

嘉实美国成长股票型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：2021 年 8 月 27 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 2021 年 08 月 25 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 2021 年 01 月 01 日起至 2021 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 境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	9
§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.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	42
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	43

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	43
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	93
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	95
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	95
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	95
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	95
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	95
7.11 投资组合报告附注	96
§8 基金份额持有人信息	97
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	97
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	98
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	99
§9 开放式基金份额变动	99
§10 重大事件揭示	99
10.1 基金份额持有人大会决议	99
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	100
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	100
10.4 基金投资策略的改变	100
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	100
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	100
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	100
10.8 其他重大事件	102
§11 备查文件目录	103
11.1 备查文件目录	103
11.2 存放地点	103
11.3 查阅方式	103

§ 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	330,131,622.48 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	325,692,607.36 份	4,439,015.12 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于美国大盘成长型股票，在股票选择及组合构建方面均运用量化投资方法并结合风险管理手段，力争获取长期资本增值。
投资策略	<p>本基金不尝试进行择时操作。在正常的市场条件下，本基金将在基金合同以及法律法规所允许的投资范围内，最大程度的持有股票类资产。当基金经理认为足够审慎时，本基金亦可以将小部分资产配置于债券类和现金类等大类资产上。</p> <p>本基金采用主动的量化投资策略。本基金将依托内部自主研发的定量投资模型以及强大的数据库系统，构建投资组合。嘉实量化投资团队将根据市场外在与内在变化趋势，定期或不定期地对模型进行复核，并做出相应调整，以不断改善模型的适用性。</p> <p>本基金主要投资于市值超过 20 亿美元的美国大盘股票；在此基础上，本基金将通过成长性模型挑选出足够数量的最具成长性的股票作为股票选择的样本空间。</p> <p>具体投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、固定收益投资策略、衍生品投资策略。</p>
业绩比较基准	$95\% \times \text{罗素 1000 成长指数收益率} + 5\% \times \text{境内银行活期存款税后利率}$
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	胡勇钦	许俊
	联系电话	(010)65215588	010-66594319
	电子邮箱	service@jsfund.cn	fcid@bankofchina.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）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期27楼09-14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	100005	100818	
法定代表人	经雷	刘连舸	

2.4 境外资产托管人

本基金基金托管人尚未委托任何第三方机构担任本基金的境外托管人。本基金的境外资产托管业务由基金托管人中国银行股份有限公司承担。

2.5 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

2.6 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(2021年1月1日-2021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	43,890,080.86	3,150,836.51
本期利润	91,411,755.41	6,819,960.96
加权平均基金份额本期利润	0.2717	1.6966
本期加权平均净值利润率	9.51%	9.73%
本期基金份额净值增长率	10.14%	11.19%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
期末可供分配利润	189,666,716.26	19,135,488.89
期末可供分配基金份额利润	0.5823	4.3108
期末基金资产净值	990,625,899.01	82,324,594.21
期末基金份额净值	3.042	2.871
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	204.20%	187.10%

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单位为美元。

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

	率①	准差②		④		
过去一个月	5.92%	0.65%	5.89%	0.59%	0.03%	0.06%
过去三个月	7.83%	0.98%	11.12%	0.87%	-3.29%	0.11%
过去六个月	10.14%	1.29%	11.94%	1.13%	-1.80%	0.16%
过去一年	26.96%	1.33%	39.09%	1.21%	-12.13%	0.12%
过去三年	67.33%	1.52%	84.58%	1.50%	-17.25%	0.02%
自基金合同生效起至今	204.20%	1.14%	246.93%	1.10%	-42.73%	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	4.40%	0.56%	5.89%	0.59%	-1.49%	-0.03%
过去三个月	9.66%	0.91%	11.12%	0.87%	-1.46%	0.04%
过去六个月	11.19%	1.21%	11.94%	1.13%	-0.75%	0.08%
过去一年	39.10%	1.29%	39.09%	1.21%	0.01%	0.08%
过去三年	70.79%	1.50%	84.58%	1.50%	-13.79%	0.00%
自基金合同生效起至今	187.10%	1.12%	246.93%	1.10%	-59.83%	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：

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

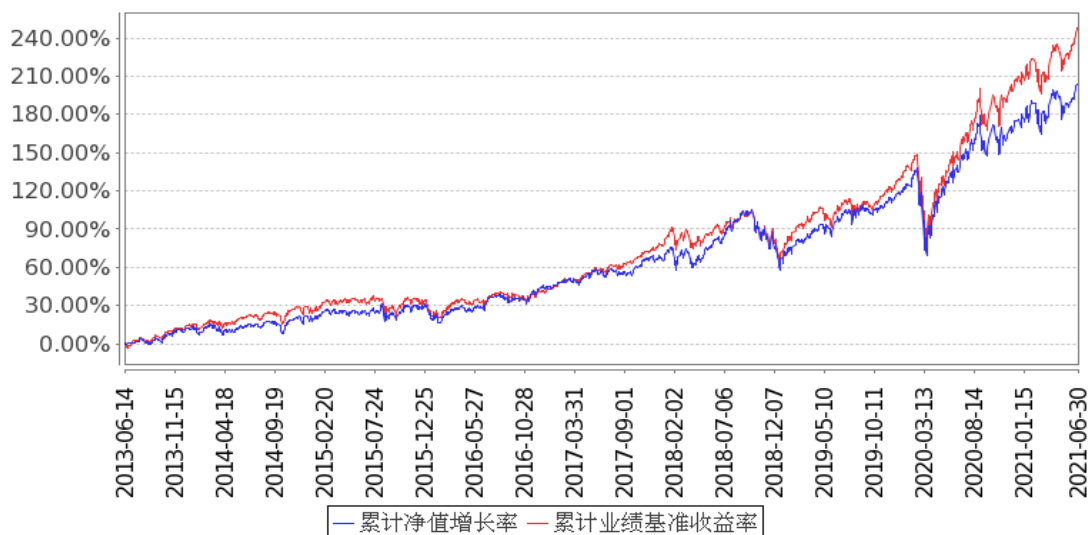
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

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

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

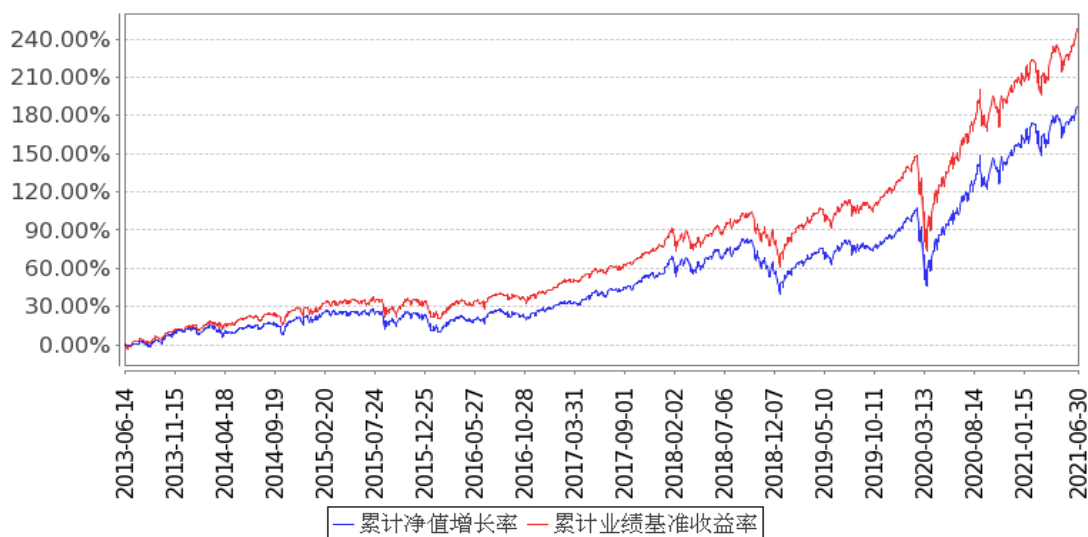
嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2013年06月14日至2021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2021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

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司，成立于 1999 年 3 月 25 日，是经中国证监会批准设立的第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，公司总部设在北京，在北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和 QDII、特定资产管理业务资格。

截止 2021 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 223 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深 300ETF 联接（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票混合（QDII）、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数（LOF）、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势混合、嘉实 H 股指数（QDII-LOF）、嘉实主题新动力混合、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实黄金（QDII-FOF-LOF）、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产（QDII）、嘉实纯债债券、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票（QDII）、嘉实丰益策略定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实活期宝货币、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实快线货币、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航混合、嘉实新财富混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽混合（LOF）、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实研究增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实物流产业股

票、嘉实丰安 6 个月定期债券、嘉实稳元纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实稳熙纯债债券、嘉实丰和灵活配置混合、嘉实新添华定期混合、嘉实现金添利货币、嘉实沪港深回报混合、嘉实原油（QDII-LOF）、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实稳宏债券、嘉实中关村 A 股 ETF、嘉实稳华纯债债券、嘉实 6 个月理财债券、嘉实稳怡债券、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实创业板 ETF、嘉实新添泽定期混合、嘉实新添丰定期混合、嘉实新添辉定期混合、嘉实领航资产配置混合（FOF）、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康股票、嘉实润泽量化定期混合、嘉实核心优势股票、嘉实润和量化定期混合、嘉实金融精选股票、嘉实新添荣定期混合、嘉实致兴定期纯债债券、嘉实战略配售混合、嘉实瑞享定期混合、嘉实资源精选股票、嘉实致盈债券、嘉实恒生港股通新经济指数（LOF）、嘉实中短债债券、嘉实致享纯债债券、嘉实互通精选股票、嘉实互融精选股票、嘉实养老 2040 混合（FOF）、嘉实消费精选股票、嘉实中债 1-3 政金债指数、嘉实养老 2050 混合（FOF）、嘉实长青竞争优势股票、嘉实科技创新混合、嘉实基本面 50ETF、嘉实稳联纯债债券、嘉实汇达中短债债券、嘉实养老 2030 混合（FOF）、嘉实致元 42 个月定期债券、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF、嘉实新添益定期混合、嘉实融享货币、嘉实瑞虹三年定期混合、嘉实价值成长混合、嘉实央企创新驱动 ETF、嘉实新兴科技 100ETF、嘉实致安 3 个月定期债券、嘉实汇鑫中短债债券、嘉实新兴科技 100ETF 联接、嘉实致华纯债债券、嘉实商业银行精选债券、嘉实央企创新驱动 ETF 联接、嘉实致禄 3 个月定期纯债债券、嘉实民企精选一年定期债券、嘉实先进制造 100ETF、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF 联接、嘉实安元 39 个月定期纯债债券、嘉实中债 3-5 年国开债指数、嘉实鑫和一年持有期混合、嘉实致融一年定期债券、嘉实瑞熙三年封闭运作混合、嘉实中证 500 指数增强、嘉实回报精选股票、嘉实致宁 3 个月定开纯债债券、嘉实中证 500 成长估值 ETF、嘉实瑞和两年持有期混合、嘉实基础产业优选股票、嘉实中证主要消费 ETF 联接、嘉实医药健康 100ETF、嘉实稳福混合、嘉实瑞成两年持有期混合、嘉实致益纯债债券、嘉实精选平衡混合、嘉实致信一年定期纯债债券、嘉实致嘉纯债债券、嘉实产业先锋混合、嘉实远见精选两年持有期混合、嘉实致业一年定期纯债债券、嘉实安泽一年定期纯债债券、嘉实前沿创新混合、嘉实远见企业精选两年持有期混合、嘉实价值发现三个月定期混合、嘉实 H 股 50ETF（QDII）、嘉实浦惠 6 个月持有期混合、嘉实创新先锋混合、嘉实核心成长混合、嘉实彭博国开债 1-5 年指数、嘉实动力先锋混合、嘉实多利收益债券、嘉实稳惠 6 个月持有期混合、嘉实优质精选混合、嘉实稳骏纯债基金、嘉实价值长青混合、嘉实民安添岁稳健养老一年持有期混合（FOF）、嘉实港股优势混合、嘉实睿享安久双利 18 个月持有期债券、嘉实中证沪港深互联网 ETF、嘉实中证软件服务 ETF、嘉实品质回报混合、嘉实创业板两年定期混合、嘉实竞争力优选混合、嘉实浦盈一年持有期混合、嘉实中证稀土产业 ETF、嘉实阿尔法优选混合、嘉实中

证大农业 ETF、嘉实匠心回报混合、嘉实医药健康 100ETF 联接、嘉实价值臻选混合、嘉实品质优选股票、嘉实恒生科技 ETF（QDII）、嘉实丰年一年定期纯债债券、嘉实领先优势混合、嘉实中证科创创业 50ETF、嘉实养老目标日期 2045 五年持有期混合（FOF）、嘉实优势精选混合。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券属于嘉实理财通系列基金。同时，基金管理人还管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

