基金合同生效日 （2011 年 3 月 23 日） 基金份额总额	822,754,222.26	—
本报告期期初基金份	182,508,938.23	8,360,879.29

额总额		
本报告期基金总申购份额	196,334,636.96	73,350,880.21
减：本报告期基金总赎回份额	93,439,579.04	45,131,110.28
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	285,403,996.15	36,580,649.22

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

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

无。

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

一、基金管理人的重大人事变动

2024 年 10 月 10 日，公司召开大成基金管理有限公司 2024 年第一次临时股东会，会议审议通过《关于卢锋先生辞去公司第八届董事会独立董事职务的议案》，同意卢锋先生自股东会决议作出之日起辞去公司第八届董事会独立董事及董事会下属审计委员会主任委员、合规与风险管理委员会委员、战略与提名薪酬考核委员会委员职务，不再履行上述职责。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

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

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

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）为本基金提供审计服务，自 2024 年 12 月 11 日起，改聘容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务至今，本年度应支付的审计费用为 55,000.00 元。

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

本报告期内，基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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(%)	
Morgan Stanley	1	491,387,469.08	83.59	150,602.87	86.06	-
CLSA Limited	1	96,480,444.71	16.41	24,395.04	13.94	新增 1 个
Daiwa Capital Markets Hong Kong Limited	1	-	-	-	-	-

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

（一）筛选标准

大成基金管理有限公司（以下简称“公司”）严格按照《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》要求制定了证券公司筛选标准，建立了证券公司尽职调查、证券公司负面筛查、备选池筛选机制，选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易。

（二）筛选流程

1、经公司尽调符合条件的证券公司进入备选池，由股票投委会以公平、公正、公开为原则，结合定性及定量办法科学评估证券公司研究服务能力，形成证券公司白名单，并定期及不定期进行动态调整。

2、公司按照白名单与证券公司进行协议签署。

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

无。

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	大成基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 12 月 31 日
2	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 12 月 12 日
3	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 12 月 12 日
4	大成基金管理有限公司关于暂停武汉佰崧基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 10 月 28 日
5	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 10 月 25 日
6	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2024 年中期报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 8 月 30 日
7	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加深圳前海微众银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 8 月 29 日
8	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华泰证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 8 月 29 日
9	大成标普 500 等权重指数证券投资基金人民币 A、C 类份额增加中国民生银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 8 月 16 日
10	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国中金财富证券有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 8 月 15 日
11	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中银国际证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 8 月 8 日
12	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国联证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 8 月 8 日
13	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国海证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 8 月 8 日

14	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加部分代销机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 8 月 8 日
15	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中邮证券有限责任公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 8 月 8 日
16	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加长城证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 8 月 8 日
17	大成标普 500 等权重指数证券投资基金（人民币）A 类份额增加瑞银基金销售（深圳）有限公司为代销机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 8 月 5 日
18	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加长江证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 8 月 1 日
19	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华宝证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 7 月 24 日
20	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 7 月 19 日
21	关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金暂停大额申购（含定期定额申购）业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 7 月 10 日
22	大成标普 500 等权重指数证券投资基金（人民币 A 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 6 月 28 日
23	大成基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 6 月 28 日
24	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东兴证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 6 月 28 日
25	大成标普 500 等权重指数证券投资基金（美元 C 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 6 月 28 日
26	大成标普 500 等权重指数证券投资基金（人民币 C 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 6 月 28 日
27	大成标普 500 等权重指数证券投资基金（美元 A 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 6 月 28 日
28	大成基金管理有限公司关于旗下部分	中国证监会基金电子披	2024 年 6 月 13 日

	基金增加部分代销机构的公告	露网站、规定报刊及本公司网站	
29	大成基金管理有限公司关于暂停海银基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 6 月 12 日
30	大成标普 500 等权重指数证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 4 月 23 日
31	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 4 月 19 日
32	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国信证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 4 月 15 日
33	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 4 月 2 日
34	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加山西证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 4 月 1 日
35	大成标普 500 等权重指数证券投资基金（人民币）C 类份额增加财信证券股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 4 月 1 日
36	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 3 月 29 日
37	大成标普 500 等权重指数证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 3 月 21 日
38	大成基金管理有限公司关于调整旗下部分基金基金份额净值的小数点保留位数并相应修订基金合同和托管协议的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 3 月 19 日
39	大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 3 月 19 日
40	大成标普 500 等权重指数证券投资基金托管协议	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 3 月 19 日
41	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海万得基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 3 月 4 日
42	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华西证券股份有限公司为销	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本	2024 年 2 月 28 日

	售机构的公告	公司网站	
43	大成标普 500 等权重指数(QDII)C 人民币类份额增加兴业证券股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 2 月 22 日
44	关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金暂停大额申购（含定期定额申购）业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 2 月 7 日
45	关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金暂停大额申购（含定期定额申购）业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 2 月 1 日
46	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 1 月 23 日
47	大成标普 500 等权重指数证券投资基金(人民币)C 类份额增加上海华夏财富投资管理有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 1 月 22 日
48	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 1 月 19 日
49	大成基金管理有限公司关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2023 年度第 1 次分红的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 1 月 16 日
50	关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金暂停大额申购（含定期定额申购）业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 1 月 10 日
51	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金 2024 年境外（地区）主要市场节假日暂停申购赎回安排的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 1 月 5 日
52	关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金恢复大额申购（含定期定额申购）业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 1 月 4 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	20240110-20241223	-	63,391,512.89	-	63,391,512.89	19.69

产品特有风险
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险，甚至有可能引起基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

13.3 查阅方式

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

大成基金管理有限公司

2025 年 3 月 31 日