

嘉实美国成长股票型证券投资基金 2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经由全部独立董事签字同意，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 08 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	40
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	40
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	40

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	74
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	75
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	75
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	75
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	76
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	76
7.11 投资组合报告附注	77
§8 基金份额持有人信息	77
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	77
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	78
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	78
§9 开放式基金份额变动	78
§10 重大事件揭示	79
10.1 基金份额持有人大会决议	79
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	79
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	79
10.4 基金投资策略的改变	79
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	79
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	79
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	80
10.8 其他重大事件	83
§11 备查文件目录	84
11.1 备查文件目录	84
11.2 存放地点	84
11.3 查阅方式	84

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实美国成长股票型证券投资基金	
基金简称	嘉实美国成长股票（QDII）	
基金主代码	000043	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 6 月 14 日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	915,810,918.58 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	嘉实美国成长股票型证券投资基金-人 民币	嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元 现汇
下属分级基金的交 易代码	000043	000044
报告期末下属分级 基金的份额总额	912,336,656.06 份	3,474,262.52 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

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

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	嘉实基金管理有限公司	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)	
	嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币	嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇
本期已实现收益	68,061,989.96	1,507,888.53
本期利润	31,849,220.04	2,799,426.31
加权平均基金份额本期利润	0.0284	0.7126
本期加权平均净值利润率	0.60%	2.46%

本期基金份额净值增长率	3.79%	4.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	914,388,308.88	23,872,044.39
期末可供分配基金份额利润	1.0022	6.8711
期末基金资产净值	4,671,226,194.46	108,546,815.07
期末基金份额净值	5.120	4.364
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	412.00%	336.40%

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

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

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

（4）嘉实美国成长股票(QDII)美元现汇的期末基金份额净值为美元。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	5.68%	0.72%	5.98%	0.73%	-0.30%	-0.01%
过去三个月	16.31%	2.14%	16.78%	2.18%	-0.47%	-0.04%
过去六个月	3.79%	1.88%	5.57%	1.85%	-1.78%	0.03%
过去一年	13.07%	1.60%	15.79%	1.53%	-2.72%	0.07%
过去三年	94.75%	1.33%	88.48%	1.27%	6.27%	0.06%

自基金合同生效起 至今	412.00%	1.22%	433.52%	1.18%	-21.52 %	0.04%
----------------	---------	-------	---------	-------	-------------	-------

嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去一个月	6.05%	0.72%	5.98%	0.73%	0.07%	-0.01%
过去三个月	16.65%	2.16%	16.78%	2.18%	-0.13%	-0.02%
过去六个月	4.20%	1.89%	5.57%	1.85%	-1.37%	0.04%
过去一年	12.56%	1.59%	15.79%	1.53%	-3.23%	0.06%
过去三年	82.67%	1.31%	88.48%	1.27%	-5.81%	0.04%
自基金合同生效起 至今	336.40%	1.20%	433.52%	1.18%	-97.12 %	0.02%

注：本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

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

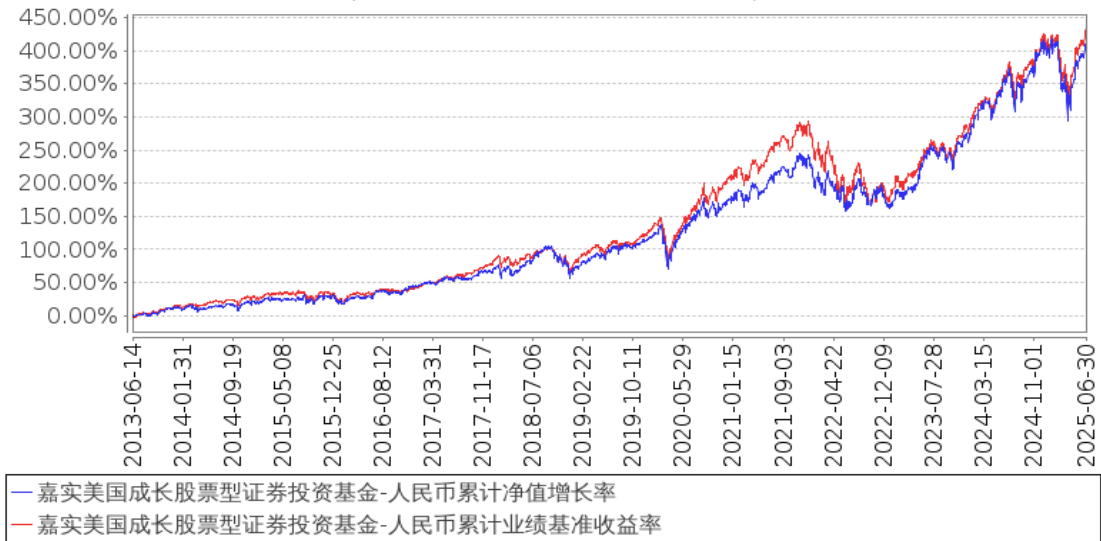
$$\text{Benchmark}(t)=(1+\text{Return}(t)) \times (1+\text{Benchmark}(t-1))-1$$

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

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

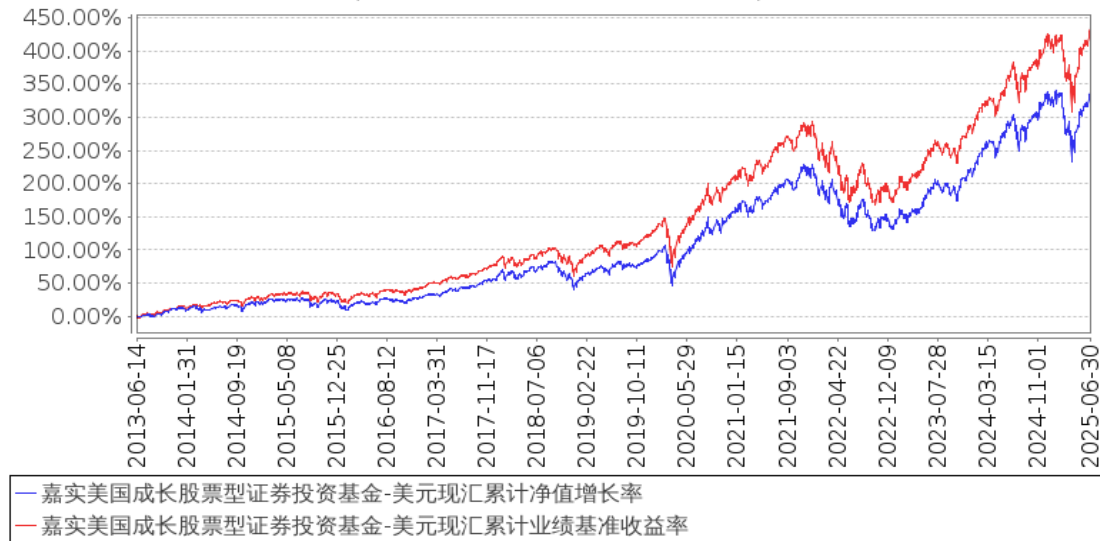
嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013年06月14日至2025年06月30日)



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

(2013年06月14日至2025年06月30日)



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

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止 2025 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 366 只公募基金，覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF、基础设施基金等不同类别。同时，还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张自力	本基金、嘉实全球	2013 年 6 月 14 日	—	29 年	曾任美国世纪投资管理公司（American Century Investments）资深副总经理，研

	价值股票（QDII）基金经理				究部总监暨基金经理，负责直接管理、支持公司旗下近二百亿美元的多项大型公募基金和对冲基金类产品。2012 年 2 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任定量投资部负责人、人工智能投资部负责人，现任股票投研人工智能投资总监，博士后科研工作站导师。博士研究生，毕业于美国德州大学奥斯汀分校和中国科学技术大学，具有基金从业资格。美国国籍。
张楠	本基金、嘉实全球价值股票（QDII）、嘉实上证综合增强策略 ETF 基金经理	2025 年 2 月 22 日	—	13 年	2012 年 1 月加入嘉实基金管理有限公司从事投资模型研究和投资组合管理工作，现任基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

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

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的，合计 5 次，其中 2 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，另 3 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反

向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025 年上半年，全球主要资本市场整体收涨，期间经历了较大的市场波动。美股市场整体表现为指数收涨，道指上涨 4%，标普 500 上涨 5.7%，大盘成长风格和科技板块较强，纳指上涨 8%，费城半导体上涨超 11%，罗素 1000 成长指数上涨略低于 6%。

报告期内，对全球资本市场影响较重大的经济事件，主要是美国本届政府单方面启动的面向全球施加高额关税带来的国际贸易和全球产业链的负面冲击，及由此对全球资本市场预期与信心的打击，包括美国股票市场自身在内的全球各国权益市场都经历了强度较大的波动调整。全球市场及美股本身，在 4 月中旬开始逐步稳健恢复，部分指数于本报告期末附近达到年内新高。

本报告期内，美股整体结构呈现大盘较强、科技占优、价值稳健的特征。市值与风格维度上，罗素 1000 成长上涨 5.93%，罗素 1000 价值上涨 5.07%，罗素 2000 成长下跌 1.13%，罗素 2000 价值下跌 4.02%，清晰表明上半年内小市值区域的相对弱势，而在大盘部分内整体上成长并未显著领先价值。标普 SPX 上涨 5.73%，科技导向的 NDX 上涨 8.12%，细分方向 SOX 上涨超 10%，尤其是科技板块，在经历了关税对全球资本市场的冲击后，从 4 月中旬开始反弹强劲，尤其以部分龙头股拉动更为显著。对美股而言，除了关税对中小企业及其供应链的冲击并影响企业盈利与成长空间外，美联储保持利率水平对于中小企业在实际融资成本以及资本市场估值空间都受到压制影响。美股市场自疫情后持续多个季度的较为强劲的企业盈利增长，盈利一侧的强劲对整个市场的上行起到了推动基础作用并消化估值，且广泛的盈利超预期使得市场呈现更广泛的优质标的投资机会，但自 2024 年 3 季度起，美股总体上的盈利增长驱动力，再次从全市场广泛的超预期态势转向了龙头股拉动的结构。

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

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币基金份额净值为 5.120 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.79%；截至本报告期末嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇基金份额净值为 4.364 美元，本报告期基金份额净值增长率为 4.20%；业绩比较基准收益率为 5.57%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

对企业盈利的回顾上，美股在 2023 年 3 季度、4 季度以及 2024 年前 2 个季度的几次财务披露中，不仅都保持了强劲的盈利水平和盈利成长态势，也展示了逐渐扩张的盈利范围，由此构成了更广泛的选股机会，但从 2024 年 3、4 季报以及 2025 年 1 季报，反应出股票市场又回到以龙头股的盈利拉动整体市场的结构。去年 3 季度有大选等因素企业战略规划和资本开支有所延滞，本报告期内则以关税冲击以及维持不降的利率水平为主要影响因素。