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、嘉实事件驱动股票基金经理	2013 年 6 月 14 日	-	25 年	曾任美国世纪投资管理公司（American Century Investments）资深副总经理，研究部总监暨基金经理，负责直接管理、支持公司旗下近二百亿美元的多项大型公募基金和对冲基金类产品。2012 年 2 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任定量投资部负责人，现任人工智能投资部负责人。理论物理学博士，毕业于美国德州大学奥斯汀分校和中国科学技术大学，美国国籍。

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

（2）证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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 1 次，为旗下组合被动跟踪标的指数需要，与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

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

2021 年度上半年，美国股票市场整体延续了多年牛市，继续保持上行趋势，各大主要宽基市场指数持续创出新高。

开年后，美国股票市场在一月份保持稳健，延续了 2020 年后期的风格。在 2 月中旬伴随美国疫苗推进、疫情防控有所进展的背景，市场对复苏起步后货币支持政策收敛产生预期，大宗商品价格持续上行，权益类资产估值收缩。在估值回落过程中，价值股相对表现稳健，2 月中旬之后高成长风格经历了较强的短期回调和多次波动，但远小于 2020 年一季度的强烈调整。市场在 5 月份之后再次转入成长较强的结构。

投资业绩上，本基金纯股票头寸相对业绩基准取得了显著的正超额收益，受仓位水平、较高的交易成本和换汇成本的影响，组合净值层面的收益略有减损，费后净值依然显著战胜基准指数。

行业上，本基金主要配置于信息科技等行业，以高科技龙头企业为主要配置，除传统的几大科技公司外，还包括新兴人工智能的龙头公司，生物医药领域的高科技企业等，此外还配置非必须消费品等行业，并通过对部分价值维度的补充来控制风格暴露的风险。

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，申赎的不确定性会直接影响仓位水平并影响投资业绩，本基金在保证 90%股票仓位和 5%现金仓位的合规约束下，成功实现了流动性操作。

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 3.042 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.14%；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 2.871 美元，本报告期基金份额净值增长率为 11.19%；业绩比较基准收益率为 11.94%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为，未来 1-2 年，全球经济处于疫情后阶段，全球经济复苏进程会出现不同步的进程，

由此带来全球范围、全资产类别上的配置机会。从国家地区等角度，美股是相对优选的方向之一，从大类资产配置的角度，权益类资产将是主要的领涨资产之一，经济周期相关性更强的周期板块、成长风格等，都将有更稳健的投资机会。

站在当前时点，中短期内，疫情因变异病毒如 Delta 等进一步出现变数，理性状况下的全球经济在疫情受控下共振强复苏的周期难以出现，在此情况下，货币政策将不能轻易退出，财政政策会同时被积极使用，整体上的宽松与扶持环境将成为必然选项。从中长期看，新冠疫情对经济的干扰会逐步消失，全球经济可以“轻装上阵”。美国新冠疫苗接种率在夏季之后将超过 60%，而欧陆国家预计将在秋季实现这一比例，日本目前进度较慢但也正逐渐加速，大概率到年末能达到该目标。变异病毒会带来疫情的反复性和波动性，但新冠疫情对社会、经济的影响整体上都逐渐趋弱，经济重启后景气循环向积极正面演化，近期各发达经济体 PMI 指数不断向上即反映了这一现实状况。

经济复苏周期中，权益类资产将是主要战略方向。就市场逻辑而言，盈利增长将是主要的股市上涨驱动因素。据 DataStream 的数据显示，2021 年全球、美国、欧洲、英国、日本的盈利同比增长分别将是 36.6%、34.6%、46.5% 和 23.0%，即使到 2022 年，各经济体的盈利水平也都将超过 10%。具体到三季度的时间窗口，预计二季报企业盈利还将超过市场预期，进一步推升全球权益资产价格。

复苏进程中的核心风险是过高的通胀。到目前，风险因素方面，通胀为止尚不构成威胁，但需要密切关注。若通胀持续、全面上升将极大程度影响下游企业的盈利能力，当前的高通胀若如美联储和市场预计般为暂时因素，则问题不大，但若形成持续性通胀，则对股市盈利增长构成威胁。另一个需要关注的变量则是美联储的削减量化宽松（Taper），这一变量的最近观察时点是 8 月下旬召开的全球央行峰会，但即使开始 Taper，以及后续开始的加息，预计其幅度、节奏都将非常温和平缓，以避免对资本市场造成明显的冲击，毕竟 2013 年的前车之鉴已经让人有惨痛教训，相信美联储对此会异常谨慎。

针对美股的估值，我们认为估值是否贵取决于观察的视角，从资产类的相对比较来看，权益类资产依然当仁不让。若从绝对估值的角度，则估值水平高于历史平均，比较偏贵，CAPE 的估值分位（自 1990 年开始统计样本期）美股、欧股、日股分别是 89%、47% 和 14%。若从相对估值的角度看，则估值依然便宜，从股票相对于债券的估值指标看，则美股、欧股、日股的分位仅为 36%、26% 和 8%。

在行业层面，我们依然倾向于成长风格，科技、生物等依然是投资者最关注的区域。

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

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括基金投资市场的各证券交易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的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实美国成长股票型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	77,275,732.04	76,054,976.46
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,019,176,816.37	991,307,002.54
其中：股票投资		1,017,082,360.48	986,869,713.76
基金投资		2,094,455.89	4,437,288.78
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		6,120,329.69	11,065,561.54
应收利息	6.4.7.5	4,261.91	5,130.37
应收股利		251,924.40	171,405.92
应收申购款		7,542,150.82	7,374,212.08
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,110,371,215.23	1,085,978,288.91
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		-	-
应付证券清算款		-	-

应付赎回款		35,315,097.58	36,882,839.89
应付管理人报酬		1,570,728.64	1,643,331.86
应付托管费		305,419.45	319,536.76
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	6,266.83
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	229,476.34	356,825.77
负债合计		37,420,722.01	39,208,801.11
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	353,029,302.23	379,227,706.27
未分配利润	6.4.7.10	719,921,190.99	667,541,781.53
所有者权益合计		1,072,950,493.22	1,046,769,487.80
负债和所有者权益总计		1,110,371,215.23	1,085,978,288.91

注：报告截止日 2021 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 3.042 元，基金份额总额 325,692,607.36 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 2.871 美元，基金份额总额 4,439,015.12 份，基金份额总额合计为 330,131,622.48 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		109,641,059.65	125,158,425.70
1. 利息收入		77,626.76	133,023.81
其中：存款利息收入	6.4.7.11	77,626.76	133,023.81
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		57,895,425.84	10,931,535.64
其中：股票投资收益	6.4.7.12	54,632,953.93	6,796,723.52
基金投资收益	6.4.7.13	161,199.88	486,860.31

债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	3,101,272.03	3,647,951.81
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	51,190,799.00	113,903,013.17
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-325,117.49	-1,216,612.81
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	802,325.54	1,407,465.89
减：二、费用		11,409,343.28	9,072,949.77
1. 管理人报酬	-	9,218,850.72	6,980,449.32
2. 托管费	-	1,792,554.30	1,357,309.62
3. 销售服务费	-	-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	277,937.60	617,987.52
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		524.02	4,990.86
7. 其他费用	6.4.7.21	119,476.64	112,212.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		98,231,716.37	116,085,475.93
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		98,231,716.37	116,085,475.93

6.3 所有者权益（基金净值）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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	379,227,706.27	667,541,781.53	1,046,769,487.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	98,231,716.37	98,231,716.37
三、本期基金份	-26,198,404.04	-45,852,306.91	-72,050,710.95

额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	202,887,484.12	375,521,289.73	578,408,773.85
2. 基金赎回款	-229,085,888.16	-421,373,596.64	-650,459,484.80
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	353,029,302.23	719,921,190.99	1,072,950,493.22
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	267,807,042.89	314,493,964.88	582,301,007.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期净利润)	-	116,085,475.93	116,085,475.93
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	125,769,861.59	118,126,275.02	243,896,136.61
其中: 1. 基金申购款	587,670,080.27	645,811,473.32	1,233,481,553.59
2. 基金赎回款	-461,900,218.68	-527,685,198.30	-989,585,416.98
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	393,576,904.48	548,705,715.83	942,282,620.31

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：

<u>经雷</u>	<u>黄志泉</u>	<u>李袁</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

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》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实美国成长股票型证券投资基金基金合同》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。

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基金净值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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2021 年 6 月 30 日
活期存款	77,275,732.04
定期存款	-
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	-
合计	77,275,732.04

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	678,629,744.09	1,017,082,360.48	338,452,616.39
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	1,682,981.16	2,094,455.89	411,474.73
其他	-	-	-
合计	680,312,725.25	1,019,176,816.37	338,864,091.12

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日

应收活期存款利息	4,254.51
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	7.40
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	4,261.91

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

无。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	115,421.00
应付证券出借违约金	-
预提费用	114,055.34
合计	229,476.34

6.4.7.9 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 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	357,757,773.39	357,757,773.39
本期申购	193,659,003.99	193,659,003.99
本期赎回（以“-”号填列）	-225,724,170.02	-225,724,170.02
-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	325,692,607.36	325,692,607.36

嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,485,329.90	21,469,932.88
本期申购	1,499,161.36	9,228,480.13
本期赎回（以“-”号填列）	-545,476.14	-3,361,718.14
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	4,439,015.12	27,336,694.87

注：

申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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	161,551,067.79	468,744,425.21	630,295,493.00
本期利润	43,890,080.86	47,521,674.55	91,411,755.41
本期基金份额交易产生的变动数	-15,774,432.39	-40,999,524.37	-56,773,956.76
其中：基金申购款	100,978,259.96	257,590,183.61	358,568,443.57
基金赎回款	-116,752,692.35	-298,589,707.98	-415,342,400.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	189,666,716.26	475,266,575.39	664,933,291.65

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	12,249,036.00	24,997,252.53	37,246,288.53
本期利润	3,150,836.51	3,669,124.45	6,819,960.96
本期基金份额交易产生的变动数	3,735,616.38	7,186,033.47	10,921,649.85
其中：基金申购款	5,873,547.42	11,079,298.74	16,952,846.16
基金赎回款	-2,137,931.04	-3,893,265.27	-6,031,196.31

回款			
本期已分配利润			
本期末	19,135,488.89	35,852,410.45	54,987,899.34

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
活期存款利息收入		77,342.15
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		284.61
合计		77,626.76

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		54,632,953.93
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		54,632,953.93

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
卖出股票成交总额		324,345,602.73
减：卖出股票成本总额		269,712,648.80
买卖股票差价收入		54,632,953.93

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	5,082,250.79
减：卖出/赎回基金成本总额	4,921,050.91
基金投资收益	161,199.88

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,099,441.44
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	1,830.59
合计	3,101,272.03

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	51,190,799.00
股票投资	52,089,408.76
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-898,609.76
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	51,190,799.00

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	802,325.54
合计	802,325.54

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	277,937.60
银行间市场交易费用	-
合计	277,937.60

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	54,547.97
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	5,421.30
合计	119,476.64

6.4.7.22 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	9,218,850.72	6,980,449.32
其中：支付销售机构的客户维护费	1,727,455.55	2,631,256.73

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 1.8%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.8%/当年天数。2. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,792,554.30	1,357,309.62

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

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自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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	77,275,732.04	77,342.15	90,650,478.15	132,481.91

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(2021年1月1日至2021年6月30日),本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末(2021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 risk 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。

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同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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 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 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	77,275,732.04	-	-	-	77,275,732.04
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	1,019,176,816.37	1,019,176,816.37
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	6,120,329.69	6,120,329.69
应收利息	-	-	-	4,261.91	4,261.91
应收股利	-	-	-	251,924.40	251,924.40
应收申购款	-	-	-	7,542,150.82	7,542,150.82
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	77,275,732.04	-	-	1,033,095,483.19	1,110,371,215.23
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	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	35,315,097.58	35,315,097.58
应付管理人报酬	-	-	-	1,570,728.64	1,570,728.64
应付托管费	-	-	-	305,419.45	305,419.45
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	229,476.34	229,476.34

负债总计	-	-	-	37,420,722.01	37,420,722.01
利率敏感度缺口	77,275,732.04	-	-	995,674,761.18	1,072,950,493.22
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	76,054,976.46	-	-	-	76,054,976.46
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	991,307,002.54	991,307,002.54
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	11,065,561.54	11,065,561.54
应收利息	-	-	-	5,130.37	5,130.37
应收股利	-	-	-	171,405.92	171,405.92
应收申购款	-	-	-	7,374,212.08	7,374,212.08
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	76,054,976.46	-	-	1,009,923,312.45	1,085,978,288.91
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	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	36,882,839.89	36,882,839.89
应付管理人报酬	-	-	-	1,643,331.86	1,643,331.86
应付托管费	-	-	-	319,536.76	319,536.76
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应付税费	-	-	-	6,266.83	6,266.83
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	356,825.77	356,825.77
负债总计	-	-	-	39,208,801.11	39,208,801.11
利率敏感度缺口	76,054,976.46	-	-	970,714,511.34	1,046,769,487.80