站在当前时点，展望下半年，显著的经济领域重大关切在于关税协议的达成情况，以及美联储开启降息对全球金融市场的影响。就美国经济数据表明，目前美国失业率恶化速度比以往周期更慢，关税带来的成本上升已在美国部分依赖进口的细分行业产生实际影响，即使有短期的关税豁免但产业内依然开启成本收缩战略。美国经济未来走向取决于多种影响力量相互作用，但预期经济衰退的概率极低。目前关税方面的多边协议尚未充分达成，而已经产生的冲击包括产业链负面预期及由此带来的企业策略变更等都尚未完全显现，而积极方面上主要经济大国包括美国中国德国等即将出台的财政刺激，有望支持各国及全球的需求。

我们预期美联储在下半年将降息两次甚至到三次。从历史规律来看，加息转入降息通道后，对利率更为敏感的资产往往表现领先，且利率周期不会反复切换。在利率等金融条件进入更加宽松的环境时，企业融资约束边际放松，相对利好对利率更为敏感的成长股和小盘股。

当前美股的二季报正在逐步披露，对本次财季展望，我们预估依然以龙头企业为拉动主力，需要等到未来包括财政、货币更多维度政策落地，并经过一段时间后才会反应在企业财务数据中，资本市场的反应将领先于财务数据的披露，通过对新政策效果的判断提前反应。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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”部分未在本托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实美国成长股票型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	257,326,149.53	412,180,456.24
结算备付金		—	—
存出保证金		—	—
交易性金融资产	6.4.7.2	4,621,576,193.10	6,385,300,181.99
其中：股票投资		4,614,677,255.99	6,374,467,133.94
基金投资		6,898,937.11	10,833,048.05
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
债权投资	6.4.7.5	—	—
其中：债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
其他投资		—	—
其他债权投资	6.4.7.6	—	—
其他权益工具投资	6.4.7.7	—	—
应收清算款		9,895,614.40	—
应收股利		1,178,602.50	1,077,773.30
应收申购款		5,292,683.53	55,354,353.78
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.8	—	—
资产总计		4,895,269,243.06	6,853,912,765.31
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	6.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付清算款		—	28,563,029.05
应付赎回款		109,590,389.29	73,547,835.40

应付管理人报酬		4,682,515.10	9,102,578.87
应付托管费		780,419.18	1,769,945.90
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	77,710.84
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	442,909.96	427,301.42
负债合计		115,496,233.53	113,488,401.48
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	933,734,769.97	1,366,507,768.39
未分配利润	6.4.7.12	3,846,038,239.56	5,373,916,595.44
净资产合计		4,779,773,009.53	6,740,424,363.83
负债和净资产总计		4,895,269,243.06	6,853,912,765.31

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币基金份额净值 5.120 元，基金份额总额 912,336,656.06 份，嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇基金份额净值 4.364 美元，基金份额总额 3,474,262.52 份，基金份额总额合计为 915,810,918.58 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实美国成长股票型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		76,779,858.32	487,616,809.93
1. 利息收入		346,359.12	146,757.30
其中：存款利息收入	6.4.7.13	346,359.12	146,757.30
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）		91,309,984.12	51,690,656.65
其中：股票投资收益	6.4.7.14	75,089,236.69	43,862,349.02
基金投资收益	6.4.7.15	-603,762.41	-49,181.94
债券投资收益	6.4.7.16	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.17	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-

衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	16,824,509.84	7,877,489.57
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-34,921,232.14	466,295,659.49
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		16,867,256.42	-31,842,489.91
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	3,177,490.80	1,326,226.40
减：二、营业总支出		42,131,211.97	27,216,915.75
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	35,817,895.71	22,665,577.98
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	6,226,959.23	4,407,195.74
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		1,647.59	2,543.11
8. 其他费用	6.4.7.24	84,709.44	141,598.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		34,648,646.35	460,399,894.18
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		34,648,646.35	460,399,894.18
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		34,648,646.35	460,399,894.18

6.3 净资产变动表

会计主体：嘉实美国成长股票型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,366,507,768. 39	-	5,373,916,595. 44	6,740,424,363.8 3
二、本期期初净资产	1,366,507,768. 39	-	5,373,916,595. 44	6,740,424,363.8 3

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-432,772,998.4 2	-	-1,527,878,355 .88	-1,960,651,354. 30
(一)、综合收益总额	-	-	34,648,646.35	34,648,646.35
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-432,772,998.4 2	-	-1,562,527,002 .23	-1,995,300,000. 65
其中：1. 基金申购款	166,320,200.16	-	642,387,900.45	808,708,100.61
2. 基金赎回款	-599,093,198.5 8	-	-2,204,914,902 .68	-2,804,008,101. 26
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	933,734,769.97	-	3,846,038,239. 56	4,779,773,009.5 3
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	401,200,270.43	-	1,089,627,192. 26	1,490,827,462.6 9
二、本期期初净资产	401,200,270.43	-	1,089,627,192. 26	1,490,827,462.6 9
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	459,275,680.17	-	1,945,191,570. 02	2,404,467,250.1 9
(一)、综合收益总额	-	-	460,399,894.18	460,399,894.18
(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)	459,275,680.17	-	1,484,791,675. 84	1,944,067,356.0 1
其中：1. 基金申	709,805,257.05	-	2,279,849,840.	2,989,655,097.3

购款			27	2
2. 基金赎回款	-250,529,576.88	-	-795,058,164.43	-1,045,587,741.31
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	860,475,950.60	-	3,034,818,762.28	3,895,294,712.88

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

经雷

梁凯

李袁

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实美国成长股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监

会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让

2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	257,326,149.53
等于：本金	257,318,872.55
加：应计利息	7,276.98
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	257,326,149.53

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	3,582,554,028.65	-	4,614,677,255.99	1,032,123,227.34
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		6,044,189.88	-	6,898,937.11	854,747.23
其他		-	-	-	-
合计		3,588,598,218.53	-	4,621,576,193.10	1,032,977,974.57

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	359,599.28
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	83,310.68
合计	442,909.96

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,340,845,658.20	1,340,845,658.20
本期申购	166,017,606.49	166,017,606.49
本期赎回（以“-”号填列）	-594,526,608.63	-594,526,608.63
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	912,336,656.06	912,336,656.06

嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,166,527.16	25,662,110.19
本期申购	49,109.27	302,593.67

本期赎回（以“-”号填列）	-741,373.91	-4,566,589.95
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	3,474,262.52	21,398,113.91

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,257,564,391.08	4,016,594,783.27	5,274,159,174.35
本期期初	1,257,564,391.08	4,016,594,783.27	5,274,159,174.35
本期利润	68,061,989.96	-36,212,769.92	31,849,220.04
本期基金份额交易产生的变动数	-411,238,072.16	-1,135,880,783.83	-1,547,118,855.99
其中：基金申购款	157,061,579.70	484,150,592.35	641,212,172.05
基金赎回款	-568,299,651.86	-1,620,031,376.18	-2,188,331,028.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	914,388,308.88	2,844,501,229.52	3,758,889,538.40

嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	26,993,612.92	72,763,808.17	99,757,421.09
本期期初	26,993,612.92	72,763,808.17	99,757,421.09
本期利润	1,507,888.53	1,291,537.78	2,799,426.31
本期基金份额交易产生的变动数	-4,629,457.06	-10,778,689.18	-15,408,146.24
其中：基金申购款	319,688.09	856,040.31	1,175,728.40
基金赎回款	-4,949,145.15	-11,634,729.49	-16,583,874.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,872,044.39	63,276,656.77	87,148,701.16

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	329,117.47
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	17,241.65
合计	346,359.12

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	75,089,236.69
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	75,089,236.69

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	4,244,281,865.74
减：卖出股票成本总额	4,166,095,038.69
减：交易费用	3,097,590.36
买卖股票差价收入	75,089,236.69

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	13,516,321.59
减：卖出/赎回基金成本总额	14,093,727.60
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	12,295.04
减：交易费用	14,061.36
基金投资收益	-603,762.41

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

股票投资产生的股利收益	16,815,732.89
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	8,776.95
合计	16,824,509.84

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-34,921,232.14
股票投资	-34,067,555.02
债券投资	—
资产支持证券投资	—
基金投资	-853,677.12
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	-34,921,232.14

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	3,177,490.80
合计	3,177,490.80

6.4.7.23 信用减值损失

无。

6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	23,803.31
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行划款手续费	1,398.76
合计	84,709.44

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司（“嘉实基金”）	基金管理人
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6	2024 年 1 月 1 日至 2024 年

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	35,817,895.71	22,665,577.98
其中：应支付销售机构的客户维护费	14,083,592.82	8,333,201.46
应支付基金管理人的净管理费	21,734,302.89	14,332,376.52

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.80%/1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

2. 自 2025 年 1 月 28 日起，本基金管理费率由 1.80%调整为 1.20%。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	6,226,959.23	4,407,195.74

注：1. 支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.35%/0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

2. 自 2025 年 1 月 28 日起，本基金托管费率由 0.35%调整为 0.20%。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司_活期	257,326,149.53	329,117.47	272,228,370.38	140,778.08

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本期(2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日), 本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金主要投资于美国大盘成长型股票，属于主动投资的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金与混合型基金，为证券投资基金中的较高预期风险、较高预期收益的投资品种。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经

营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是主要投资于美国大盘成长型股票，在股票选择及组合构建等方面均运用量化投资方法并结合风险管理手段，力争获取长期资本增值。本基金的基金管理人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和风险管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允

价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	257,326,149.53	-	-	-	257,326,149.53
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	4,621,576,193.10	4,621,576,193.10
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	9,895,614.40	9,895,614.40
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	1,178,602.50	1,178,602.50
应收申购款	-	-	-	5,292,683.53	5,292,683.53
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	257,326,149.53	-	-	4,637,943,093.53	4,895,269,243.06
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	109,590,389.29	109,590,389.29

应付管理人报酬	-	-	-	4,682,515.10	4,682,515.10
应付托管费	-	-	-	780,419.18	780,419.18
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	442,909.96	442,909.96
负债总计	-	-	-	115,496,233.53	115,496,233.53
利率敏感度缺口	257,326,149.53	-	-	4,522,446,860.00	4,779,773,009.53
上年度末 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	412,180,456.24	-	-	-	412,180,456.24
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	6,385,300,181.99	6,385,300,181.99
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	1,077,773.30	1,077,773.30
应收申购款	-	-	-	55,354,353.78	55,354,353.78
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	412,180,456.24	-	-	6,441,732,309.07	6,853,912,765.31
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	28,563,029.05	28,563,029.05
应付赎回款	-	-	-	73,547,835.40	73,547,835.40
应付管理人报酬	-	-	-	9,102,578.87	9,102,578.87
应付托管费	-	-	-	1,769,945.90	1,769,945.90
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	77,710.84	77,710.84
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	427,301.42	427,301.42

负债总计	-	-	-	113,488,401.48	113,488,401.48
利率敏感度缺口	412,180,456.24	-	-	6,328,243,907.59	6,740,424,363.83

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-	-
	市场利率下降 25 个基点	-	-

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	197,301,990.85	-	-	197,301,990.85
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	4,621,576,193.10	-	-	4,621,576,193.10

衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	1,178,602.50	-	-	1,178,602.50
应收申购款	5,814.36	-	-	5,814.36
应收清算款	9,895,614.40	-	-	9,895,614.40
其他资产	-	-	-	-
资产合计	4,829,958,215.21	-	-	4,829,958,215.21
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
应付赎回款	7,056,404.83	-	-	7,056,404.83
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
其他负债	1,973.55	-	-	1,973.55
负债合计	7,058,378.38	-	-	7,058,378.38
资产负债表外汇风险敞口净额	4,822,899,836.83	-	-	4,822,899,836.83
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的				

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

资产负债表外 汇风险敞口净 额	6,524,999 ,507.73	-	-	6,524,999,507.73
-----------------------	----------------------	---	---	------------------

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变 动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	所有外币相对人民 币升值 5%	241,144,991.84	326,249,975.39
	所有外币相对人民 币贬值 5%	-241,144,991.84	-326,249,975.39

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	4,614,677,255.99	96.55	6,374,467,133.94	94.57
交易性金融资产—基金投资	6,898,937.11	0.14	10,833,048.05	0.16
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	4,621,576,193.10	96.69	6,385,300,181.99	94.73

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	241,088,248.69	365,208,335.66
	业绩比较基准下降 5%	-241,088,248.69	-365,208,335.66

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	4,621,576,193.10	6,385,300,181.99
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	4,621,576,193.10	6,385,300,181.99

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	4,614,677,255.99	94.27
	其中：普通股	4,510,183,736.53	92.13
	存托凭证	77,805,329.26	1.59
	优先股	—	—
	房地产信托凭证	26,688,190.20	0.55
2	基金投资	6,898,937.11	0.14
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	257,326,149.53	5.26

8	其他各项资产	16,366,900.43	0.33
9	合计	4,895,269,243.06	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
美国	4,614,677,255.99	96.55
合计	4,614,677,255.99	96.55

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
通信服务	769,144,273.23	16.09
非必需消费品	512,179,779.29	10.72
必需消费品	154,489,772.89	3.23
能源	44,354,583.23	0.93
金融	318,633,768.81	6.67
医疗保健	286,729,033.78	6.00
工业	294,050,349.10	6.15
信息技术	2,117,592,123.62	44.30
原材料	27,523,496.09	0.58
房地产	26,789,499.57	0.56
公用事业	63,190,576.38	1.32
合计	4,614,677,255.99	96.55

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 （英文）	公司名称 （中文）	证券代 码	所在证 券市场	所属 国家 （地区）	数量 （股）	公允价值	占基 金资 产净 值比 例（%）
1	NVIDIA Corp	英伟达	NVDA UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	431,103	487,571,980.92	10.20
2	Microsoft Corp	微软	MSFT UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	134,465	478,797,489.32	10.02
3	Apple Inc	苹果公 司	AAPL UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	252,160	370,354,947.22	7.75
4	Amazon.com Inc	亚马逊 公司	AMZN UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	199,179	312,815,649.57	6.54

5	Alphabet Inc	Alphabet 公司	GOOGL UW	纳斯达克证券交易所	美国	134,068	169,134,836.54	3.54
5	Alphabet Inc	Alphabet 公司	GOOG UW	纳斯达克证券交易所	美国	80,997	102,855,178.78	2.15
6	Meta Platforms Inc	Meta 平台股份有限公司	META UW	纳斯达克证券交易所	美国	49,362	260,813,558.79	5.46
7	Broadcom Inc	博通股份有限公司	AVGO UW	纳斯达克证券交易所	美国	101,859	200,995,114.38	4.21
8	Netflix Inc	奈飞公司	NFLX UW	纳斯达克证券交易所	美国	15,966	153,054,802.22	3.20
9	Tesla Inc	特斯拉公司	TSLA UW	纳斯达克证券交易所	美国	51,201	116,431,118.85	2.44
10	General Electric Co	通用电气航空航天	GE UN	纽约证券交易所	美国	56,787	104,633,003.49	2.19
11	Palantir Technologies Inc	Palantir 科技股份有限公司	PLTR UW	纳斯达克证券交易所	美国	80,959	79,004,678.24	1.65
12	Visa Inc	维萨公司	V UN	纽约证券交易所	美国	30,277	76,953,867.98	1.61
13	Costco Wholesale Corp	开市客	COST UW	纳斯达克证券交易所	美国	10,169	72,063,477.62	1.51
14	Mastercard Inc	万事达股份有限公司	MA UN	纽约证券交易所	美国	17,038	68,538,825.37	1.43
15	Eli Lilly & Co	礼来	LLY UN	纽约证券交易所	美国	11,950	66,685,104.32	1.40
16	Oracle Corp	甲骨文	ORCL UN	纽约证券交易所	美国	35,762	55,970,559.69	1.17
17	AppLovin Corp	AppLovin 公司	APP UW	纳斯达克证券交易所	美国	18,123	45,417,736.55	0.95

18	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	台湾集成电路制造股份有限公司	TSM UN	纽约证券交易所	美国	28,009	45,412,428.95	0.95
19	AbbVie Inc	艾伯维股份有限公司	ABBV UN	纽约证券交易所	美国	28,192	37,460,946.93	0.78
20	Lam Research Corp	泛林集团	LRCX UW	纳斯达克证券交易所	美国	49,919	34,784,463.93	0.73
21	Coca-Cola Co/The	可口可乐	KO UN	纽约证券交易所	美国	65,635	33,242,220.80	0.70
22	Uber Technologies Inc	优步技术股份有限公司	UBER UN	纽约证券交易所	美国	43,669	29,166,410.69	0.61
23	GE Vernova Inc	通用电气 Vernova 股份有限公司	GEV UN	纽约证券交易所	美国	7,063	26,754,454.64	0.56
24	KLA Corp	KLA 公司	KLAC UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,166	26,713,410.02	0.56
25	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM UW	纳斯达克证券交易所	美国	21,747	24,793,290.10	0.52
26	Progressive Corp/The	前进保险公司	PGR UN	纽约证券交易所	美国	12,455	23,793,334.47	0.50
27	McKesson Corp	McKesson 公司	MCK UN	纽约证券交易所	美国	4,336	22,745,263.75	0.48
28	Amgen Inc	安进公司	AMGN UW	纳斯达克证券交易所	美国	11,310	22,605,893.10	0.47
29	American Tower Corp	美国发射塔公司	AMT UN	纽约证券交易所	美国	13,765	21,778,897.27	0.46
30	VeriSign	威瑞信	VRSN UW	纳斯达克	美国	9,942	20,554,127.39	0.43

	Inc	股份有限公司		克证券交易所				
31	Spotify Technology SA	Spotify 科技股份有限公司	SPOT UN	纽约证券交易所	美国	3,730	20,489,188.86	0.43
32	NRG Energy Inc	NRG 能源股份有限公司	NRG UN	纽约证券交易所	美国	17,116	19,675,321.04	0.41
33	SAP SE	SAP 公司	SAP UN	纽约证券交易所	美国	7,870	17,132,441.15	0.36
34	Booking Holdings Inc	Booking 控股股份有限公司	BKNG UW	纳斯达克证券交易所	美国	401	16,618,584.24	0.35
35	Intuitive Surgical Inc	直觉外科手术公司	ISRG UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,087	15,898,654.07	0.33
36	Cardinal Health Inc	嘉德诺健康集团	CAH UN	纽约证券交易所	美国	13,144	15,807,563.25	0.33
37	Amphenol Corp	安费诺公司	APH UN	纽约证券交易所	美国	21,992	15,546,403.21	0.33
38	Fox Corp	福克斯公司	FOX UW	纳斯达克证券交易所	美国	26,605	9,833,168.57	0.21
38	Fox Corp	福克斯公司	FOXA UW	纳斯达克证券交易所	美国	13,407	5,378,458.63	0.11
39	Intuit Inc	Intuit 股份有限公司	INTU UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,697	15,206,570.93	0.32
40	Howmet Aerospace Inc	Howmet 航空航天股份有限公司	HWM UN	纽约证券交易所	美国	11,364	15,141,737.00	0.32
41	Salesforce Inc	Salesforce 股份有限公司	CRM UN	纽约证券交易所	美国	7,751	15,130,561.49	0.32

42	CrowdStrike Holdings Inc	CrowdStrike 控股股份有限公司	CRWD UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,850	14,036,894.28	0.29
43	Vistra Corp	Vistra 公司	VST UN	纽约证券交易所	美国	9,704	13,463,409.81	0.28
44	ServiceNow Inc	ServiceNow 公司	NOW UN	纽约证券交易所	美国	1,794	13,203,146.60	0.28
45	Goldman Sachs Group Inc/The	高盛	GS UN	纽约证券交易所	美国	2,439	12,357,191.43	0.26
46	Gilead Sciences Inc	吉利德科学	GILD UW	纳斯达克证券交易所	美国	15,375	12,202,737.47	0.26
47	DoorDash Inc	DoorDash 股份有限公司	DASH UW	纳斯达克证券交易所	美国	6,849	12,086,200.76	0.25
48	Applied Materials Inc	应用材料	AMAT UW	纳斯达克证券交易所	美国	9,156	11,999,166.00	0.25
49	Capital One Financial Corp	第一资本金融	COF UN	纽约证券交易所	美国	7,515	11,445,823.98	0.24
50	Philip Morris International Inc	菲利普莫里斯国际集团公司	PM UN	纽约证券交易所	美国	8,319	10,846,277.41	0.23
51	Virtu Financial Inc	Virtu 金融股份有限公司	VIRT UN	纽约证券交易所	美国	33,817	10,842,869.63	0.23
52	Cheniere Energy Inc	Cheniere 能源股份有限公司	LNG UN	纽约证券交易所	美国	6,165	10,747,211.91	0.22
53	Jabil Inc	捷普集团	JBL UN	纽约证券交易所	美国	6,864	10,716,699.09	0.22

54	Snowflake Inc	Snowflake 股份有限公司	SNOW UN	纽约证券交易所	美国	6,682	10,703,761.64	0.22
55	Ecolab Inc	艺康集团	ECL UN	纽约证券交易所	美国	5,527	10,660,550.47	0.22
56	Vertiv Holdings Co	维谛技术	VRT UN	纽约证券交易所	美国	11,439	10,515,138.61	0.22
57	AT&T Inc	美国电话电报公司	T UN	纽约证券交易所	美国	50,223	10,404,693.08	0.22
58	Advanced Micro Devices Inc	AMD 公司	AMD UW	纳斯达克证券交易所	美国	10,132	10,292,139.70	0.22
59	XP Inc	XP 股份有限公司	XP UW	纳斯达克证券交易所	美国	70,602	10,209,311.84	0.21
60	Veeva Systems Inc	Veeva Systems 股份有限公司	VEEV UN	纽约证券交易所	美国	4,817	9,930,407.49	0.21
61	Cencora Inc	Cencora 股份有限公司	COR UN	纽约证券交易所	美国	4,592	9,856,756.52	0.21
62	Axon Enterprise Inc	Axon Enterprise 股份有限公司	AXON UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,648	9,767,516.84	0.20
63	Berkshire Hathaway Inc	伯克希尔哈撒韦公司	BRK/B UN	纽约证券交易所	美国	2,736	9,514,257.02	0.20
64	Cloudflare Inc	Cloudflare 股份有限公司	NET UN	纽约证券交易所	美国	6,713	9,410,744.17	0.20
65	Sea Ltd	Sea 有限公司	SE UN	纽约证券交易所	美国	7,817	8,950,046.67	0.19