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	
	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的

	动	影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	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 2021 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	55,823,571.82	-	-	55,823,571.82
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	1,019,176,816.37	-	-	1,019,176,816.37
衍生金融资产	-	-	-	-
应收股利	251,924.40	-	-	251,924.40
应收利息	1,269.08	-	-	1,269.08
应收申购款	1,447,924.05	-	-	1,447,924.05

	.05			
应收证券清算款	6,120,329.69	-	-	6,120,329.69
其它资产	-	-	-	-
资产合计	1,082,821,835.41	-	-	1,082,821,835.41
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
应付赎回款	632,618.86	-	-	632,618.86
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
其他负债	2,196.37	-	-	2,196.37
负债合计	634,815.23	-	-	634,815.23
资产负债表外汇风险敞口净额	1,082,187,020.18	-	-	1,082,187,020.18
	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
项目	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	34,226,478.31	-	-	34,226,478.31
结算备付金	-	-	-	-

存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	991,307,002.54	-	-	991,307,002.54
衍生金融资产	-	-	-	-
应收股利	171,405.92	-	-	171,405.92
应收利息	1,345.11	-	-	1,345.11
应收申购款	219,225.22	-	-	219,225.22
应收证券清算款	11,065,561.54	-	-	11,065,561.54
其它资产	-	-	-	-
资产合计	1,036,991,018.64	-	-	1,036,991,018.64
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
应付赎回款	90,010.80	-	-	90,010.80
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
其他负债	245.14	-	-	245.14
负债合计	90,255.94	-	-	90,255.94
资产负债表外汇风险敞口净额	1,036,900,762.70	-	-	1,036,900,762.70

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变
----	------------------

	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	所有外币相对人民币升值 5%	54,109,351.01	51,845,038.14
	所有外币相对人民币贬值 5%	-54,109,351.01	-51,845,038.14

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 2021年6月30日		上年度末 2020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	1,017,082,360.48	94.79	986,869,713.76	94.28
交易性金融资产—基金投资	2,094,455.89	0.20	4,437,288.78	0.42
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	1,019,176,816.37	94.99	991,307,002.54	94.70

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		
	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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	业绩比较基准上升 5%	59,239,220.47	51,239,291.72
	业绩比较基准下降 5%	-59,239,220.47	-51,239,291.72

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，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中属于第一层次的余额为 1,019,176,816.37 元，无属于第二层次的余额，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次 991,307,002.54 元，无属于第二层次的余额，无属于第三层次的余额）。

(ii) 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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债, 其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外, 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	1,017,082,360.48	91.60
	其中: 普通股	1,004,703,274.59	90.48
	存托凭证	7,271,513.37	0.65
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	5,107,572.52	0.46
2	基金投资	2,094,455.89	0.19
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	77,275,732.04	6.96
8	其他各项资产	13,918,666.82	1.25
9	合计	1,110,371,215.23	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	1,017,082,360.48	94.79
合计	1,017,082,360.48	94.79

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 (%)
信息技术	448,554,320.19	41.81
非必需消费品	176,604,427.74	16.46
通信服务	122,874,616.44	11.45
医疗保健	94,750,248.08	8.83
必需消费品	19,026,330.38	1.77
工业	57,061,319.69	5.32
金融	59,608,366.12	5.56
原材料	18,599,967.55	1.73
公用事业	600,197.04	0.06
能源	13,545,030.87	1.26
房地产	749,963.86	0.07
房地产信托特殊类	2,067,916.07	0.19
房地产信托抵押类	195,846.46	0.02
房地产信托零售类	2,735,173.33	0.25
房地产信托酒店及度假村类	108,636.66	0.01
合计	1,017,082,360.48	94.79

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	Apple Inc	苹果公司	AAPL UW	纳斯达 克证 券交 易所	美国	122,403.00	108,299,150.56	10.09
2	Microsoft Corp	微软	MSFT UW	纳斯达 克证 券交 易所	美国	60,085.00	105,151,218.89	9.80
3	Amazon.com Inc	亚马逊公司	AMZN UW	纳斯达 克证 券交 易所	美国	3,255.00	72,338,396.14	6.74
4	Alphabet Inc	Alphabet 公司	GOOGL UW	纳斯达 克证 券交 易所	美国	3,876.00	61,140,828.58	5.70
5	Facebook Inc	Facebook 公司	FB UW	纳斯达 克证 券交 易所	美国	19,600.00	44,026,330.87	4.10
6	NVIDIA Co	英伟达	NVDA UW	纳斯达	美国	6,386.00	33,007,400.00	3.08

	rp			克 证 券 交 易 所			84.30	
7	Tesla Inc	特斯拉公司	TSLA UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	5,737.00	25,190,765.24	2.35
8	PayPal Holdings Inc	Paypal 控股股份有限公司	PYPL UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	12,213.00	22,996,956.23	2.14
9	Visa Inc	维萨公司	V UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	12,360.00	18,669,787.19	1.74
10	Mastercard Inc	万事达股份有限公司	MA UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	6,610.00	15,589,803.38	1.45
11	Broadcom Inc	博通股份有限公司	AVGO UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	3,622.00	11,157,332.25	1.04
12	UnitedHealth Group Inc	联合健康集团	UNH UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,877.00	10,029,343.24	0.93
13	Applied Materials Inc	应用材料	AMAT UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	9,616.00	8,845,933.80	0.82
14	Eli Lilly & Co	礼来	LLY UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	5,461.00	8,097,145.67	0.75
15	Lam Research Corp	泛林集团	LRCX UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,809.00	7,604,289.01	0.71
16	NIKE Inc	耐克公司	NKE UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	7,428.00	7,413,298.87	0.69
17	Adobe Inc	奥多比	ADBE UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,928.00	7,294,188.83	0.68
18	AbbVie Inc	艾伯维公司	ABBV UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	9,936.00	7,230,086.04	0.67
19	Lowe's Cos Inc	劳氏	LOW UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	5,666.00	7,099,869.67	0.66
20	Home Depot Inc/The	家得宝	HD UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,440.00	7,086,610.83	0.66

21	Accenture PLC	埃森哲公司	ACN UN	纽约证券交易所	美国	3,597.00	6,850,029.25	0.64
22	Netflix Inc	奈飞公司	NFLX UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,922.00	6,558,420.27	0.61
23	Costco Wholesale Corp	开市客	COST UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,537.00	6,484,743.92	0.60
24	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM UW	纳斯达克证券交易所	美国	6,997.00	6,460,624.62	0.60
25	IDEXX Laboratories Inc	爱德士股份有限公司	IDXX UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,477.00	6,025,977.08	0.56
26	Intuitive Surgical Inc	直觉外科手术公司	ISRG UW	纳斯达克证券交易所	美国	942	5,596,390.31	0.52
27	Advanced Micro Devices Inc	AMD 公司	AMD UR	纳斯达克证券交易所	美国	9,035.00	5,482,412.64	0.51
28	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	22,476.00	5,388,268.37	0.50
29	Square Inc	Square 股份有限公司	SQ UN	纽约证券交易所	美国	3,292.00	5,184,809.07	0.48
30	ASML Holding NV	阿斯麦控股公司	ASML UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,107.00	4,940,425.30	0.46
31	KLA Corp	KLA 公司	KLAC UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,257.00	4,727,126.30	0.44
32	Align Technology Inc	Align 科技股份有限公司	ALGN UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,164.00	4,594,448.96	0.43
33	Deere & Co	迪尔	DE UN	纽约证券交易所	美国	1,919.00	4,372,521.85	0.41
34	Moderna Inc	莫德纳公司	MRNA UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,764.00	4,195,736.24	0.39
35	Texas Instruments	德州仪器	TXN UW	纳斯达克	美国	3,328.00	4,134,29	0.39

	struments Inc			克 证 券 交 易 所			8.62	
36	Capital One Financial Corp	第一资本金融	COF UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,643.00	3,640,496.78	0.34
37	Oracle Corp	甲骨文	ORCL UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	6,683.00	3,360,574.51	0.31
38	L Brands Inc	L Brands 股份有限公司	LB UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	6,717.00	3,126,862.95	0.29
39	Thermo Fisher Scientific Inc	Thermo Fisher Scientific 公司	TMO UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	949	3,092,721.39	0.29
40	United Parcel Service Inc	联合包裹服务股份有限公司	UPS UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,289.00	3,075,287.52	0.29
41	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	1,263.00	3,018,216.60	0.28
42	Amgen Inc	AMGEN-T	AMGN UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,808.00	2,846,966.07	0.27
43	Caterpillar Inc	卡特彼勒	CAT UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,997.00	2,807,605.39	0.26
44	Abbott Laboratories	雅培制药	ABT UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,693.00	2,765,759.32	0.26
45	Starbucks Corp	星巴克	SBUX UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	3,811.00	2,752,699.71	0.26
46	Estee Lauder Cos Inc/The	雅诗兰黛	EL UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,311.00	2,693,880.31	0.25
47	SVB Financial Group	硅谷银行金融集团	SIVB UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	726	2,609,674.84	0.24
48	salesforce.com Inc	Salesforce.com 股份有限	CRM UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,618.00	2,553,217.96	0.24

		公司						
49	Intuit Inc	Intuit 公司	INTU UW	纳斯达克证券交易所	美国	773	2,447,741.00	0.23
50	Roku Inc	Roku Inc	ROKU UW	纳斯达克证券交易所	美国	819	2,429,809.96	0.23
51	Zebra Technologies Corp	斑马技术公司	ZBRA UW	纳斯达克证券交易所	美国	697	2,384,129.17	0.22
52	Synopsys Inc	新思科技公司	SNPS UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,335.00	2,378,477.36	0.22
53	Union Pacific Corp	联合太平洋	UNP UN	纽约证券交易所	美国	1,611.00	2,288,860.14	0.21
54	Wells Fargo & Co	富国银行	WFC UN	纽约证券交易所	美国	7,697.00	2,251,972.32	0.21
55	Simon Property Group Inc	西蒙房地产集团公司	SPG UN	纽约证券交易所	美国	2,598.00	2,189,890.18	0.20
56	Zoom Video Communications Inc	Zoom Video Communications Inc	ZM UW	纳斯达克证券交易所	美国	865	2,162,718.42	0.20
57	ResMed Inc	瑞思迈股份有限公司	RMD UN	纽约证券交易所	美国	1,332.00	2,121,268.41	0.20
58	Cadence Design Systems Inc	Cadence 设计系统股份有限公司	CDNS UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,373.00	2,097,425.60	0.20
59	Expedia Group Inc	亿客行集团股份有限公司	EXPE UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,973.00	2,086,611.20	0.19
60	West Pharmaceutical Services Inc	西氏医药服务公司	WST UN	纽约证券交易所	美国	896	2,078,560.43	0.19
61	Generac Holdings Inc	Generac 控股公司	GNRC UN	纽约证券交易所	美国	775	2,078,480.65	0.19
62	Fortinet	飞塔股份	FTNT UW	纳斯达克	美国	1,328.00	2,043,43	0.19

	Inc	有限公司		克 证 券 交 易 所			5.06	
63	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	台积电	TSM UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,610.00	2,026,00 1.06	0.19
64	Dell Technologies Inc	Dell Technologies Inc	DELL UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,131.00	2,015,98 2.54	0.19
65	DocuSign Inc	DocuSign 股份有限公司	DOCU UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,095.00	1,977,62 4.92	0.18
66	Morgan Stanley	摩根士丹利	MS UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,186.00	1,887,15 2.45	0.18
67	Twilio Inc	Twilio 股份有限公司	TWLO UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	733	1,866,44 7.44	0.17
68	Berkshire Hathaway Inc	伯克希尔哈撒韦公司	BRK/B UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,039.00	1,865,41 1.24	0.17
69	Nucor Corp	纽柯公司	NUE UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,004.00	1,861,63 1.05	0.17
70	Darling Ingredients Inc	Darling Ingredients 公司	DAR UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	4,061.00	1,770,82 6.46	0.17
71	General Electric Co	通用电气	GE UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	20,168.0 0	1,753,66 7.01	0.16
72	HP Inc	惠普	HPQ UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	8,979.00	1,751,17 8.13	0.16
73	HCA Healthcare Inc	HCA 医疗保健有限公司	HCA UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,309.00	1,748,24 9.45	0.16
74	Stryker Corp	史赛克	SYK UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,034.00	1,734,92 9.75	0.16
75	Chipotle Mexican Grill Inc	Chipotle Mexican Grill	CMG UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	173	1,732,65 5.80	0.16