66	Waste Management Inc	废品管理	WM UN	纽约证券交易所	美国	5,188	8,498,104.06	0.18
67	Flex Ltd	伟创力国际有限公司	FLEX UW	纳斯达克证券交易所	美国	23,505	8,399,683.62	0.18
68	Cintas Corp	Cintas 公司	CTAS UW	纳斯达克证券交易所	美国	5,218	8,324,991.22	0.17
69	Dexcom Inc	Dexcom 股份有限公司	DXCM UW	纳斯达克证券交易所	美国	12,746	7,964,646.48	0.17
70	HCA Healthcare Inc	HCA 医疗保健有限公司	HCA UN	纽约证券交易所	美国	2,895	7,939,420.72	0.17
71	Wells Fargo & Co	富国银行	WFC UN	纽约证券交易所	美国	13,729	7,874,227.20	0.16
72	Cisco Systems Inc	思科	CSCO UW	纳斯达克证券交易所	美国	15,631	7,763,349.79	0.16
73	Bank of America Corp	美国银行公司	BAC UN	纽约证券交易所	美国	22,419	7,594,323.08	0.16
74	Axis Capital Holdings Ltd	阿克西斯资本控股有限公司	AXS UN	纽约证券交易所	美国	10,217	7,593,334.19	0.16
75	Verisk Analytics Inc	Verisk 分析公司	VRSK UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,393	7,566,063.93	0.16
76	UGI Corp	UGI 公司	UGI UN	纽约证券交易所	美国	27,293	7,115,727.57	0.15
77	International Business Machines Corp	国际商业机器公司	IBM UN	纽约证券交易所	美国	3,289	6,940,487.62	0.15
78	Arista Networks Inc	Arista 网络股份有限公司	ANET UN	纽约证券交易所	美国	9,321	6,826,666.53	0.14

79	Automatic Data Processing Inc	Automatic Data Processing 股份有限公司	ADP UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,083	6,806,376.84	0.14
80	Palo Alto Networks Inc	Palo Alto Networks 股份有限公司	PANW UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,615	6,760,679.20	0.14
81	Exelixis Inc	Exelixis 股份有限公司	EXEL UW	纳斯达克证券交易所	美国	20,801	6,563,033.69	0.14
82	Carpenter Technology Corp	卡朋特科技公司	CRS UN	纽约证券交易所	美国	3,273	6,475,610.43	0.14
83	Abbott Laboratories	雅培制药	ABT UN	纽约证券交易所	美国	6,633	6,458,161.99	0.14
84	CVS Health Corp	CVS 健康公司	CVS UN	纽约证券交易所	美国	12,949	6,394,219.15	0.13
85	Sterling Infrastructure Inc	Sterling 基础设施股份有限公司	STRL UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,804	6,283,081.17	0.13
86	HEICO Corp	海科航空公司	HEI/A UN	纽约证券交易所	美国	2,809	5,203,076.29	0.11
86	HEICO Corp	海科航空公司	HEI UN	纽约证券交易所	美国	449	1,054,261.34	0.02
87	Monster Beverage Corp	怪兽饮料公司	MNST UW	纳斯达克证券交易所	美国	13,728	6,155,837.06	0.13
88	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公司	TCEHY UV	纽约证券交易所	美国	13,175	6,083,288.80	0.13
89	IDEXX Laborator	爱德士股份有	IDXX UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,539	5,908,903.58	0.12

	ies Inc	限公司		交易所				
90	Altria Group Inc	高特利	MO UN	纽约证 券交易 所	美国	13,910	5,838,148.27	0.12
91	Trane Technologies PLC	特灵科技公共 有限公司	TT UN	纽约证 券交易 所	美国	1,860	5,824,112.40	0.12
92	ROBLOX Corp	Roblox 公司	RBLX UN	纽约证 券交易 所	美国	7,644	5,756,579.60	0.12
93	Adtalem Global Education Inc	Adtalem 环球 教育股份有 限公司	ATGE UN	纽约证 券交易 所	美国	6,208	5,654,176.11	0.12
94	Stryker Corp	史赛克	SYK UN	纽约证 券交易 所	美国	1,996	5,652,985.21	0.12
95	Kroger Co/The	克罗格公司	KR UN	纽约证 券交易 所	美国	10,454	5,367,986.60	0.11
96	Antero Midstream Corp	Antero 中游公 司	AM UN	纽约证 券交易 所	美国	39,555	5,365,852.12	0.11
97	Enova International Inc	Enova Internat ional 公司	ENVA UN	纽约证 券交易 所	美国	6,679	5,332,026.51	0.11
98	Juniper Networks Inc	瞻博网络股份 有限公司	JNPR UN	纽约证 券交易 所	美国	18,345	5,243,787.96	0.11
99	Williams Cos Inc/The	威廉姆斯公司	WMB UN	纽约证 券交易 所	美国	11,646	5,236,410.38	0.11
100	F5 Inc	F5 股份有 限公司	FFIV UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,365	4,982,863.79	0.10
101	FARO Technologies Inc	FARO 科技股份 有限公司	FARO UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	15,718	4,941,828.98	0.10
10	Welltower	Wellto	WELL UN	纽约证	美国	4,461	4,909,292.93	0.10

2	Inc	wer 股份 有限公司		券交易 所				
10 3	JPMorgan Chase & Co	摩根大 通	JPM UN	纽约证 券交易 所	美国	2,350	4,877,071.86	0.10
10 4	InterDigi tal Inc	InterD igital 股份有 限公司	IDCC UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,032	4,866,884.17	0.10
10 5	RTX Corp	RTX 公 司	RTX UN	纽约证 券交易 所	美国	4,416	4,616,039.38	0.10
10 6	Boston Scientifi c Corp	波士顿 科学	BSX UN	纽约证 券交易 所	美国	5,985	4,601,897.78	0.10
10 7	National Fuel Gas Co	国家燃 气公司	NFG UN	纽约证 券交易 所	美国	7,437	4,509,834.03	0.09
10 8	EQT Corp	EQT 公 司	EQT UN	纽约证 券交易 所	美国	10,778	4,499,702.39	0.09
10 9	Zscaler Inc	Zscale r 股份 有限公司	ZS UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,992	4,476,762.80	0.09
11 0	Charles Schwab Corp/The	嘉信理 财	SCHW UN	纽约证 券交易 所	美国	6,619	4,323,204.25	0.09
11 1	Royal Caribbean Cruises Ltd	皇家加 勒比国 际游轮 有限公司	RCL UN	纽约证 券交易 所	美国	1,918	4,299,473.20	0.09
11 2	Excele rate Energy Inc	Excele rate 能 源股份 有限公司	EE UN	纽约证 券交易 所	美国	20,384	4,278,400.86	0.09
11 3	Constella tion Energy Corp	美国联 合能源 公司	CEG UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,847	4,267,511.48	0.09
11	Equitable	Equita	EQH UN	纽约证	美国	10,605	4,258,941.06	0.09

4	Holdings Inc	ble 控股股份有限公司		券交易所				
115	Kinder Morgan Inc	特拉华州金德摩根公司	KMI UN	纽约证券交易所	美国	19,391	4,081,084.93	0.09
116	Moody's Corp	穆迪	MCO UN	纽约证券交易所	美国	1,095	3,931,796.98	0.08
117	Hess Corp	赫斯公司	HES UN	纽约证券交易所	美国	3,957	3,924,364.42	0.08
118	Entergy Corp	Entergy 公司	ETR UN	纽约证券交易所	美国	6,595	3,924,175.58	0.08
119	ExlService Holdings Inc	ExlService 控股公司	EXLS UW	纳斯达克证券交易所	美国	12,438	3,899,003.22	0.08
120	Coupan Inc	Coupan g 股份有限公司	CPNG UN	纽约证券交易所	美国	18,175	3,898,022.35	0.08
121	Chefs' Warehouse Inc/The	Chefs' Warehouse 股份有限公司	CHEF UW	纳斯达克证券交易所	美国	8,528	3,895,507.39	0.08
122	Western Digital Corp	西部数据公司	WDC UW	纳斯达克证券交易所	美国	8,434	3,863,436.72	0.08
123	Crown Holdings Inc	Crown 控股股份有限公司	CCK UN	纽约证券交易所	美国	5,218	3,846,671.13	0.08
124	Tapestry Inc	TPR-DR S-RS	TPR UN	纽约证券交易所	美国	6,015	3,781,008.95	0.08
125	Home Depot Inc/The	家得宝	HD UN	纽约证券交易所	美国	1,426	3,742,721.10	0.08
12	Grand	Grand	LOPE UW	纳斯达克	美国	2,662	3,601,620.51	0.08

6	Canyon Education Inc	Canyon 教育股份有限公司		克证券交易所				
127	Insulet Corp	Insulet 股份有限公司	PODD UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,566	3,522,073.29	0.07
128	Coca-Cola Europacific Partners PLC	可口可乐欧洲合伙公开股份公司	CCEP UW	纳斯达克证券交易所	美国	5,083	3,373,817.83	0.07
129	Cigna Group/The	信诺集团	CI UN	纽约证券交易所	美国	1,388	3,284,688.10	0.07
130	Newmont Corp	纽蒙黄金公司	NEM UN	纽约证券交易所	美国	7,695	3,209,276.98	0.07
131	Texas Instruments Inc	德州仪器	TXN UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,143	3,185,073.46	0.07
132	Comfort Systems USA Inc	美国舒适系统公司	FIX UN	纽约证券交易所	美国	822	3,155,257.61	0.07
133	TJX Cos Inc/The	TJX 公司	TJX UN	纽约证券交易所	美国	3,561	3,147,979.25	0.07
134	Hartford Insurance Group Inc/The	哈特福德保险集团股份有限公司	HIG UN	纽约证券交易所	美国	3,395	3,083,378.32	0.06
135	WEC Energy Group Inc	WEC 能源集团股份有限公司	WEC UN	纽约证券交易所	美国	4,045	3,017,271.16	0.06
136	Ralph Lauren Corp	拉夫劳伦	RL UN	纽约证券交易所	美国	1,527	2,998,204.65	0.06
137	Travelers Cos Inc/The	旅行家集团	TRV UN	纽约证券交易所	美国	1,555	2,978,154.42	0.06
13	Pitney	Pitney	PBI UN	纽约证	美国	38,041	2,971,014.50	0.06

8	Bowes Inc	Bowes 公司		券交易 所				
13 9	Darden Restauran ts Inc	达登餐 饮公司	DRI UN	纽约证 券交易 所	美国	1,898	2,961,563.36	0.06
14 0	American Express Co	美国运 通	AXP UN	纽约证 券交易 所	美国	1,267	2,893,131.44	0.06
14 1	MasTec Inc	MasTec 股份有 限公司	MTZ UN	纽约证 券交易 所	美国	2,363	2,882,954.99	0.06
14 2	Blackston e Inc	黑石集 团股份 有限公司	BX UN	纽约证 券交易 所	美国	2,665	2,853,637.73	0.06
14 3	eBay Inc	eBay 股 份有限 公司	EBAY UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	5,137	2,738,171.80	0.06
14 4	Rollins Inc	Rollin s 公司	ROL UN	纽约证 券交易 所	美国	6,774	2,735,938.75	0.06
14 5	Banco Latinoame ricano de Comercio Exterior SA	拉美出 口银行	BLX UN	纽约证 券交易 所	美国	9,410	2,714,705.77	0.06
14 6	Hasbro Inc	孩之宝	HAS UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,993	2,638,540.13	0.06
14 7	SoFi Technolog ies Inc	SoFi Techno logies 股份有 限公司	SOFI UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	20,190	2,631,930.16	0.06
14 8	Analog Devices Inc	亚德诺 半导体	ADI UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,544	2,630,806.12	0.06
14 9	Alnylam Pharmaceu ticals Inc	艾拉伦 制药股 份有限 公司	ALNY UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,125	2,626,141.36	0.05
15 0	Quanta Services	Quanta 服务股	PWR UN	纽约证 券交易	美国	969	2,622,621.26	0.05

	Inc	份有限 公司		所				
15 1	Crane Co	Crane Co	CR UN	纽约证 券交易 所	美国	1,915	2,603,148.65	0.05
15 2	TKO Group Holdings Inc	TKO 集 团控股 股份有 限公司	TKO UN	纽约证 券交易 所	美国	1,991	2,593,291.97	0.05
15 3	Autodesk Inc	欧特克	ADSK UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,166	2,583,958.38	0.05
15 4	Paycom Software Inc	Paycom 软件股 份有限 公司	PAYC UN	纽约证 券交易 所	美国	1,537	2,546,040.56	0.05
15 5	Celestica Inc	天弘股 份有限 公司	CLS UN	纽约证 券交易 所	美国	2,256	2,521,145.53	0.05
15 6	Dollar Tree Inc	美元树 公司	DLTR UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,436	2,436,081.89	0.05
15 7	Shopify Inc	Shopif y 股份 有限公 司	SHOP UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,923	2,413,651.20	0.05
15 8	Encompass Health Corp	南方保 健公司	EHC UN	纽约证 券交易 所	美国	2,747	2,411,479.00	0.05
15 9	DaVita Inc	DaVita 股份有 限公司	DVA UN	纽约证 券交易 所	美国	2,344	2,390,276.58	0.05
16 0	Brown & Brown Inc	Brown & Brown 股份有 限公司	BRO UN	纽约证 券交易 所	美国	2,922	2,319,115.38	0.05
16 1	Microchip Technolog y Inc	微芯科 技股份 有限公 司	MCHP UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,520	2,276,953.08	0.05
16 2	Sprouts Farmers Market Inc	Sprout s Farmer s	SFM UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,890	2,227,538.70	0.05

		Market 股份有 限公司						
16 3	NiSource Inc	NiSour ce 公 司	NI UN	纽约证 券交易 所	美国	7,682	2,218,392.01	0.05
16 4	OGE Energy Corp	OGE 能 源公司	OGE UN	纽约证 券交易 所	美国	6,801	2,160,668.64	0.05
16 5	Marathon Petroleum Corp	马拉松 石油公 司	MPC UN	纽约证 券交易 所	美国	1,817	2,160,622.04	0.05
16 6	Liberty Broadband Corp	Libert y 宽带 有限公司	LBRDK UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,030	2,133,917.10	0.04
16 7	Grindr Inc	Grindr 股份有 限公司	GRND UN	纽约证 券交易 所	美国	12,338	2,004,927.71	0.04
16 8	Tradeweb Markets Inc	Tradew eb Market s 股份 有限公司	TW UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,855	1,944,075.32	0.04
16 9	Dynatrace Inc	Dynatr ace 股 份有限 公司	DT UN	纽约证 券交易 所	美国	4,790	1,893,134.01	0.04
17 0	Bank of New York Mellon Corp/The	纽约梅 隆银行	BK UN	纽约证 券交易 所	美国	2,834	1,848,391.61	0.04
17 1	Nasdaq Inc	纳斯达 克股份 有限公司	NDAQ UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,884	1,846,111.88	0.04
17 2	Cal-Maine Foods Inc	Cal-Ma ine 食 品股份 有限公司	CALM UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,543	1,813,696.38	0.04
17 3	Broadridg e Financial	布罗德 里奇金 融解决	BR UN	纽约证 券交易 所	美国	1,026	1,784,988.18	0.04

	Solutions Inc	方案股份有限公司						
174	Liberty Media Corp-Liberty Formula One	Liberty 传媒公司-Liberty 一级方程式	FWONK UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,183	884,971.19	0.02
174	Liberty Media Corp-Liberty Formula One	Liberty 传媒公司-Liberty 一级方程式	FWONA UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,293	878,956.39	0.02
175	DT Midstream Inc	DT Midstream Inc	DTM UN	纽约证券交易所	美国	2,207	1,736,471.41	0.04
176	Ameriprise Financial Inc	阿默普莱斯金融公司	AMP UN	纽约证券交易所	美国	437	1,669,671.94	0.03
177	Citizens Financial Group Inc	公民金融集团股份有限公司	CFG UN	纽约证券交易所	美国	5,091	1,630,888.36	0.03
178	LifeMD Inc	LifeMD 股份有限公司	LFMD UQ	纳斯达克证券交易所	美国	15,796	1,540,112.09	0.03
179	Dell Technologies Inc	戴尔科技公司	DELL UN	纽约证券交易所	美国	1,740	1,527,101.19	0.03
180	Monolithic Power Systems Inc	芯源系统有限公司	MPWR UW	纳斯达克证券交易所	美国	288	1,507,869.18	0.03
181	Allstate Corp/The	好事达保险公司	ALL UN	纽约证券交易所	美国	1,040	1,498,741.68	0.03
182	Sealed Air Corp	希悦尔公司	SEE UN	纽约证券交易所	美国	6,588	1,463,401.39	0.03
183	Elastic NV	Elastic 公共有限责	ESTC UN	纽约证券交易所	美国	2,391	1,443,410.21	0.03

		任公司						
18 4	NIKE Inc	耐克公司	NKE UN	纽约证 券交易 所	美国	2,816	1,432,068.19	0.03
18 5	Hilton Worldwide Holdings Inc	希尔顿 全球控 股股份 有限公司	HLT UN	纽约证 券交易 所	美国	749	1,428,059.52	0.03
18 6	Sezzle Inc	Sezzle 股份有 限公司	SEZL UR	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,112	1,426,895.10	0.03
18 7	O'Reilly Automotiv e Inc	O'Reil ly 汽车 股份有 限公司	ORLY UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,189	1,412,352.91	0.03
18 8	CoreCivic Inc	CoreCi vic 股 份有限 公司	CXW UN	纽约证 券交易 所	美国	9,250	1,395,193.24	0.03
18 9	Maplebear Inc	Mapleb ear Inc	CART UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,299	1,392,252.92	0.03
19 0	GE HealthCar e Technolo gies Inc	GE Health Care Techno logies Inc	GEHC UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,594	1,375,436.08	0.03
19 1	Super Group SGHC Ltd	Super Group (SGHC) 有限 公司	SGHC UN	纽约证 券交易 所	美国	16,957	1,331,630.53	0.03
19 2	Morgan Stanley	摩根士 丹利	MS UN	纽约证 券交易 所	美国	1,268	1,278,600.98	0.03
19 3	Talen Energy Corp	Talen 能源公 司	TLN UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	614	1,278,044.76	0.03
19 4	Qorvo Inc	Qorvo 股份有 限公司	QRVO UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,010	1,221,751.82	0.03
19	Universal	Univer	UVE UN	纽约证	美国	6,072	1,205,340.44	0.03

5	Insurance Holdings Inc	sal 保险控股有限公司		券交易所				
196	Twilio Inc	Twilio 股份有限公司	TWLO UN	纽约证券交易所	美国	1,337	1,190,255.55	0.02
197	Walt Disney Co/The	华特迪士尼公司	DIS UN	纽约证券交易所	美国	1,322	1,173,589.62	0.02
198	Credo Technology Group Holding Ltd	Credo 科技集团控股有限公司	CRDO UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,742	1,154,623.34	0.02
199	Palomar Holdings Inc	Palomar 控股股份有限公司	PLMR UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,036	1,143,965.76	0.02
200	Seagate Technology Holdings PLC	Seagate Technology 控股公共有限公司	STX UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,094	1,130,321.61	0.02
201	Marvell Technology Inc	美满电子科技公司	MRVL UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,009	1,113,137.96	0.02
202	Carvana Co	Carvana 公司	CVNA UN	纽约证券交易所	美国	445	1,073,412.03	0.02
203	Pinterest Inc	Pinterest 股份有限公司	PINS UN	纽约证券交易所	美国	4,076	1,046,339.35	0.02
204	Armstrong World Industries Inc	阿姆斯壮世界工业有限公司	AWI UN	纽约证券交易所	美国	894	1,039,581.63	0.02
205	NU Holdings Ltd/Cayman Islands	NU 控股有限公司/开曼群岛	NU UN	纽约证券交易所	美国	10,443	1,025,669.60	0.02
20	Fair	费埃哲	FICO UN	纽约证	美国	78	1,020,679.49	0.02

6	Isaac Corp	公司		券交易所				
207	Celanese Corp	塞拉尼斯公司	CE UN	纽约证券交易所	美国	2,565	1,015,958.89	0.02
208	Markel Group Inc	Markel 集团股份有限公司	MKL UN	纽约证券交易所	美国	70	1,000,881.09	0.02
209	Southern Co/The	南方公司	SO UN	纽约证券交易所	美国	1,520	999,208.84	0.02
210	Ingredion Inc	宜瑞安公司	INGR UN	纽约证券交易所	美国	1,020	990,266.32	0.02
211	Duolingo Inc	多邻国	DUOL UW	纳斯达克证券交易所	美国	336	986,216.84	0.02
212	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	BJ's 批发俱乐部控股有限公司	BJ UN	纽约证券交易所	美国	1,266	977,240.39	0.02
213	Nexstar Media Group Inc	Nexstar 媒体集团股份有限公司	NXST UW	纳斯达克证券交易所	美国	775	959,511.90	0.02
214	Live Nation Entertainment Inc	Live Nation 娱乐公司	LYV UN	纽约证券交易所	美国	880	952,998.65	0.02
215	Charter Communications Inc	Charter 通信公司	CHTR UW	纳斯达克证券交易所	美国	323	945,261.85	0.02
216	ResMed Inc	瑞思迈股份有限公司	RMD UN	纽约证券交易所	美国	511	943,775.51	0.02
217	Zebra Technologies Corp	斑马技术公司	ZBRA UW	纳斯达克证券交易所	美国	425	938,156.01	0.02
218	Paychex Inc	Paychex 公司	PAYX UW	纳斯达克证券交易所	美国	891	927,789.35	0.02