		股份有限 公司						
76	ServiceNow Inc	ServiceNow 公司	NOW UN	纽约证 券交易 所	美国	485	1,721,82 1.76	0.16
77	Lattice S emiconduct or Corp	莱迪斯半 导体公司	LSCC UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,698.00	1,705,03 7.71	0.16
78	Merck & Co Inc	默克	MRK UN	纽约证 券交易 所	美国	3,361.00	1,688,57 3.04	0.16
79	Mohawk In dustries Inc	Mohawk 工业股份 有限公司	MHK UN	纽约证 券交易 所	美国	1,356.00	1,683,56 4.34	0.16
80	Microchip Technolo gy Inc	微芯科技 股份有限 公司	MCHP UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,738.00	1,681,22 8.88	0.16
81	United Re ntals Inc	联合租赁 公司	URI UN	纽约证 券交易 所	美国	803	1,654,85 1.71	0.15
82	FedEx Cor p	联邦快递	FDX UN	纽约证 券交易 所	美国	852	1,642,00 9.87	0.15
83	JPMorgan Chase & Co	摩根大通	JPM UN	纽约证 券交易 所	美国	1,629.00	1,636,82 5.64	0.15
84	Maxim Int egrated P roducts I nc	美信	MXIM UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,371.00	1,613,78 8.28	0.15
85	Ally Fina ncial Inc	Ally 金融 公司	ALLY UN	纽约证 券交易 所	美国	4,974.00	1,601,48 5.66	0.15
86	Signet Je welers Lt d	英国西格 尼珠宝有 限公司	SIG UN	纽约证 券交易 所	美国	3,061.00	1,597,57 1.04	0.15
87	Johnson & Johnson	强生	JNJ UN	纽约证 券交易 所	美国	1,492.00	1,587,84 1.42	0.15
88	Ford Moto r Co	福特汽车	F UN	纽约证 券交易 所	美国	16,451.0 0	1,579,24 8.06	0.15
89	Crocs Inc	卡骆驰股 份有限公 司	CROX UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,086.00	1,570,19 6.56	0.15

		司		交易所				
90	Goldman Sachs Group Inc/The	高盛	GS UN	纽约证券交易所	美国	613	1,502,954.47	0.14
91	Tapestry Inc	TPR-DRS-RS	TPR UN	纽约证券交易所	美国	5,320.00	1,494,308.99	0.14
92	CommScope Holding Co Inc	康普控股股份有限公司	COMM UW	纳斯达克证券交易所	美国	10,815.00	1,488,844.07	0.14
93	Advanced Drainage Systems Inc	先进排水系统公司	WMS UN	纽约证券交易所	美国	1,951.00	1,469,208.08	0.14
94	Avantor Inc	Avantor 股份有限公司	AVTR UN	纽约证券交易所	美国	6,339.00	1,454,154.88	0.14
95	Discover Financial Services	Discover 金融服务公司	DFS UN	纽约证券交易所	美国	1,898.00	1,450,385.60	0.14
96	Matador Resources Co	Matador 资源公司	MTDR UN	纽约证券交易所	美国	6,090.00	1,416,705.74	0.13
97	Qorvo Inc	Qorvo 股份有限公司	QRVO UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,102.00	1,392,838.26	0.13
98	Mettler-Toledo International Inc	梅特勒-托利多国际股份有限公司	MTD UN	纽约证券交易所	美国	155	1,387,162.41	0.13
99	Navient Corp	Navient 公司	NAVI UW	纳斯达克证券交易所	美国	11,107.00	1,386,972.55	0.13
100	Veeva Systems Inc	Veeva Systems 股份有限公司	VEEV UN	纽约证券交易所	美国	682	1,369,979.84	0.13
101	Entegris Inc	Entegris 股份有限公司	ENTG UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,724.00	1,369,543.01	0.13
102	Ameriprise Financial Inc	阿默普莱斯金融公司	AMP UN	纽约证券交易所	美国	845	1,358,582.29	0.13
103	McKesson	McKesson	MCK UN	纽约证	美国	1,099.00	1,357,73	0.13

	Corp	公司		券交易所			7.05	
104	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	2,351.00	1,290,650.33	0.12
105	Altria Group Inc	高特利	MO UN	纽约证券交易所	美国	4,165.00	1,282,893.17	0.12
106	Caesars Entertainment Inc	凯撒娱乐集团	CZR UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,907.00	1,278,138.86	0.12
107	Chevron Corp	雪佛龙	CVX UN	纽约证券交易所	美国	1,886.00	1,276,125.83	0.12
108	Etsy Inc	Etsy 股份有限公司	ETSY UW	纳斯达克证券交易所	美国	953	1,267,248.88	0.12
109	RH	RH	RH UN	纽约证券交易所	美国	285	1,250,126.25	0.12
110	Kohl's Corp	Kohl's 公司	KSS UN	纽约证券交易所	美国	3,455.00	1,230,035.66	0.11
111	Zoetis Inc	硕腾股份有限公司	ZTS UN	纽约证券交易所	美国	1,005.00	1,209,923.76	0.11
112	Carrier Global Corp	Carrier Global Corp	CARR UN	纽约证券交易所	美国	3,837.00	1,204,667.82	0.11
113	Tractor Supply Co	拖拉机供应公司	TSCO UW	纳斯达克证券交易所	美国	997	1,198,360.31	0.11
114	Teradyne Inc	泰瑞达	TER UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,379.00	1,193,379.70	0.11
115	Cheniere Energy Inc	Cheniere 能源公司	LNG UA	纽约证券交易所	美国	2,108.00	1,181,215.85	0.11
116	EPAM Systems Inc	EPAM 系统公司	EPAM UN	纽约证券交易所	美国	352	1,161,900.15	0.11
117	American International Group	美国国际集团	AIG UN	纽约证券交易所	美国	3,755.00	1,154,665.35	0.11

	Inc							
118	PepsiCo Inc	百事可乐	PEP UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,202.00	1,150,546.01	0.11
119	Macy's Inc	梅西百货	M UN	纽约证券交易所	美国	9,295.00	1,138,484.10	0.11
120	Sysco Corp	Sysco 公司	SYU UN	纽约证券交易所	美国	2,254.00	1,132,122.83	0.11
121	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	80	1,130,822.42	0.11
122	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	5,263.00	1,124,023.68	0.10
123	APA Corp	APA Corp	APA UW	纳斯达克证券交易所	美国	8,030.00	1,122,047.66	0.10
124	Charter Communications Inc	查特通信公司	CHTR UW	纳斯达克证券交易所	美国	238	1,109,232.12	0.10
125	Unum Group	尤纳姆集团	UNM UN	纽约证券交易所	美国	6,016.00	1,103,736.51	0.10
126	SYNNEX Corp	SYNNEX 公司	SNX UN	纽约证券交易所	美国	1,403.00	1,103,574.23	0.10
127	Anthem Inc	Anthem 股份有限公司	ANTM UN	纽约证券交易所	美国	437	1,077,845.72	0.10
128	Fifth Third Bancorp	五三银行	FITB UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,233.00	1,045,422.41	0.10
129	Herc Holdings Inc	Herc 控股公司	HRI UN	纽约证券交易所	美国	1,435.00	1,038,916.19	0.10
130	HubSpot Inc	HubSpot 公司	HUBS UN	纽约证券交易所	美国	275	1,035,218.10	0.10
131	Franklin Resources Inc	富兰克林资源	BEN UN	纽约证券交易所	美国	4,995.00	1,032,259.70	0.10

132	Seagate Technology Holdings PLC	Seagate Technology Holdings PLC	STX UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,812.00	1,029,282.31	0.10
133	NXP Semiconductors NV	恩智浦半导体公司	NXPI UW	纳斯达克证券交易所	美国	766	1,017,992.38	0.09
134	Bank of America Corp	美国银行公司	BAC UN	纽约证券交易所	美国	3,781.00	1,007,069.06	0.09
135	Twitter Inc	推特公司	TWTR UN	纽约证券交易所	美国	2,260.00	1,004,614.03	0.09
136	Zscaler Inc	Zscaler Inc	ZS UW	纳斯达克证券交易所	美国	698	974,246.91	0.09
137	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	1,913.00	962,577.96	0.09
138	Mosaic Co /The	Mosaic 公司	MOS UN	纽约证券交易所	美国	4,607.00	949,695.23	0.09
139	MGM Resorts International	美高梅国际酒店集团	MGM UN	纽约证券交易所	美国	3,437.00	946,973.46	0.09
140	Meta Financial Group Inc	梅塔金融集团	CASH UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,893.00	946,227.58	0.09
141	PulteGroup Inc	Pulte 集团公司	PHM UN	纽约证券交易所	美国	2,653.00	935,255.87	0.09
142	Dick's Sporting Goods Inc	迪克体育用品有限公司	DKS UN	纽约证券交易所	美国	1,406.00	910,015.81	0.08
143	T Rowe Price Group Inc	普信集团公司	TROW UW	纳斯达克证券交易所	美国	707	904,186.54	0.08
144	Builders FirstSource Inc	Builders FirstSource 股份有限公司	BLDR UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,266.00	900,069.97	0.08

145	Trane Technologies PLC	特灵科技公共有限公司	TT UN	纽约证券交易所	美国	756	899,309.49	0.08
146	Bio-Techne Corp	Bio-techne 公司	TECH UW	纳斯达克证券交易所	美国	309	898,795.91	0.08
147	Williams-Sonoma Inc	威廉斯-索纳玛公司	WSM UN	纽约证券交易所	美国	871	898,310.17	0.08
148	Fortune Brands Home & Security Inc	Fortune Brands 家居与安全有限公司	FBHS UN	纽约证券交易所	美国	1,392.00	895,738.86	0.08
149	Olin Corp	奥林公司	OLN UN	纽约证券交易所	美国	2,976.00	889,360.42	0.08
150	Marvell Technology Inc	Marvell Technology Inc	MRVL UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,357.00	888,159.16	0.08
151	Old Dominion Freight Line Inc	Old Dominion Freight Line 股份有限公司	ODFL UW	纳斯达克证券交易所	美国	539	883,730.05	0.08
152	Avery Dennison Corp	艾利丹尼森	AVY UN	纽约证券交易所	美国	650	882,811.43	0.08
153	CDW Corp/DE	特拉华 CDW 公司	CDW UW	纳斯达克证券交易所	美国	772	871,013.99	0.08
154	Alliance Data Systems Corp	联合数据系统公司	ADS UN	纽约证券交易所	美国	1,292.00	869,616.54	0.08
155	Lithia Motors Inc	Lithia 汽车股份有限公司	LAD UN	纽约证券交易所	美国	389	863,560.07	0.08
156	Stanley Black & Decker Inc	史丹利百得公司	SWK UN	纽约证券交易所	美国	651	862,090.59	0.08
157	Sherwin-Williams Co	宣威威廉斯	SHW UN	纽约证券交易所	美国	489	860,666.53	0.08

	/The			所				
158	Waters Corp	沃特世公司	WAT UN	纽约证券交易所	美国	374	835,020.51	0.08
159	Kraft Heinz Co/The	卡夫亨氏公司	KHC UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,168.00	834,587.04	0.08
160	Novanta Inc	Novanta 股份有限公司	NOVT UW	纳斯达克证券交易所	美国	958	833,999.43	0.08
161	Procter & Gamble Co/The	宝洁	PG UN	纽约证券交易所	美国	949	827,206.57	0.08
162	AutoNation Inc	AutoNation 公司	AN UN	纽约证券交易所	美国	1,338.00	819,501.02	0.08
163	Horizon Therapeutics Plc	Horizon Therapeutic 公共有限公司	HZNP UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,353.00	818,461.85	0.08
164	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	1,635.00	817,096.70	0.08
165	Donnelley Financial Solutions Inc	当纳利金融解决方案股份有限公司	DFIN UN	纽约证券交易所	美国	3,821.00	814,573.39	0.08
166	Uber Technologies Inc	优步技术股份有限公司	UBER UN	纽约证券交易所	美国	2,481.00	803,298.71	0.07
167	Tempur Sealy International Inc	泰浦丝涟国际公司	TPX UN	纽约证券交易所	美国	3,169.00	802,299.91	0.07
168	MKS Instruments Inc	MKS Instruments 股份有限公司	MKSI UW	纳斯达克证券交易所	美国	696	800,104.06	0.07
169	Humana Inc	Humana 公司	HUM UN	纽约证券交易所	美国	276	789,364.27	0.07
170	Stifel Financial C	斯迪富融资公司	SF UN	纽约证券交易所	美国	1,877.00	786,466.92	0.07

	orp			所				
171	Brightsp re Invest ment Grou p Inc	Brightsp here 投资 集团有限 公司	BSIG UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	5,165.00	781,775. 14	0.07
172	Ovintiv I nc	Ovintiv Inc	OVV UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,818.00	776,196. 91	0.07
173	WESCO Int ernational Inc	西科国际 有限公司	WCC UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,162.00	771,832. 33	0.07
174	Synchrony Financia l	同步金融 公司	SYF UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,458.00	770,445. 48	0.07
175	Change He althcare Inc	Change Healthca re Inc	CHNG UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	5,175.00	770,250. 64	0.07
176	Quanta Se rvices In c	Quanta 服务股份 有限公司	PWR UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,308.00	765,299. 36	0.07
177	Johnson C ontrols I nternation al plc	江森自控 国际有限 公司	JCI UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,718.00	761,686. 75	0.07
178	Xilinx In c	赛灵思	XLNX UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	813	759,658. 15	0.07
179	American Express C o	美国运通	AXP UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	708	755,720. 84	0.07
180	Artisan P artners A sset Mana gement In c	阿尔笛生 合伙人资 产管理股 份有限公 司	APAM UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,249.00	738,351. 83	0.07
181	Lennar Co rp	Lennar 公 司	LEN UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,144.00	734,231. 71	0.07
182	Agilent T echnologie s Inc	安捷伦	A UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	762	727,608. 94	0.07
183	Illumina Inc	Illumina 公司	ILMN UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	235	718,391. 22	0.07