21 9	Unum Group	尤纳姆 集团	UNM UN	纽约证 券交易 所	美国	1,603	926,740.04	0.02
22 0	PNC Financial Services Group Inc/The	PNC 财 务服务	PNC UN	纽约证 券交易 所	美国	675	900,791.69	0.02
22 1	Verizon Communica tions Inc	Verizo n 通信 股份有 限公司	VZ UN	纽约证 券交易 所	美国	2,886	893,946.07	0.02
22 2	Ubiquiti Inc	Ubiqui ti 股份 有限公 司	UI UN	纽约证 券交易 所	美国	303	892,891.82	0.02
22 3	Manulife Financial Corp	宏利金 融	MFC UN	纽约证 券交易 所	美国	3,735	854,526.38	0.02
22 4	SS&C Technolog ies Holdings Inc	SS&C 科 技控股 公司	SSNC UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,441	854,126.93	0.02
22 5	Johnson Controls Internati onal plc	江森自 控国际 有限公司	JCI UN	纽约证 券交易 所	美国	1,119	846,066.20	0.02
22 6	ESCO Technolog ies Inc	ESCO 科技公 司	ESE UN	纽约证 券交易 所	美国	610	837,847.56	0.02
22 7	Mueller Industrie s Inc	美乐工 业有限 公司	MLI UN	纽约证 券交易 所	美国	1,469	835,705.20	0.02
22 8	Regions Financial Corp	Region s 金融 公司	RF UN	纽约证 券交易 所	美国	4,930	830,065.44	0.02
22 9	Corning Inc	康宁公 司	GLW UN	纽约证 券交易 所	美国	2,194	825,976.88	0.02
23 0	EMCOR Group Inc	埃姆科 集团公 司	EME UN	纽约证 券交易 所	美国	207	792,616.16	0.02
23	Five	Five	FIVE UW	纳斯达	美国	844	792,570.98	0.02

1	Below Inc	Below 股份有限公司		克 证 券 交 易 所				
23 2	US Foods Holding Corp	美国食品控股公司	USFD UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,426	786,130.68	0.02
23 3	Archrock Inc	Archrock 有限公司	AROC UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	4,397	781,558.12	0.02
23 4	Stride Inc	Stride 股份有限公司	LRN UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	737	766,006.21	0.02
23 5	Honeywell International Inc	霍尼韦尔	HON UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	459	765,196.50	0.02
23 6	Amer Sports Inc	Amer Sports Inc	AS UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,705	750,549.14	0.02
23 7	elf Beauty Inc	elf Beauty 股份有限公司	ELF UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	830	739,377.43	0.02
23 8	Airbnb Inc	爱彼迎股份有限公司	ABNB UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	777	736,105.81	0.02
23 9	Elanco Animal Health Inc	Elanco 动物健康股份有限公司	ELAN UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	7,021	717,720.38	0.02
24 0	Caterpillar Inc	卡特彼勒	CAT UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	253	703,097.15	0.01
24 1	Corebridge Financial Inc	Corebridge Financial Inc	CRBG UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,766	702,924.41	0.01
24 2	Sysco Corp	Sysco 公司	SYN UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,285	696,717.19	0.01
24 3	Fortinet Inc	Fortinet 股份有限公司	FTNT UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	917	693,992.20	0.01

24 4	Barrett Business Services Inc	Barret t Busine ss Servic es 股份 有限公 司	BBSI UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,277	679,552.51	0.01
24 5	Colgate-P almolive Co	高露洁 棕榄	CL UN	纽约证 券交易 所	美国	1,022	665,032.51	0.01
24 6	State Street Corp	道富集 团	STT UN	纽约证 券交易 所	美国	868	660,761.11	0.01
24 7	Planet Fitness Inc	Planet Fitnes s 股份 有限公 司	PLNT UN	纽约证 券交易 所	美国	846	660,425.95	0.01
24 8	Freeport- McMoRan Inc	自由港 迈克墨 伦股份 有限公 司	FCX UN	纽约证 券交易 所	美国	2,090	648,579.90	0.01
24 9	Cargurus Inc	Cargur us 股份 有限公 司	CARG UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,680	642,123.56	0.01
25 0	Westingho use Air Brake Technolog ies Corp	西屋制 动公司	WAB UN	纽约证 券交易 所	美国	416	623,439.61	0.01
25 1	Super Micro Computer Inc	Super Micro Comput er 股份 有限公 司	SMCI UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,695	594,678.86	0.01
25 2	Dutch Bros Inc	Dutch Bros Inc	BROS UN	纽约证 券交易 所	美国	1,197	585,851.88	0.01
25 3	Citigroup Inc	花旗集 团	C UN	纽约证 券交易 所	美国	932	567,904.91	0.01

254	Tetra Tech Inc	Tetra 科技股份有限公司	TTEK UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,150	553,460.00	0.01
255	Expeditors International of Washington Inc	华盛顿康捷国际物流公司	EXPD UN	纽约证券交易所	美国	669	547,155.06	0.01
256	Trimble Inc	天宝股份有限公司	TRMB UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,003	545,542.16	0.01
257	BWX Technologies Inc	BWX 科技公司	BWXT UN	纽约证券交易所	美国	522	538,321.85	0.01
258	S&P Global Inc	标普全球	SPGI UN	纽约证券交易所	美国	142	536,001.46	0.01
259	Rockwell Automation Inc	罗克韦尔自动化	ROK UN	纽约证券交易所	美国	223	530,265.49	0.01
260	Datadog Inc	Datadog 股份有限公司	DDOG UW	纳斯达克证券交易所	美国	541	520,233.57	0.01
261	Micron Technology Inc	美光科技股份有限公司	MU UW	纳斯达克证券交易所	美国	589	519,673.20	0.01
262	Terex Corp	特雷克斯公司	TEX UN	纽约证券交易所	美国	1,552	518,732.77	0.01
263	Ionis Pharmaceuticals Inc	Ionis 制药股份有限公司	IONS UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,829	517,307.57	0.01
264	SkyWest Inc	SkyWest 股份有限公司	SKYW UW	纳斯达克证券交易所	美国	692	510,087.76	0.01
265	Teradyne Inc	泰瑞达	TER UW	纳斯达克证券交易所	美国	792	509,811.44	0.01

266	Illinois Tool Works Inc	伊利诺伊工具股份有限公司	ITW UN	纽约证券交易所	美国	284	502,669.73	0.01
267	MongoDB Inc	MongoDB 股份有限公司	MDB UQ	纳斯达克证券交易所	美国	334	502,080.29	0.01
268	Roku Inc	Roku 股份有限公司	ROKU UW	纳斯达克证券交易所	美国	797	501,447.98	0.01
269	Mr Cooper Group Inc	Mr Cooper 集团股份有限公司	COOP UR	纳斯达克证券交易所	美国	467	498,818.91	0.01
270	Popular Inc	Popular 股份有限公司	BPOP UW	纳斯达克证券交易所	美国	623	491,515.42	0.01
271	TopBuild Corp	TopBuild 公司	BLD UN	纽约证券交易所	美国	207	479,727.71	0.01
272	Iridium Communications Inc	Iridium 通信股份有限公司	IRDM UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,216	478,600.52	0.01
273	AutoZone Inc	AutoZone 股份有限公司	AZO UN	纽约证券交易所	美国	18	478,338.65	0.01
274	Hancock Whitney Corp	Hancock Whitney 公司	HWC UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,148	471,717.38	0.01
275	Brinker International Inc	Brinker 国际股份有限公司	EAT UN	纽约证券交易所	美国	364	469,891.36	0.01
276	Lockheed Martin Corp	洛克希德马丁	LMT UN	纽约证券交易所	美国	141	467,476.19	0.01
277	Universal Display Corp	美国通用显示器公司	OLED UW	纳斯达克证券交易所	美国	414	457,766.99	0.01

278	Charles River Laboratories International Inc	查理斯河实验室国际有限公司	CRL UN	纽约证券交易所	美国	408	443,159.15	0.01
279	Matador Resources Co	Matador 资源公司	MTDR UN	纽约证券交易所	美国	1,290	440,674.83	0.01
280	Nutanix Inc	Nutanix 股份有限公司	NTNX UW	纳斯达克证券交易所	美国	800	437,762.71	0.01
281	TransDigm Group Inc	TransDigm 集团公司	TDG UN	纽约证券交易所	美国	40	435,426.14	0.01
282	Intel Corp	英特尔	INTC UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,627	421,246.39	0.01
283	Synchrony Financial	同步金融公司	SYF UN	纽约证券交易所	美国	857	409,444.57	0.01
284	Devon Energy Corp	戴文能源	DVN UN	纽约证券交易所	美国	1,766	402,144.81	0.01
285	Zoetis Inc	硕腾股份有限公司	ZTS UN	纽约证券交易所	美国	359	400,781.74	0.01
286	Quest Diagnostics Inc	Quest Diagnostics 股份有限公司	DGX UN	纽约证券交易所	美国	293	376,768.50	0.01
287	Ensign Group Inc/The	Ensign 集团股份有限公司	ENSG UW	纳斯达克证券交易所	美国	337	372,144.26	0.01
288	First Horizon Corp	第一线国民银行	FHN UN	纽约证券交易所	美国	2,379	361,042.56	0.01
289	AeroVironment Inc	AeroVironment 股份有限公司	AVAV UW	纳斯达克证券交易所	美国	172	350,853.01	0.01

290	Edwards Lifesciences Corp	爱德华生命科学公司	EW UN	纽约证券交易所	美国	602	337,044.21	0.01
291	Wintrust Financial Corp	Wintrust 金融公司	WTFC UW	纳斯达克证券交易所	美国	376	333,708.73	0.01
292	First Financial Bankshares Inc	第一金融银行股份有限公司	FFIN UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,251	322,215.60	0.01
293	Pentair PLC	Pentair 公共有限公司	PNR UN	纽约证券交易所	美国	425	312,333.30	0.01
294	Deere & Co	迪尔	DE UN	纽约证券交易所	美国	79	287,566.04	0.01
295	Estee Lauder Cos Inc/The	雅诗兰黛	EL UN	纽约证券交易所	美国	480	277,639.14	0.01
296	Robinhood Markets Inc	罗宾汉市场股份公司	HOOD UW	纳斯达克证券交易所	美国	398	266,763.37	0.01
297	Avis Budget Group Inc	安飞士百捷乐集团股份有限公司	CAR UW	纳斯达克证券交易所	美国	220	266,235.49	0.01
298	Pegasystems Inc	Pegasy stems 股份有限公司	PEGA UW	纳斯达克证券交易所	美国	666	258,071.68	0.01
299	Atmos Energy Corp	Atmos 能源公司	ATO UN	纽约证券交易所	美国	228	251,532.30	0.01
300	Take-Two Interactive Software Inc	Take-Two 互动软件股份有限公司	TTWO UW	纳斯达克证券交易所	美国	140	243,385.24	0.01
301	Intercontinental Exchange Inc	洲际交易所（ICE）	ICE UN	纽约证券交易所	美国	182	239,036.68	0.01

302	Celsius Holdings Inc	Celsius 控股股份有限公司	CELH UN	纳斯达克证券交易所	美国	719	238,770.88	0.00
303	Boeing Co/The	波音	BA UN	纽约证券交易所	美国	158	236,990.75	0.00
304	Ferguson Enterprises Inc	Ferguson Enterprises Inc	FERG UN	纽约证券交易所	美国	150	233,817.77	0.00
305	Blackrock Inc	贝莱德股份有限公司	BLK UN	纽约证券交易所	美国	31	232,845.99	0.00
306	Wingstop Inc	Wingstop 股份有限公司	WING UW	纳斯达克证券交易所	美国	96	231,416.35	0.00
307	East West Bancorp Inc	华美银行集团公司	EWBC UW	纳斯达克证券交易所	美国	315	227,705.76	0.00
308	Guidewire Software Inc	Guidewire 软件公司	GWRE UN	纽约证券交易所	美国	131	220,799.50	0.00
309	Astera Labs Inc	Astera Labs Inc	ALAB UW	纳斯达克证券交易所	美国	337	218,133.57	0.00
310	Generac Holdings Inc	Generac 控股公司	GNRC UN	纽约证券交易所	美国	211	216,313.64	0.00
311	MKS Inc	MKS 股份有限公司	MKSI UW	纳斯达克证券交易所	美国	301	214,094.83	0.00
312	Merck & Co Inc	默克	MRK UN	纽约证券交易所	美国	374	211,936.37	0.00
313	Intapp Inc	Intapp 股份有限公司	INTA UW	纳斯达克证券交易所	美国	571	210,999.88	0.00
314	Merit Medical Systems Inc	Merit 医疗系统股份有限公司	MMSI UW	纳斯达克证券交易所	美国	308	206,109.27	0.00

		司						
31 5	Northern Trust Corp	北美信 托	NTRS UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	226	205,126.39	0.00
31 6	StepStone Group Inc	StepSt one 集 团股份 有限公 司	STEP UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	512	203,418.78	0.00
31 7	Fastenal Co	法思诺 公司	FAST UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	672	202,044.33	0.00
31 8	Diamondba ck Energy Inc	Diamon dback 能源股 份有限 公司	FANG UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	202	198,685.51	0.00
31 9	Renaissan ceRe Holdings Ltd	复兴再 保险控 股公司	RNR UN	纽约证 券交易 所	美国	113	196,487.11	0.00
32 0	Toast Inc	Toast 股份有 限公司	TOST UN	纽约证 券交易 所	美国	614	194,671.40	0.00
32 1	SharkNinj a Inc	SharkN inja Inc	SN UN	纽约证 券交易 所	美国	266	188,495.53	0.00
32 2	Zions Bancorp NA	锡安银 行	ZION UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	505	187,767.93	0.00
32 3	ARM Holdings PLC	ARM Holdin gs PLC	ARM UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	159	184,095.28	0.00
32 4	Enstar Group Ltd	Enstar 集团有 限公司	ESGR UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	76	182,997.87	0.00
32 5	ONEOK Inc	Oneok 股份有 限公司	OKE UN	纽约证 券交易 所	美国	309	180,566.16	0.00
32 6	Teledyne Technolog ies Inc	Teledy ne 科技 股份有 限公司	TDY UN	纽约证 券交易 所	美国	47	172,368.85	0.00
32	Casey's	凯西杂	CASY UW	纳斯达	美国	47	171,682.48	0.00

7	General Stores Inc	货公司		克证券交易所				
328	Korn Ferry	光辉国际	KFY UN	纽约证券交易所	美国	322	169,030.72	0.00
329	Coca-Cola Consolidated Inc	可口可乐装瓶有限公司	COKE UW	纳斯达克证券交易所	美国	200	159,851.54	0.00
330	Federal Signal Corp	联邦信号公司	FSS UN	纽约证券交易所	美国	209	159,220.01	0.00
331	DuPont de Nemours Inc	杜邦公司	DD UN	纽约证券交易所	美国	324	159,086.71	0.00
332	Coherent Corp	相干公司	COHR UN	纽约证券交易所	美国	247	157,738.82	0.00
333	Textron Inc	德事隆	TXT UN	纽约证券交易所	美国	262	150,588.17	0.00
334	Yum China Holdings Inc	百胜中国控股有限公司	YUMC UN	纽约证券交易所	美国	458	146,587.94	0.00
335	PJT Partners Inc	PJT 合伙股份有限公司	PJT UN	纽约证券交易所	美国	122	144,111.35	0.00
336	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	挪威邮轮控股有限公司	NCLH UN	纽约证券交易所	美国	982	142,563.23	0.00
337	Masimo Corp	Masimo 公司	MASI UW	纳斯达克证券交易所	美国	115	138,485.26	0.00
338	General Dynamics Corp	通用动力	GD UN	纽约证券交易所	美国	66	137,799.90	0.00
339	United Airlines Holdings	美国联合航空控股股	UAL UW	纳斯达克证券交易所	美国	241	137,379.48	0.00

	Inc	份有限 公司						
34 0	Owens Corning	欧文斯 科宁公 司	OC UN	纽约证 券交易 所	美国	138	135,854.19	0.00
34 1	PepsiCo Inc	百事可 乐	PEP UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	142	134,221.46	0.00
34 2	US Bancorp	美国合 众银行	USB UN	纽约证 券交易 所	美国	397	128,598.88	0.00
34 3	SPX Technolog ies Inc	SPX 公 司	SPXC UN	纽约证 券交易 所	美国	106	127,237.53	0.00
34 4	SouthStat e Corp	South State 公司	SSB UN	纽约证 券交易 所	美国	192	126,490.74	0.00
34 5	Somnigrou p Internati onal Inc	Somnig roup 国 际股份 有限公司	SGI UN	纽约证 券交易 所	美国	250	121,785.68	0.00
34 6	CenterPoi nt Energy Inc	中点能 源	CNP UN	纽约证 券交易 所	美国	463	121,772.22	0.00
34 7	Bright Horizons Family Solutions Inc	光明地 平线家 庭解决 方案股 份有限 公司	BFAM UN	纽约证 券交易 所	美国	137	121,208.20	0.00
34 8	Texas Pacific Land Corp	德克萨 斯州太 平洋土 地公司	TPL UN	纽约证 券交易 所	美国	16	120,996.38	0.00
34 9	Itron Inc	爱拓利 公司	ITRI UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	122	114,958.96	0.00
35 0	MetLife Inc	大都会 集团	MET UN	纽约证 券交易 所	美国	199	114,563.23	0.00
35 1	Lyft Inc	来福车 股份有 限公司	LYFT UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,010	113,947.73	0.00

35 2	Select Medical Holdings Corp	Select Medica l 控股 公司	SEM UN	纽约证 券交易 所	美国	1,047	113,774.92	0.00
35 3	Houlihan Lokey Inc	华利安 股份有 限公司	HLI UN	纽约证 券交易 所	美国	88	113,360.73	0.00
35 4	Builders FirstSour ce Inc	Builde rs FirstS ource 股份有 限公司	BLDR UN	纽约证 券交易 所	美国	133	111,099.83	0.00
35 5	Rocket Lab Corp	Rocket Lab 公 司	RKLB UR	纳斯达 克证券 交易所	美国	424	108,570.76	0.00
35 6	Globe Life Inc	Globe Life 股 份有限 公司	GL UN	纽约证 券交易 所	美国	120	106,769.09	0.00
35 7	Okta Inc	Okta Inc	OKTA UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	149	106,631.14	0.00
35 8	CBRE Group Inc	世邦魏 理仕	CBRE UN	纽约证 券交易 所	美国	101	101,309.37	0.00
35 9	Starbucks Corp	星巴克	SBUX UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	138	90,520.07	0.00
36 0	H&R Block Inc	H&R Block 股份有 限公司	HRB UN	纽约证 券交易 所	美国	229	89,982.24	0.00
36 1	Alliant Energy Corp	Allian t 能源 公司	LNT UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	204	88,307.63	0.00
36 2	Fifth Third Bancorp	五三银 行	FITB UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	295	86,857.80	0.00
36 3	Interface Inc	英特飞 股份有 限公司	TILE UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	550	82,406.22	0.00
36 4	SiTime Corp	SiTime 公司	SITM UQ	纳斯达 克证券	美国	54	82,369.14	0.00

				交易所				
365	Terawulf Inc	Terawulf 股份有限公司	WULF UR	纳斯达克证券交易所	美国	2,617	82,055.17	0.00
366	CH Robinson Worldwide Inc	罗宾逊全球物流有限公司	CHRW UW	纳斯达克证券交易所	美国	119	81,737.25	0.00
367	FNB Corp/PA	FNB/宾州	FNB UN	纽约证券交易所	美国	778	81,201.72	0.00
368	Eaton Corp PLC	伊顿公共有限公司	ETN UN	纽约证券交易所	美国	31	79,222.01	0.00
369	EVERTEC Inc	EVERTEC 股份有限公司	EVTC UN	纽约证券交易所	美国	293	75,613.79	0.00
370	Valero Energy Corp	Valero 能源	VLO UN	纽约证券交易所	美国	77	74,093.94	0.00
371	Taylor Morrison Home Corp	Taylor Morrison 房屋公司	TMHC UN	纽约证券交易所	美国	158	69,469.63	0.00
372	Occidental Petroleum Corp	西方石油	OXY UN	纽约证券交易所	美国	217	65,259.01	0.00
373	Gulfport Energy Corp	格尔夫波特能源公司	GPOR UN	纽约证券交易所	美国	42	60,484.01	0.00
374	Trade Desk Inc/The	Trade Desk 股份有限公司	TTD UQ	纳斯达克证券交易所	美国	111	57,203.59	0.00
375	Victory Capital Holdings Inc	Victory 资本控股股份有限公司	VCTR UW	纳斯达克证券交易所	美国	122	55,606.14	0.00
376	West Pharmaceu	西氏医药服务	WST UN	纽约证券交易所	美国	34	53,254.26	0.00

	tical Services Inc	公司		所				
37 7	Exelon Corp	Exelon 公司	EXC UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	160	49,732.23	0.00
37 8	Otter Tail Corp	Otter Tail 公 司	OTTR UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	90	49,667.08	0.00
37 9	Cummins Inc	康明斯	CMI UN	纽约证 券交易 所	美国	20	46,888.83	0.00
38 0	Federated Hermes Inc	联邦赫 尔墨斯 股份有 限公司	FHI UN	纽约证 券交易 所	美国	141	44,734.95	0.00
38 1	Community Health Systems Inc	美国社 区卫生 系统股 份有限 公司	CYH UN	纽约证 券交易 所	美国	1,819	44,273.08	0.00
38 2	Phinia Inc	Phinia 股份有 限公司	PHIN UN	纽约证 券交易 所	美国	139	44,269.57	0.00
38 3	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴 巴集团 控股有 限公司	BABA UN	纽约证 券交易 所	美国	53	43,028.41	0.00
38 4	Corteva Inc	科迪华 公司	CTVA UN	纽约证 券交易 所	美国	75	40,014.78	0.00
38 5	Onto Innovatio n Inc	Onto 创 新股份 有限公 司	ONTO UN	纽约证 券交易 所	美国	53	38,293.43	0.00
38 6	Interacti ve Brokers Group Inc	盈透证 券集团 股份有 限公司	IBKR UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	92	36,492.54	0.00
38 7	Piper Sandler Cos	Piper Sandle r 公司	PIPR UN	纽约证 券交易 所	美国	17	33,824.24	0.00
38 8	Crocs Inc	卡骆弛 股份有	CROX UW	纳斯达 克证券	美国	44	31,901.01	0.00