184	XPO Logistics Inc	XPO 物流公司	XPO UN	纽约证券交易所	美国	793	716,636.79	0.07
185	Live Nation Entertainment Inc	Live Nation 娱乐公司	LYV UN	纽约证券交易所	美国	1,265.00	715,787.80	0.07
186	CIT Group Inc	CIT 集团公司	CIT UN	纽约证券交易所	美国	2,147.00	715,544.77	0.07
187	Atkore Inc	Atkore 股份有限公司	ATKR UN	纽约证券交易所	美国	1,558.00	714,603.34	0.07
188	Aon PLC	Aon PLC	AON UN	纽约证券交易所	美国	457	704,882.96	0.07
189	Public Storage	公共存储公司	PSA UN	纽约证券交易所	美国	361	701,237.98	0.07
190	Match Group Inc	Match Group 股份有限公司	MTCH UW	纳斯达克证券交易所	美国	670	697,933.05	0.07
191	Coca-Cola Co/The	可口可乐	KO UN	纽约证券交易所	美国	1,992.00	696,315.57	0.06
192	Carlyle Group Inc/The	凯雷投资集团	CG UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,315.00	695,114.51	0.06
193	Affiliated Managers Group Inc	Affiliated Managers 集团股份有限公司	AMG UN	纽约证券交易所	美国	696	693,363.57	0.06
194	American Eagle Outfitters Inc	美国鹰牌服饰公司	AEO UN	纽约证券交易所	美国	2,858.00	692,915.11	0.06
195	O'Reilly Automotive Inc	O'Reilly 汽车股份有限公司	ORLY UW	纳斯达克证券交易所	美国	188	687,661.37	0.06
196	Morningstar Inc	晨星公司	MORN UW	纳斯达克证券交易所	美国	414	687,635.91	0.06
197	Diamondback	Diamondb	FANG UW	纳斯达克	美国	1,131.00	685,995.	0.06

	k Energy Inc	ack 能源股份有限公司		克 证 券 交 易 所			37	
198	Amphenol Corp	安费诺公司	APH UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,550.00	684,999.93	0.06
199	Medtronic PLC	美敦力	MDT UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	850	681,608.38	0.06
200	Cimarex Energy Co	Cimarex 能源公司	XEC UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,434.00	671,161.11	0.06
201	Snap Inc	Snap 股份有限公司	SNAP UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,524.00	670,851.41	0.06
202	Exxon Mobil Corp	埃克森美孚石油	XOM UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,646.00	670,750.12	0.06
203	Illinois Tool Works Inc	伊利诺伊工具	ITW UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	464	670,118.06	0.06
204	Corning Inc	康宁公司	GLW UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,530.00	668,471.77	0.06
205	IAC/InterActiveCorp	IAC/InterActiveCorp	IAC UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	667	664,301.06	0.06
206	ONEOK Inc	Oneok 股份有限公司	OKE UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,845.00	663,166.73	0.06
207	IQVIA Holdings Inc	IQVIA 控股股份有限公司	IQV UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	421	659,038.21	0.06
208	Moody's Corp	穆迪	MCO UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	281	657,805.95	0.06
209	At Home Group Inc	At Home 集团股份有限公司	HOME UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,762.00	657,328.61	0.06
210	Iron Mountain Inc	美国铁山公司	IRM UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,403.00	656,959.61	0.06
211	Cooper Cos Inc/The	库柏股份有限公司	COO UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	248	634,866.07	0.06

				所				
212	Jack in the Box Inc	Jack in the Box 公司	JACK UW	纳斯达克证券交易所	美国	880	633,523.92	0.06
213	Berry Global Group Inc	Berry 全球集团股份有限公司	BERY UN	纽约证券交易所	美国	1,499.00	631,570.26	0.06
214	Molina Healthcare Inc	Molina Healthcare 股份有限公司	MOH UN	纽约证券交易所	美国	385	629,395.27	0.06
215	Occidental Petroleum Corp	西方石油	OXY UN	纽约证券交易所	美国	3,114.00	629,050.82	0.06
216	Virtus Investment Partners Inc	维德思投资合伙人股份有限公司	VRTS UW	纳斯达克证券交易所	美国	347	622,664.43	0.06
217	Deckers Outdoor Corp	德克斯户外用品公司	DECK UN	纽约证券交易所	美国	250	620,282.65	0.06
218	Nordstrom Inc	诺德斯特龙公司	JWN UN	纽约证券交易所	美国	2,615.00	617,782.92	0.06
219	Western Digital Corp	西部数据公司	WDC UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,336.00	614,246.46	0.06
220	Teradata Corp	美商天睿信息系统有限公司	TDC UN	纽约证券交易所	美国	1,891.00	610,435.97	0.06
221	SLM Corp	SLM 公司	SLM UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,480.00	606,029.73	0.06
222	eBay Inc	eBay 公司	EBAY UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,333.00	604,600.31	0.06
223	Hilltop Holdings Inc	Hilltop 控股股份有限公司	HTH UN	纽约证券交易所	美国	2,545.00	598,450.74	0.06
224	Lincoln National Corp	林肯国民	LNC UN	纽约证券交易所	美国	1,474.00	598,374.26	0.06
225	Scientific	Scientif	SGMS UW	纳斯达克	美国	1,191.00	595,821.	0.06

	Games Corp	ic Games Corp		克证券交易所			74	
226	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	480	594,587.60	0.06
227	Gartner Inc	高德纳咨询股份有限公司	IT UN	纽约证券交易所	美国	379	592,997.13	0.06
228	Expeditors International of Washington Inc	华盛顿康捷国际物流公司	EXPD UW	纳斯达克证券交易所	美国	721	589,668.88	0.05
229	Sonos Inc	搜诺思	SONO UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,542.00	578,532.06	0.05
230	Wayfair Inc	Wayfair 股份有限公司	W UN	纽约证券交易所	美国	281	573,104.61	0.05
231	Hershey Co/The	好时食品	HSY UN	纽约证券交易所	美国	504	567,110.99	0.05
232	Invesco Ltd	景顺有限公司	IVZ UN	纽约证券交易所	美国	3,278.00	566,040.03	0.05
233	Callaway Golf Co	卡拉威高尔夫公司	ELY UN	纽约证券交易所	美国	2,596.00	565,666.25	0.05
234	Huntsman Corp	亨斯迈公司	HUN UN	纽约证券交易所	美国	3,301.00	565,533.43	0.05
235	ON Semiconductor Corp	安森美半导体公司	ON UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,284.00	564,816.36	0.05
236	TJX Cos Inc/The	TJX 公司	TJX UN	纽约证券交易所	美国	1,291.00	562,282.07	0.05
237	Ingersoll Rand Inc	英格索兰股份有限公司	IR UN	纽约证券交易所	美国	1,779.00	560,949.80	0.05
238	Charles Schwab Corp/The	嘉信理财	SCHW UN	纽约证券交易所	美国	1,166.00	548,439.62	0.05
239	Toro Co/T	托罗公司	TTC UN	纽约证	美国	767	544,444.	0.05

	he			券交易所			05	
240	Jabil Inc	捷普股份有限公司	JBL UN	纽约证券交易所	美国	1,439.00	540,288.40	0.05
241	KKR & Co Inc	KKR & Co 股份有限公司	KKR UN	纽约证券交易所	美国	1,406.00	538,071.03	0.05
242	EMCOR Group Inc	埃姆科集团公司	EME UN	纽约证券交易所	美国	670	533,199.21	0.05
243	Century Communities Inc	世纪社区有限公司	CCS UN	纽约证券交易所	美国	1,240.00	533,020.27	0.05
244	S&P Global Inc	标普全球	SPGI UN	纽约证券交易所	美国	201	532,961.16	0.05
245	B Riley Financial Inc	B Riley 金融公司	RILY UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,080.00	526,756.55	0.05
246	Resideo Technologies Inc	Resideo Technologies Inc	REZI UN	纽约证券交易所	美国	2,679.00	519,198.24	0.05
247	Kansas City Southern	Kansas City Southern	KSU UN	纽约证券交易所	美国	282	516,228.79	0.05
248	Gap Inc/The	Gap 股份有限公司	GPS UN	纽约证券交易所	美国	2,368.00	514,761.44	0.05
249	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	650	512,453.89	0.05
250	Comfort Systems USA Inc	美国舒适系统公司	FIX UN	纽约证券交易所	美国	1,006.00	512,045.23	0.05
251	Okta Inc	Okta Inc	OKTA UW	纳斯达克证券交易所	美国	323	510,552.30	0.05
252	Edwards Lifesciences Corp	爱德华生命科学公司	EW UN	纽约证券交易所	美国	760	508,495.14	0.05
253	NetApp Inc	网域存储	NTAP UW	纳斯达克	美国	962	508,479.	0.05

	c	技术		克 证 券 交 易 所			90	
254	CrowdStrike Holding s Inc	CrowdStrike 控 股 股 份 有 限 公 司	CRWD UN	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	313	508,151. 66	0.05
255	Envista Holdings Corp	Envista Holdin gs Corp	NVST UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,796.00	501,337. 09	0.05
256	TopBuild Corp	TopBuild 公司	BLD UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	391	499,572. 32	0.05
257	Westrock Co	WestRock 公司	WRK UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,444.00	496,456. 62	0.05
258	Molson Coors Bever age Co	莫尔森库 尔斯 饮 料 公 司	TAP UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,430.00	495,985. 16	0.05
259	Signature Bank/New York NY	Signatur e 银 行 / 纽 约	SBNY UN	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	311	493,533. 23	0.05
260	Chart Ind ustries I nc	查 特 工 业 公 司	GTLS UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	520	491,525. 75	0.05
261	AES Corp/ The	爱 伊 斯	AES UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,896.00	487,729. 28	0.05
262	Nexstar M edia Grou p Inc	Nexstar 媒 体 集 团 股 份 有 限 公 司	NXST UN	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	502	479,570. 43	0.04
263	Churchill Downs I nc	丘 吉 尔 唐 斯 股 份 有 限 公 司	CHDN UN	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	370	473,888. 39	0.04
264	Medpace H oldings I nc	Medpace 控 股 股 份 有 限 公 司	MEDP UN	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	414	472,393. 65	0.04
265	MasTec In c	MasTec 股 份 有 限 公 司	MTZ UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	686	470,195. 79	0.04
266	Tradeweb Markets I nc	Tradeweb Market s Inc	TW UN	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	855	467,057. 48	0.04
267	Walt Disn	华 特 迪 士	DIS UN	纽 约 证	美国	409	464,416.	0.04

	ey Co/The	尼公司		券交易 所			14	
268	Robert Half International Inc	罗致恒富国际公司	RHI UN	纽约证 券交易 所	美国	808	464,402. 12	0.04
269	Automatic Data Processing Inc	ADP 公司	ADP UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	358	459,351. 61	0.04
270	Red Rock Resorts Inc	红岩赌场度假村股份有限公司	RRR UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,663.00	456,583. 72	0.04
271	Dynatrace Inc	Dynatrace Inc	DT UN	纽约证 券交易 所	美国	1,196.00	451,369. 25	0.04
272	Five Below Inc	Five Below 股份有限公司	FIVE UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	361	450,724. 21	0.04
273	PPG Industries Inc	PPG 工业	PPG UN	纽约证 券交易 所	美国	408	447,466. 32	0.04
274	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	1,980.00	440,905. 70	0.04
275	Arcosa Inc	Arcosa Inc	ACA UN	纽约证 券交易 所	美国	1,156.00	438,663. 01	0.04
276	Vertiv Holdings Co	Vertiv Holdings Co	VRT UN	纽约证 券交易 所	美国	2,461.00	434,023. 76	0.04
277	Zendesk Inc	Zendesk 公司	ZEN UN	纽约证 券交易 所	美国	464	432,657. 19	0.04
278	Hess Corp	赫斯公司	HES UN	纽约证 券交易 所	美国	765	431,533. 39	0.04
279	Manhattan Associates Inc	曼哈顿联合软件公司	MANH UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	460	430,413. 21	0.04
280	Shopify Inc	Shopify 股份有限	SHOP UN	纽约证 券交易	美国	45	424,713. 46	0.04

		公司		所				
281	Floor & Decor Holdings Inc	Floor&Decor 控股股份有限公司	FND UN	纽约证券交易所	美国	619	422,673.36	0.04
282	Marathon Petroleum Corp	马拉松石油公司	MPC UN	纽约证券交易所	美国	1,073.00	418,812.55	0.04
283	Synaptics Inc	Synaptics 股份有限公司	SYNA UW	纳斯达克证券交易所	美国	415	417,100.88	0.04
284	DR Horton Inc	霍顿房屋公司	DHI UN	纽约证券交易所	美国	712	415,665.06	0.04
285	Pioneer Natural Resources Co	Pioneer 自然资源公司	PXD UN	纽约证券交易所	美国	393	412,608.91	0.04
286	Big Lots Inc	Big Lots 公司	BIG UN	纽约证券交易所	美国	965	411,506.11	0.04
287	Kinder Morgan Inc	特拉华州金德摩根公司	KMI UN	纽约证券交易所	美国	3,491.00	411,126.77	0.04
288	Emerson Electric Co	艾默生电气	EMR UN	纽约证券交易所	美国	661	410,956.94	0.04
289	PagerDuty Inc	PagerDuty Inc	PD UN	纽约证券交易所	美国	1,491.00	410,130.95	0.04
290	Darden Restaurants Inc	达登饭店	DRI UN	纽约证券交易所	美国	432	407,423.52	0.04
291	Vulcan Materials Co	Vulcan 材料	VMC UN	纽约证券交易所	美国	362	407,072.48	0.04
292	3M Co	3M 公司	MMM UN	纽约证券交易所	美国	317	406,764.78	0.04
293	Lincoln Electric Holdings Inc	林肯电气控股股份有限公司	LECO UW	纳斯达克证券交易所	美国	478	406,710.97	0.04
294	Boyd Gaming	波伊德博	BYD UN	纽约证	美国	1,023.00	406,367.	0.04

	ng Corp	彩公司		券交易所			87	
295	H&R Block Inc	H&R Block 公司	HRB UN	纽约证券交易所	美国	2,675.00	405,752.42	0.04
296	Wynn Resorts Ltd	永利渡假村有限公司	WYNN UW	纳斯达克证券交易所	美国	506	399,775.54	0.04
297	Alaska Air Group Inc	阿拉斯加航空集团公司	ALK UN	纽约证券交易所	美国	1,016.00	395,842.37	0.04
298	AMERCO	Amerco	UHAL UW	纳斯达克证券交易所	美国	103	392,181.04	0.04
299	Mattel Inc	美泰	MAT UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,016.00	391,621.60	0.04
300	Catalent Inc	康泰伦特股份有限公司	CTLT UN	纽约证券交易所	美国	558	389,744.03	0.04
301	Axon Enterprise Inc	Axon 企业股份有限公司	AXON UW	纳斯达克证券交易所	美国	336	383,760.95	0.04
302	SeaWorld Entertainment Inc	海洋世界娱乐股份有限公司	SEAS UN	纽约证券交易所	美国	1,170.00	377,462.35	0.04
303	Webster Financial Corp	韦伯斯特金融公司	WBS UN	纽约证券交易所	美国	1,095.00	377,317.00	0.04
304	Boeing Co /The	波音	BA UN	纽约证券交易所	美国	243	376,062.32	0.04
305	McAfee Corp	McAfee Corp	MCFE UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,075.00	375,599.90	0.04
306	DaVita Inc	DaVita 股份有限公司	DVA UN	纽约证券交易所	美国	482	374,991.10	0.03
307	Alcoa Corp	美国铝业公司	AA UN	纽约证券交易所	美国	1,554.00	369,836.59	0.03
308	MSCI Inc	MSCI 明晟	MSCI UN	纽约证券交易所	美国	107	368,481.26	0.03

309	Natera Inc	Natera 股份有限公司	NTRA UN	纳斯达克证券交易所	美国	502	368,174.41	0.03
310	Marathon Oil Corp	Marathon 石油公司	MRO UN	纽约证券交易所	美国	4,154.00	365,496.18	0.03
311	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	403	364,687.12	0.03
312	Regeneron Pharmaceuticals Inc	再生元制药股份有限公司	REGN UN	纳斯达克证券交易所	美国	101	364,430.65	0.03
313	Adient PLC	安道拓	ADNT UN	纽约证券交易所	美国	1,244.00	363,243.67	0.03
314	DXC Technology Co	DXC 技术公司	DXC UN	纽约证券交易所	美国	1,442.00	362,744.18	0.03
315	United Bankshares Inc/WV	United Bankshares 股份有限公司/WV	UBSI UN	纳斯达克证券交易所	美国	1,538.00	362,650.63	0.03
316	AMN Healthcare Services Inc	AMN 医疗服务股份有限公司	AMN UN	纽约证券交易所	美国	576	360,864.29	0.03
317	Bruker Corp	布鲁克公司	BRKR UN	纳斯达克证券交易所	美国	735	360,766.22	0.03
318	Omniceil Inc	Omniceil 股份有限公司	OMCL UN	纳斯达克证券交易所	美国	367	359,066.25	0.03
319	Marriott Vacations Worldwide Corp	万豪环球度假	VAC UN	纽约证券交易所	美国	348	358,124.69	0.03
320	NVR Inc	NVR 股份有限公司	NVR UN	纽约证券交易所	美国	11	353,408.17	0.03
321	Rent-A-Center Inc/TX	Rent-A-Center 公司	RCII UN	纳斯达克证券交易所	美国	1,024.00	351,065.61	0.03
322	Syneos Health	Syneos 健	SYNH UN	纳斯达克	美国	603	348,602.	0.03

	alth Inc	康公司		克 证 券 交 易 所			95	
323	Santander Consumer USA Holdings Inc	桑坦德消 费金融美 国控股股 份有限公 司	SC UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,474.00	345,845. 85	0.03
324	PDC Energy Inc	PDC 能源 股份有限 公司	PDCE UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,151.00	340,474. 98	0.03
325	Western Alliance Bancorp	Western Alliance Bancorp	WAL UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	559	335,299. 54	0.03
326	Foot Locker Inc	富乐客公 司	FL UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	841	334,832. 34	0.03
327	Cleveland-Cliffs Inc	Cleveland-Cliffs 股份有限 公司	CLF UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,400.00	334,271. 41	0.03
328	Avnet Inc	安富利股 份有限公 司	AVT UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,291.00	334,266. 76	0.03
329	PerkinElmer Inc	珀金埃尔 默	PKI UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	335	334,163. 85	0.03
330	First Citizens BancShares Inc/NC	第一公民 银行 (北 卡)	FCNCA UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	62	333,534. 19	0.03
331	Globus Medical Inc	Globus 医疗公司	GMED UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	664	332,565. 43	0.03
332	Landstar System Inc	Landstar 系统股份 有限公司	LSTR UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	325	331,768. 13	0.03
333	Steel Dynamics Inc	Steel Dynamics 股份有限 公司	STLD UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	861	331,503. 91	0.03
334	Trex Co Inc	Trex 公司	TREX UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	498	328,822. 84	0.03

335	CBRE Group Inc	世邦魏理仕	CBRE UN	纽约证券交易所	美国	592	327,864.03	0.03
336	Snap-on Inc	Snap-On 公司	SNA UN	纽约证券交易所	美国	227	327,647.29	0.03
337	SiteOne Landscape Supply Inc	SiteOne Landscape Supply 股份有限公司	SITE UN	纽约证券交易所	美国	299	326,937.52	0.03
338	Primerica Inc	Primerica 股份有限公司	PRI UN	纽约证券交易所	美国	330	326,468.91	0.03
339	GMS Inc	GMS 股份有限公司	GMS UN	纽约证券交易所	美国	1,049.00	326,227.69	0.03
340	Jones Lang LaSalle Inc	仲量联行	JLL UN	纽约证券交易所	美国	257	324,511.62	0.03
341	Pfizer Inc	辉瑞制药	PFE UN	纽约证券交易所	美国	1,278.00	323,305.27	0.03
342	Eagle Materials Inc	鹰牌材料有限公司	EXP UN	纽约证券交易所	美国	351	322,233.73	0.03
343	Albertsons Cos Inc	艾伯森股份有限公司	ACI UN	纽约证券交易所	美国	2,535.00	321,959.11	0.03
344	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	412	321,037.51	0.03
345	United Airlines Holdings Inc	美国联合航空控股股份有限公司	UAL UN	纳斯达克证券交易所	美国	949	320,632.21	0.03
346	Regency Centers Corp	Regency Centers 公司	REG UW	纳斯达克证券交易所	美国	774	320,357.52	0.03
347	Evercore Inc	Evercore 股份有限公司	EVR UN	纽约证券交易所	美国	351	319,195.29	0.03
348	Qurate Re	Qurate 零	QRTEA UW	纳斯达克	美国	3,743.00	316,518.	0.03

	tail Inc	售股份有 限公司		克证 券交 易所			22	
349	Norfolk Southern Corp	诺福克南 方	NSC UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	184	315,481. 83	0.03
350	Amcor PLC	Amcor P LC	AMCR UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	4,261.00	315,453. 53	0.03
351	Textron Inc	德事隆	TXT UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	707	314,092. 58	0.03
352	Huntington Ingalls Industries Inc	Huntingt on Inga lls 工 业公 司	HII UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	230	313,137. 20	0.03
353	FNB Corp/PA	FNB/宾州	FNB UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,914.00	311,761. 97	0.03
354	Middleby Corp/The	美得彼公 司	MIDD UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	278	311,158. 99	0.03
355	Ardagh Group SA	Ardagh 集 团股份公 司	ARD UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,954.00	309,516. 83	0.03
356	Terex Corp	特雷克斯 公司	TEX UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,006.00	309,475. 74	0.03
357	Rockwell Automation Inc	罗克韦尔 自动化	ROK UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	167	308,568. 87	0.03
358	Newell Brands Inc	纽威尔品 牌公司	NWL UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,735.00	307,891. 27	0.03
359	Altra Industrial Motion Corp	Altra I ndustria l Motio n 公 司	AIMC UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	729	306,206. 03	0.03
360	Truist Financial Corp	Truist 金 融公司	TFC UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	854	306,189. 36	0.03
361	Keysight Technologies Inc	是德科技 公司	KEYS UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	305	304,238. 73	0.03
362	Prudential	保德信金	PRU UN	纽 约 证	美国	458	303,180.	0.03

	Financial Inc	融集团		券交易所			63	
363	Rexnord Corp	莱克斯诺公司	RXN UN	纽约证券交易所	美国	937	302,897.81	0.03
364	Western Union Co/The	西联汇款	WU UN	纽约证券交易所	美国	2,040.00	302,712.53	0.03
365	Hartford Financial Services Group Inc/The	哈特福德金融服务	HIG UN	纽约证券交易所	美国	752	301,049.96	0.03
366	Pinnacle Financial Partners Inc	Pinnacle 财务合伙人股份有限公司	PNFP UW	纳斯达克证券交易所	美国	526	300,010.53	0.03
367	Granite Construction Inc	Granite 建筑公司	GVA UN	纽约证券交易所	美国	1,116.00	299,409.36	0.03
368	ViacomCBS Inc	维亚康姆哥伦比亚广播公司	VIAC UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,024.00	299,004.44	0.03
369	Hancock Whitney Corp	Hancock Whitney 公司	HWC UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,036.00	297,421.97	0.03
370	Investors Bancorp Inc	Investors Bancorp 股份公司	ISBC UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,221.00	296,721.82	0.03
371	Penumbra Inc	Penumbra 股份有限公司	PEN UN	纽约证券交易所	美国	167	295,665.99	0.03
372	Argo Group International Holdings Ltd	ARGO 集团国际控股有限公司	ARGO UN	纽约证券交易所	美国	882	295,317.40	0.03
373	Linde PLC	Linde PLC	LIN UN	纽约证券交易所	美国	158	295,083.16	0.03
374	Franklin Electric Co Inc	Franklin 电气有限公司	FELE UW	纳斯达克证券交易所	美国	566	294,780.31	0.03