		限公司		交易所				
389	Consensus Cloud Solutions Inc	Consensus Cloud Solutions 股份有限公司	CCSI UW	纳斯达克证券交易所	美国	180	29,713.92	0.00
390	Ares Management Corp	阿瑞斯管理公司	ARES UN	纽约证券交易所	美国	23	28,517.00	0.00
391	Casella Waste Systems Inc	Casella 废物处理系统股份有限公司	CWST UW	纳斯达克证券交易所	美国	32	26,430.70	0.00
392	Etsy Inc	Etsy 股份有限公司	ETSY UW	纳斯达克证券交易所	美国	72	25,853.43	0.00
393	Garmin Ltd	佳明有限公司	GRMN UN	纽约证券交易所	美国	16	23,906.29	0.00
394	Arthur J Gallagher & Co	亚瑟加拉格尔有限公司	AJG UN	纽约证券交易所	美国	8	18,332.89	0.00
395	TransUnion	环联有限责任公司	TRU UN	纽约证券交易所	美国	28	17,638.79	0.00
396	UnitedHealth Group Inc	联合健康集团	UNH UN	纽约证券交易所	美国	7	15,632.88	0.00
397	McDonald's Corp	麦当劳	MCD UN	纽约证券交易所	美国	6	12,549.17	0.00
398	Skyworks Solutions Inc	思佳讯解决方案公司	SWKS UW	纳斯达克证券交易所	美国	19	10,135.72	0.00
399	Pfizer Inc	辉瑞制药	PFE UN	纽约证券交易所	美国	58	10,064.42	0.00
400	Southern Copper	南方铜业公司	SCCO UN	纽约证券交易所	美国	6	4,345.41	0.00

	Corp			所				
401	Cognizant Technology Solutions Corp	高知特科技解决方案公司	CTSH UW	纳斯达克证券交易所	美国	5	2,792.93	0.00

注：1. 本表所使用的证券代码为彭博代码。

2. 报告期末本基金持有的 “NVIDIA Corp”、“Microsoft Corp” 市值占净值比例被动超过 10%，“NVIDIA Corp” 已于 2025 年 7 月 7 日调整至 10%以下，“Microsoft Corp” 已于 2025 年 7 月 14 日调整至 10%以下。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	General Electric Co	GE UN	94,275,753.96	1.40
2	Meta Platforms Inc	META UW	81,051,682.53	1.20
3	Apple Inc	AAPL UW	74,427,203.89	1.10
4	Microsoft Corp	MSFT UW	66,052,767.98	0.98
5	AbbVie Inc	ABBV UN	58,092,284.66	0.86
6	NVIDIA Corp	NVDA UW	56,692,472.92	0.84
7	Visa Inc	V UN	56,589,491.92	0.84
8	Amgen Inc	AMGN UW	45,219,810.45	0.67
9	Eli Lilly & Co	LLY UN	41,922,385.18	0.62
10	Coca-Cola Co/The	KO UN	41,779,500.61	0.62
11	American Tower Corp	AMT UN	41,625,852.69	0.62
12	Amazon.com Inc	AMZN UW	32,739,105.50	0.49
13	Alphabet Inc	GOOGL UW	28,491,380.11	0.42
13	Alphabet Inc	GOOG UW	4,046,924.46	0.06
14	Oracle Corp	ORCL UN	30,534,077.48	0.45
15	Mastercard Inc	MA UN	28,562,105.07	0.42
16	Progressive Corp/The	PGR UN	27,746,395.15	0.41
17	Broadcom Inc	AVGO UW	22,978,479.69	0.34
18	Netflix Inc	NFLX UW	21,627,251.68	0.32
19	Tesla Inc	TSLA UW	20,969,134.44	0.31
20	3M Co	MMM UN	20,956,996.79	0.31

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
----	----------	------	----------	----------------

1	Apple Inc	AAPL UW	184,826,719.88	2.74
2	Alphabet Inc	GOOGL UW	85,606,547.77	1.27
2	Alphabet Inc	GOOG UW	64,125,189.86	0.95
3	Meta Platforms Inc	META UW	144,851,045.73	2.15
4	NVIDIA Corp	NVDA UW	132,302,447.19	1.96
5	Amazon.com Inc	AMZN UW	121,481,178.41	1.80
6	Tesla Inc	TSLA UW	83,859,200.60	1.24
7	Broadcom Inc	AVGO UW	79,158,819.21	1.17
8	Eli Lilly & Co	LLY UN	74,971,605.87	1.11
9	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	TSM UN	44,072,699.00	0.65
10	ServiceNow Inc	NOW UN	43,901,119.14	0.65
11	GE Vernova Inc	GEV UN	40,448,117.83	0.60
12	Salesforce Inc	CRM UN	39,467,453.51	0.59
13	Walmart Inc	WMT UN	39,189,980.79	0.58
14	Microsoft Corp	MSFT UW	38,725,807.46	0.57
15	Marvell Technology Inc	MRVL UW	33,367,571.10	0.50
16	Costco Wholesale Corp	COST UW	32,205,242.13	0.48
17	Palantir Technologies Inc	PLTR UW	31,675,517.80	0.47
18	Vertiv Holdings Co	VRT UN	31,419,404.00	0.47
19	Arista Networks Inc	ANET UN	30,940,281.10	0.46
20	GoDaddy Inc	GDDY UN	30,758,719.31	0.46

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	2,440,372,715.76
卖出收入（成交）总额	4,244,281,865.74

注：7.5.1 项“买入金额”、7.5.2 项“卖出金额”及 7.5.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

无。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

无。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
1	VanEck Gold Miners ETF/USA	ETF	交易型开放式	Van Eck Associates Corp	2,290,098.42	0.05
2	iPath Series B S&P 500 VIX Short-Term Futures ETN	ETN	交易型开放式	Barclays Capital Inc	2,184,558.11	0.05
3	SPDR Gold Shares	ETF	交易型开放式	State Street Global Advisors Inc	1,907,204.38	0.04
4	iShares 20+ Year Treasury Bond ETF	ETF	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	271,019.23	0.01
5	iMGP DBi Managed Futures Strategy ETF	ETF	交易型开放式	iM Global Partner Fund Management LLC	193,952.89	-
6	iShares Russell 1000 Value ETF	ETF	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	29,198.71	-
7	Global X Robotics & Artificial Intelligence ETF	ETF	交易型开放式	Global X Management Co LLC	22,905.37	-

注：报告期末，本基金仅持有上述 7 只基金。

7.11 投资组合报告附注

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

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

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	—
2	应收清算款	9,895,614.40
3	应收股利	1,178,602.50
4	应收利息	—
5	应收申购款	5,292,683.53
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	16,366,900.43

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
嘉实美国成长股票型证券投资	367,520	2,482.41	43,024,219.82	4.72	869,312,436.24	95.28

资 基金 - 人民币						
嘉实美国成长股票型证券投资基金 - 美元现汇	841	4,131.11	-	-	3,474,262.52	100.00
合计	368,117	2,487.83	43,024,219.82	4.70	872,786,698.76	95.30

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币	835,079.83	0.09
	嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇	130.06	0.00
	合计	835,209.89	0.09

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币	0~10
	嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币	10~50
	嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实美国成长股票型证券投资基金 - 人民币	嘉实美国成长股票型证券投资基金 - 美元现汇
基金合同生效日 （2013年6月14日） 基金份额总额	430,245,997.74	7,592,329.66

本报告期期初基金份额总额	1,340,845,658.20	4,166,527.16
本报告期基金总申购份额	166,017,606.49	49,109.27
减：本报告期基金总赎回份额	594,526,608.63	741,373.91
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	912,336,656.06	3,474,262.52

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

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

（1）基金管理人的重大人事变动情况

2025 年 5 月 22 日本基金管理人发布公告，刘伟先生任公司首席信息官、杨竞霜先生离任公司副总经理、首席信息官。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，聘任边济东先生为资产托管部总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为容诚会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
野村证券 NOMURA	—	6,251,838,780.54	93.89	2,884,850.10	96.26	—
瑞银集团 Union Bank of Switzerland	—	407,104,721.38	6.11	112,159.83	3.74	—
招商证券（香港）有限公司 China Merchants Securities (HK) Co., Ltd.	—	—	—	—	—	—
Wolfe Research Securities	—	—	—	—	—	—
德意志银行股份有限公司 Deutsche Bank	—	—	—	—	—	—
花旗环球金融亚洲有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited	—	—	—	—	—	—
金贝塔证	—	—	—	—	—	—

券有限公司 iGoldenbe ta Sec urities Company Limited						
麦格理资 本证券股 份有限公 司 Macquarie Secur ities Gr oup	-	-	-	-	-	-
瑞士信贷 （香港）有 限公司 Credit S uisse （Hong Ko ng） Limi ted	-	-	-	-	-	-
中信证券 国际有限 公司 CITIC Se curities Inter national Company Limited	-	-	-	-	-	-
麦格理银 行有限公 司香港分 行 Macquaire Bank Limited Hong K ong Bran ch.	-	-	-	-	-	-

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

2. 交易单元的选择标准和程序

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例(%)
野村证券 NOMURA	-	-	-	-	-	-	24,529,615.39	100.00
瑞银集团 Union Bank of Switzerland	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券（香港）有限公司 China Merchants Securities (HK) Co., Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
Wolfe Research Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
德意志银行股份有限公司 Deutsche Bank	-	-	-	-	-	-	-	-
花旗环球金融亚洲有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-

金贝塔证券有限公司 iGoldenbeta Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
麦格理资本证券股份有限公司 Macquarie Securities Group	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞士信贷（香港）有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券国际有限公司 CITIC Securities International Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
麦格理银行有限公司香港分行 Macquaire Bank Limited Hong Kong Branch.	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于嘉实美国成长股票（QDII）2025 年 1 月 9 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 1 月 7 日
2	关于嘉实美国成长股票（QDII）2025 年 1 月 20 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 1 月 16 日
3	嘉实美国成长股票型证券投资基金暂停申购（含定期定额投资）业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 1 月 23 日
4	嘉实基金管理有限公司关于调低旗下部分基金管理费、托管费率并修订基金合同及托管协议的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 1 月 25 日
5	关于嘉实美国成长股票（QDII）2025 年 2 月 17 日暂停赎回业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 2 月 13 日
6	关于新增嘉实美国成长股票（QDII）基金经理的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 2 月 22 日
7	嘉实美国成长股票型证券投资基金恢复申购（含定期定额投资）业务并暂停大额申购（含定期定额投资）业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 3 月 15 日
8	关于嘉实美国成长股票（QDII）2025 年 4 月 18 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 4 月 16 日
9	关于嘉实美国成长股票（QDII）2025 年 5 月 26 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 5 月 22 日
10	嘉实基金管理有限公司高级管理人员	证券日报、基金管理人	2025 年 5 月 22 日

	变更公告	网站及中国证监会基金 电子披露网站	
11	关于嘉实美国成长股票（QDII）2025 年 6 月 19 日暂停申购、赎回及定期定 额投资业务的公告	证券日报、基金管理人 网站及中国证监会基金 电子披露网站	2025 年 6 月 17 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

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

11.2 存放地点

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

11.3 查阅方式

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

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

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

嘉实基金管理有限公司

2025 年 8 月 29 日