375	Amkor Technology Inc	安靠技术公司	AMKR UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,922.00	293,894.11	0.03
376	Martin Marietta Materials Inc	Martin Marietta 材料股份有限公司	MLM UN	纽约证券交易所	美国	129	293,181.88	0.03
377	Popular Inc	Popular 股份有限公司	BPOP UW	纳斯达克证券交易所	美国	602	291,867.96	0.03
378	Parker-Hanfin Corp	派克汉尼汾	PH UN	纽约证券交易所	美国	147	291,642.31	0.03
379	Under Armour Inc	安德玛公司	UA UN	纽约证券交易所	美国	2,425.00	290,912.84	0.03
380	Eastman Chemical Co	伊士曼化工	EMN UN	纽约证券交易所	美国	384	289,619.20	0.03
381	Valley National Bancorp	Valley National Bancorp	VLY UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,330.00	288,907.95	0.03
382	Olympic Steel Inc	奥林匹克钢铁股份有限公司	ZEUS UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,518.00	288,211.03	0.03
383	La-Z-Boy Inc	La-Z-Boy 公司	LZB UN	纽约证券交易所	美国	1,202.00	287,617.09	0.03
384	Credit Acceptance Corp	Credit Acceptance 公司	CACC UW	纳斯达克证券交易所	美国	98	287,492.41	0.03
385	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	MACOM 技术解决方案控股股份有限公司	MTSI UW	纳斯达克证券交易所	美国	691	286,048.58	0.03
386	Capri Holdings Ltd	Capri 控股有限公司	CPRI UN	纽约证券交易所	美国	773	285,587.26	0.03
387	IHS Markit Ltd	IHS Markit 有限公司	INFO UN	纽约证券交易所	美国	391	284,567.79	0.03
388	Ameris Ba	Ameris	ABCB UW	纳斯达克	美国	868	283,900.	0.03

	ncorp	Bancorp		克 证 券 交 易 所			98	
389	Dover Corp	多佛	DOV UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	287	279,219. 73	0.03
390	Under Armour Inc	安德玛公司	UAA UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,036.00	278,180. 95	0.03
391	Magnolia Oil & Gas Corp	Magnolia Oil & Gas Corp	MGY UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,747.00	277,368. 33	0.03
392	Aptiv PLC	Aptiv 公 共 有 限 公 司	APTIV UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	272	276,451. 97	0.03
393	M&T Bank Corp	M&T 银 行	MTB UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	294	275,982. 84	0.03
394	MongoDB Inc	MongoDB Inc	MDB UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	118	275,583. 73	0.03
395	US Foods Holding Corp	美国食品 控股公司	USFD UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,101.00	272,838. 19	0.03
396	Ulta Beauty Inc	Ulta 美 容 产 品 公 司	ULTA UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	122	272,512. 47	0.03
397	Devon Energy Corp	戴文能源	DVN UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,442.00	271,918. 40	0.03
398	W R Grace & Co	格雷斯公司	GRA UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	606	270,592. 40	0.03
399	Home Banc Shares Inc/AR	阿 肯 色 Home Ba ncShares 公 司	HOMB UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,692.00	269,764. 47	0.03
400	Magna International Inc	麦格纳国际公司	MGA UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	446	266,914. 79	0.02
401	ConocoPhillips	康菲石油	COP UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	674	265,165. 14	0.02
402	Albemarle	雅保公司	ALB UN	纽 约 证	美国	243	264,449.	0.02

	Corp			券交易所			23	
403	Applied Industrial Technologies Inc	应用工业技术公司	AIT UN	纽约证券交易所	美国	449	264,127.26	0.02
404	PACCAR Inc	帕卡	PCAR UW	纳斯达克证券交易所	美国	449	258,877.20	0.02
405	Yum China Holdings Inc	百胜中国	YUMC UN	纽约证券交易所	美国	597	255,505.03	0.02
406	Laboratory Corp of America Holdings	美国实验控股	LH UN	纽约证券交易所	美国	143	254,828.66	0.02
407	Altair Engineering Inc	Altair Engineering Inc	ALTR UW	纳斯达克证券交易所	美国	565	251,737.50	0.02
408	Celanese Corp	塞拉尼斯公司	CE UN	纽约证券交易所	美国	257	251,693.25	0.02
409	News Corp	新闻集团	NWS UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,579.00	248,382.12	0.02
410	Summit Materials Inc	Summit 材料股份有限公司	SUM UN	纽约证券交易所	美国	1,103.00	248,323.34	0.02
411	PacWest Bancorp	西太平洋银行	PACW UW	纳斯达克证券交易所	美国	933	248,082.57	0.02
412	Comcast Corp	康卡斯特	CMCSA UW	纳斯达克证券交易所	美国	670	246,797.78	0.02
413	Halozyne Therapeutics Inc	Halozyne Therapeutics 股份有限公司	HALO UW	纳斯达克证券交易所	美国	839	246,123.29	0.02
414	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	102	246,077.48	0.02
415	Valero En	Valero	VLO UN	纽约证	美国	487	245,645.	0.02

	ergy Corp	能源		券交易所			04	
416	JetBlue Airways Corp	捷蓝航空公司	JBLU UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,264.00	245,418.68	0.02
417	Targa Resources Corp	Targa 资源公司	TRGP UN	纽约证券交易所	美国	854	245,227.33	0.02
418	Korn Ferry	光辉国际	KFY UN	纽约证券交易所	美国	523	245,119.77	0.02
419	Synovus Financial Corp	Synovus 金融	SNV UN	纽约证券交易所	美国	851	241,232.28	0.02
420	PTC Inc	PTC 公司	PTC UW	纳斯达克证券交易所	美国	264	240,914.18	0.02
421	United States Steel Corp	美国钢铁	X UN	纽约证券交易所	美国	1,549.00	240,160.68	0.02
422	Vicor Corp	Vicor 公司	VICR UW	纳斯达克证券交易所	美国	351	239,764.93	0.02
423	Carvana Co	Carvana 公司	CVNA UN	纽约证券交易所	美国	122	237,874.06	0.02
424	Pool Corp	Pool 公司	POOL UW	纳斯达克证券交易所	美国	79	234,076.17	0.02
425	Motorola Solutions Inc	摩托罗拉解决方案股份有限公司	MSI UN	纽约证券交易所	美国	166	232,544.87	0.02
426	Toll Brothers Inc	托尔兄弟公司	TOL UN	纽约证券交易所	美国	620	231,544.20	0.02
427	Owens & Minor Inc	Owens & Minor 公司	OMI UN	纽约证券交易所	美国	842	230,249.98	0.02
428	Phillips 66	Phillips 66	PSX UN	纽约证券交易所	美国	415	230,078.40	0.02
429	Autodesk Inc	欧特克	ADSK UW	纳斯达克证券交易所	美国	122	230,055.79	0.02

				交易所				
430	Children's Place Inc/The	Children's Place 股份有限公司	PLCE UW	纳斯达克证券交易所	美国	381	229,048.40	0.02
431	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	715	226,930.07	0.02
432	Citigroup Inc	花旗集团	C UN	纽约证券交易所	美国	496	226,697.83	0.02
433	MetLife Inc	大都会集团	MET UN	纽约证券交易所	美国	582	225,022.73	0.02
434	Bank of New York Mellon Corp/The	纽约梅隆银行股份有限公司	BK UN	纽约证券交易所	美国	678	224,384.73	0.02
435	OneMain Holdings Inc	OneMain 控股股份有限公司	OMF UN	纽约证券交易所	美国	578	223,700.21	0.02
436	Allegiant Travel Co	忠实旅游公司	ALGT UW	纳斯达克证券交易所	美国	178	223,080.17	0.02
437	T-Mobile US Inc	T-Mobile US 股份有限公司	TMUS UW	纳斯达克证券交易所	美国	238	222,676.68	0.02
438	Allstate Corp/The	全州保险	ALL UN	纽约证券交易所	美国	264	222,461.04	0.02
439	Novocure Ltd	Novocure 有限公司	NVCR UW	纳斯达克证券交易所	美国	155	222,111.80	0.02
440	Saia Inc	Saia 股份有限公司	SAIA UW	纳斯达克证券交易所	美国	164	221,945.52	0.02
441	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	479	221,836.67	0.02
442	Herman Miller Inc	赫曼米勒公司	MLHR UW	纳斯达克证券交易所	美国	728	221,697.19	0.02
443	Hilton Gr	希尔顿度	HGV UN	纽约证	美国	829	221,660.	0.02

	and Vacations Inc	假酒店集团		券交易所			95	
444	American Tower Corp	美国发射塔公司	AMT UN	纽约证券交易所	美国	127	221,631.69	0.02
445	LPL Financial Holdings Inc	LPL 金融控股公司	LPLA UW	纳斯达克证券交易所	美国	254	221,484.01	0.02
446	Southwest Airlines Co	西南航空	LUV UN	纽约证券交易所	美国	645	221,213.53	0.02
447	Principal Financial Group Inc	信安金融	PFG UW	纳斯达克证券交易所	美国	541	220,843.62	0.02
448	Schlumberger NV	斯伦贝谢公众有限公司	SLB UN	纽约证券交易所	美国	1,063.00	219,815.43	0.02
449	General Motors Co	通用汽车公司	GM UN	纽约证券交易所	美国	575	219,790.37	0.02
450	Avient Corp	Avient 公司	AVNT UN	纽约证券交易所	美国	690	219,129.18	0.02
451	Agios Pharmaceuticals Inc	Agios 制药公司	AGIO UW	纳斯达克证券交易所	美国	600	213,609.67	0.02
452	Regions Financial Corp	地区金融公司	RF UN	纽约证券交易所	美国	1,635.00	213,146.48	0.02
453	Method Electronics Inc	迈梭电子股份有限公司	MEI UN	纽约证券交易所	美国	669	212,676.12	0.02
454	Element Solutions Inc	Element 解决方案股份有限公司	ESI UN	纽约证券交易所	美国	1,404.00	212,056.14	0.02
455	CarMax Inc	CarMax 股份有限公司	KMX UN	纽约证券交易所	美国	254	211,917.77	0.02
456	EOG Resources Inc	EOG 资源	EOG UN	纽约证券交易所	美国	392	211,300.05	0.02
457	Urban Outfitters Inc	Urban Outfitters 公司	URBN UW	纳斯达克	美国	791	210,631.00	0.02

	fitters Inc	utfitters 公司		克 证 券 交 易 所			69	
458	BorgWarner Inc	博格华纳股份有限公司	BWA UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	671	210,407.65	0.02
459	Raymond James Financial Inc	Raymond James 金融股份有限公司	RJF UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	250	209,791.75	0.02
460	Blackstone Group Inc/The	Blackstone 集团股份有限公司	BX UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	334	209,596.39	0.02
461	Dave & Buster's Entertainment Inc	Dave & Buster's Entertainment 公司	PLAY UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	793	207,988.09	0.02
462	Intel Corp	英特尔	INTC UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	573	207,809.92	0.02
463	Citizens Financial Group Inc	公民金融集团	CFG UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	699	207,131.03	0.02
464	Cincinnati Financial Corp	辛辛那提金融	CINF UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	274	206,425.26	0.02
465	Insight Enterprises Inc	Insight 企业股份有限公司	NSIT UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	319	206,097.80	0.02
466	Comerica Inc	Comerica 公司	CMA UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	446	205,545.14	0.02
467	Alexion Pharmaceuticals Inc	亚力兄制药公司	ALXN UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	173	205,313.80	0.02
468	Honeywell International Inc	霍尼韦尔	HON UN	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	144	204,153.63	0.02
469	API Group Corp	API Group Corp	APG UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,508.00	203,506.85	0.02
470	Mueller W	穆勒水制	MWA UN	纽 约 证	美国	2,176.00	202,704.	0.02

	ater Prod ucts Inc	品有限公 司		券交易 所			50	
471	Vail Reso rts Inc	范尔度假 村管理公 司公司	MTN UN	纽约证 券交易 所	美国	99	202,430. 33	0.02
472	Athene Ho lding Ltd	Athene 控 股有限公 司	ATH UN	纽约证 券交易 所	美国	463	201,894. 28	0.02
473	Equitable Holdings Inc	Equitabl e 控股股 份有限公 司	EQH UN	纽约证 券交易 所	美国	1,023.00	201,234. 38	0.02
474	Bunge Ltd	邦吉有限 公司	BG UN	纽约证 券交易 所	美国	398	200,933. 01	0.02
475	Wintrust Financial Corp	Wintrust 金融公司	WTFC UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	410	200,316. 72	0.02
476	DISH Netw ork Corp	DISH 网络 公司	DISH UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	741	200,093. 85	0.02
477	CSX Corp	CSX 公司	CSX UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	963	199,572. 13	0.02
478	Five9 Inc	Five9 公 司	FIVN UQ	纳斯达 克证券 交易所	美国	168	199,032. 58	0.02
479	DENTSPLY SIRONA In c	登士柏西 诺德公司	XRAY UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	485	198,202. 97	0.02
480	Brighthou se Financi al Inc	Brighthou se 金融 股份有限 公司	BHF UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	673	197,991. 86	0.02
481	Sterling Bancorp/DE	Sterling 银行集团	STL UN	纽约证 券交易 所	美国	1,235.00	197,780. 16	0.02
482	Cathay Ge neral Ban corp	国泰万通 金控	CATY UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	774	196,804. 62	0.02
483	Simmons F irst Nati onal Corp	西蒙斯第 一国民公 司	SFNC UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,034.00	195,983. 67	0.02
484	Annaly Ca	Annaly	NLY UN	纽约证	美国	3,414.00	195,846.	0.02

	pital Management Inc	资本管理股份有限公司		券交易所			46	
485	Sanmina Corp	Sanmina 公司	SANM UW	纳斯达克证券交易所	美国	778	195,811.32	0.02
486	Lululemon Athletica Inc	Lululemon Athletica 股份有限公司	LULU UW	纳斯达克证券交易所	美国	83	195,692.64	0.02
487	Camping World Holdings Inc	Camping World 控股股份有限公司	CWH UN	纽约证券交易所	美国	739	195,686.83	0.02
488	Pacific Premier Bancorp Inc	太平洋第一合众银行	PPBI UW	纳斯达克证券交易所	美国	713	194,789.91	0.02
489	Alleghany Corp	Alleghany 公司	Y UN	纽约证券交易所	美国	45	193,920.25	0.02
490	Best Buy Co Inc	百思买	BBY UN	纽约证券交易所	美国	259	192,380.62	0.02
491	TTM Technologies Inc	TTM 科技股份有限公司	TTMI UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,080.00	192,149.21	0.02
492	Manulife Financial Corp	宏利金融	MFC UN	纽约证券交易所	美国	1,505.00	191,532.27	0.02
493	Upwork Inc	Upwork Inc	UPWK UW	纳斯达克证券交易所	美国	506	190,538.97	0.02
494	Cadence Bancorp	Cadence 银行	CADE UN	纽约证券交易所	美国	1,411.00	190,325.40	0.02
495	Valmont Industries Inc	维蒙特工业公司	VMI UN	纽约证券交易所	美国	124	189,088.42	0.02
496	SPX FLOW Inc	斯必克流体公司	FLOW UN	纽约证券交易所	美国	446	187,969.79	0.02
497	Zions Bancorp NA	ZB NA-用于基本面	ZION UW	纳斯达克证券交易所	美国	550	187,814.49	0.02

498	Dana Inc	德纳公司	DAN UN	纽约证 券交易 所	美国	1,219.00	187,106. 72	0.02
499	CNO Finan cial Grou p Inc	CNO 金融 集团公司	CNO UN	纽约证 券交易 所	美国	1,220.00	186,156. 83	0.02
500	Cognex Co rp	康耐视公 司	CGNX UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	340	184,610. 28	0.02
501	Brunswick Corp/DE	布伦兹威 克	BC UN	纽约证 券交易 所	美国	286	184,056. 78	0.02
502	UniFirst Corp/MA	UniFirst 公司 / 马 萨诸塞州	UNF UN	纽约证 券交易 所	美国	120	181,895. 74	0.02
503	American Airlines Group Inc	美国航空 集团公司	AAL UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,327.00	181,823. 84	0.02
504	Nielsen H oldings P LC	尼尔森控 股公开有 限公司	NLSN UN	纽约证 券交易 所	美国	1,137.00	181,204. 45	0.02
505	JELD-WEN Holding I nc	JELD-WEN 控股公司	JELD UN	纽约证 券交易 所	美国	1,057.00	179,311. 83	0.02
506	Group 1 Automotive Inc	第一汽车 集团公司	GPI UN	纽约证 券交易 所	美国	178	177,578. 72	0.02
507	Henry Sch ein Inc	亨利香恩 公司	HSIC UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	367	175,893. 86	0.02
508	Chewy Inc	Chewy 股 份有限公 司	CHWY UN	纽约证 券交易 所	美国	335	172,503. 08	0.02
509	Southern Copper Co rp	南方铜业 公司	SCCO UN	纽约证 券交易 所	美国	407	169,114. 05	0.02
510	ABM Indus tries Inc	ABM Ind ustries 公司	ABM UN	纽约证 券交易 所	美国	590	169,038. 21	0.02
511	Marriott Internatio nal Inc/M D	万豪国际	MAR UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	191	168,449. 17	0.02
512	Repligen	Repligen	RGEN UW	纳斯达	美国	129	166,353.	0.02

	Corp	公司		克 证 券 交 易 所			91	
513	Inspire Medical Systems Inc	Inspire Medical Systems Inc	INSP UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	133	166,047. 70	0.02
514	Insteel Industries Inc	Insteel 工业股份有限公司	IIIN UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	798	165,738. 39	0.02
515	Palo Alto Networks Inc	Palo Alto Networks 有限公司	PANW UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	69	165,394. 39	0.02
516	Polaris Inc	Polaris 股份有限公司	PII UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	183	161,913. 88	0.02
517	Masimo Corp	Masimo 公司	MASI UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	102	159,757. 63	0.01
518	Cloudflare Inc	Cloudflare Inc	NET UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	231	157,943. 24	0.01
519	Spirit Airlines Inc	Spirit 航空股份有限公司	SAVE UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	800	157,316. 36	0.01
520	Zillow Group Inc	Zillow 股份有限公司	Z UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	195	153,962. 92	0.01
521	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	106	152,245. 05	0.01
522	Arista Networks Inc	Arista 网络股份有限公司	ANET UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	65	152,136. 32	0.01
523	MercadoLibre Inc	MercadoLibre 股份有限公司	MELI UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	15	150,952. 19	0.01
524	AZEK Co Inc/The	AZEK Co Inc/The	AZEK UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	547	150,039. 83	0.01
525	AECOM	AECOM 公司	ACM UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	363	148,486. 43	0.01
526	Spotify T	Spotify	SPOT UN	纽 约 证	美国	83	147,768.	0.01

	technology SA	科技股份有限公司		券交易所			13	
527	Tenet Healthcare Corp	Tenet 医疗保健公司	THC UN	纽约证券交易所	美国	340	147,139.11	0.01
528	Activision Blizzard Inc	动视暴雪股份有限公司	ATVI UW	纳斯达克证券交易所	美国	236	145,506.26	0.01
529	Cardinal Health Inc	嘉德诺健康集团	CAH UN	纽约证券交易所	美国	390	143,834.77	0.01
530	SkyWest Inc	SkyWest 股份有限公司	SKYW UW	纳斯达克证券交易所	美国	515	143,291.80	0.01
531	iHeartMedia Inc	iHeartMedia 股份有限公司	IHRT UW	纳斯达克证券交易所	美国	823	143,177.72	0.01
532	Workday Inc	Workday 股份有限公司	WDAY UW	纳斯达克证券交易所	美国	90	138,805.58	0.01
533	VICI Properties Inc	VICI Properties Inc	VICI UN	纽约证券交易所	美国	681	136,467.16	0.01
534	Palantir Technologies Inc	Palantir 科技股份有限公司	PLTR UN	纽约证券交易所	美国	796	135,549.44	0.01
535	Discovery Inc	探索通信公司	DISCK UW	纳斯达克证券交易所	美国	716	134,045.01	0.01
536	Bill.com Holdings Inc	Bill.com Holdings Inc	BILL UN	纽约证券交易所	美国	113	133,719.81	0.01
537	Vertex Pharmaceuticals Inc	福泰制药	VRTX UW	纳斯达克证券交易所	美国	101	131,557.55	0.01
538	Dolby Laboratories Inc	杜比实验室有限公司	DLB UN	纽约证券交易所	美国	207	131,437.39	0.01
539	Extra Space Storage Inc	额外空间仓储公司	EXR UN	纽约证券交易所	美国	122	129,111.82	0.01
540	Skyline Champion Corp	Skyline Champion 公司	SKY UN	纽约证券交易所	美国	371	127,743.96	0.01

541	Incyte Corp	因赛特公司	INCY UW	纳斯达克证券交易所	美国	235	127,719.73	0.01
542	Trip.com Group Ltd	携程集团	TCOM UW	纳斯达克证券交易所	美国	546	125,075.03	0.01
543	Kimco Realty Corp	Kimco 房地产公司	KIM UN	纽约证券交易所	美国	907	122,166.63	0.01
544	PPD Inc	PPD Inc	PPD UW	纳斯达克证券交易所	美国	409	121,778.12	0.01
545	Pure Storage Inc	Pure 储存股份有限公司	PSTG UN	纽约证券交易所	美国	956	120,614.46	0.01
546	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	106	120,382.67	0.01
547	Yelp Inc	Yelp 公司	YELP UN	纽约证券交易所	美国	463	119,521.41	0.01
548	Scholastic Corp	Scholastic 公司	SCHL UW	纳斯达克证券交易所	美国	483	118,225.45	0.01
549	ArcBest Corp	Arkansas Best 公司	ARCB UW	纳斯达克证券交易所	美国	313	117,660.84	0.01
550	Matson Inc	美森公司	MATX UN	纽约证券交易所	美国	284	117,418.78	0.01
551	Safehold Inc	Safehold Inc	SAFE UN	纽约证券交易所	美国	230	116,637.11	0.01
552	Select Medical Holdings Corp	Select Medical 控股公司	SEM UN	纽约证券交易所	美国	426	116,299.63	0.01
553	ModivCare Inc	ModivCare 股份有限公司	MODV UW	纳斯达克证券交易所	美国	105	115,360.27	0.01
554	II-VI Inc	贰陆公司	IIVI UW	纳斯达克证券交易所	美国	246	115,358.91	0.01
555	Danaher C	丹纳赫	DHR UN	纽约证	美国	65	112,686.	0.01

	orp			券交易所			11	
556	NRG Energy Inc	NRG 能源股份有限公司	NRG UN	纽约证券交易所	美国	432	112,467.76	0.01
557	International Flavors & Fragrances Inc	国际香料	IFF UN	纽约证券交易所	美国	115	110,990.98	0.01
558	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	160	110,865.65	0.01
559	Assured Guaranty Ltd	美国保证担保有限公司	AGO UN	纽约证券交易所	美国	361	110,727.92	0.01
560	KBR Inc	KBR 股份有限公司	KBR UN	纽约证券交易所	美国	449	110,657.31	0.01
561	Lumen Technologies Inc	Lumen 科技股份有限公司	LUMN UN	纽约证券交易所	美国	1,259.00	110,531.08	0.01
562	Lions Gate Entertainment Corp	狮门娱乐公司	LGF/A UN	纽约证券交易所	美国	826	110,456.08	0.01
563	Centene Corp	Centene 公司	CNC UN	纽约证券交易所	美国	234	110,245.61	0.01
564	International Business Machines Corp	国际商业机器	IBM UN	纽约证券交易所	美国	116	109,850.38	0.01
565	Analog Devices Inc	亚德诺半导体	ADI UW	纳斯达克证券交易所	美国	98	108,992.74	0.01
566	Host Hotels & Resorts Inc	Host 酒店及度假股份有限公司	HST UW	纳斯达克证券交易所	美国	984	108,636.66	0.01
567	MSA Safety Inc	MSA Safety 有限公司	MSA UN	纽约证券交易所	美国	101	108,036.00	0.01

568	Virtu Financial Inc	Virtu 金融股份有限公司	VIRT UW	纳斯达克证券交易所	美国	604	107,809.51	0.01
569	Garmin Ltd	佳明有限公司	GRMN UW	纳斯达克证券交易所	美国	114	106,520.33	0.01
570	Donaldson Co Inc	唐纳森有限公司	DCI UN	纽约证券交易所	美国	259	106,296.23	0.01
571	Halliburton Co	哈利伯顿	HAL UN	纽约证券交易所	美国	710	106,043.83	0.01
572	Gates Industrial Corp PLC	Gates Industrial Corp PLC	GTES UN	纽约证券交易所	美国	908	105,994.48	0.01
573	Crown Castle International Corp	冠城国际公司	CCI UN	纽约证券交易所	美国	84	105,870.70	0.01
574	CNA Financial Corp	CNA 金融公司	CNA UN	纽约证券交易所	美国	360	105,793.18	0.01
575	ASGN Inc	ASGN 股份有限公司	ASGN UN	纽约证券交易所	美国	168	105,197.82	0.01
576	HEICO Corp	海科航空公司	HEI/A UN	纽约证券交易所	美国	131	105,090.19	0.01
577	Peloton Interactive Inc	Peloton Interactive Inc	PTON UW	纳斯达克证券交易所	美国	131	104,954.79	0.01
578	General Dynamics Corp	通用动力	GD UN	纽约证券交易所	美国	86	104,591.34	0.01
579	First Horizon Corp	第一线国民银行	FHN UN	纽约证券交易所	美国	925	103,258.24	0.01
580	Brink's Co/The	Brink's 公司	BCO UN	纽约证券交易所	美国	208	103,249.97	0.01
581	Weingarten Realty	Weingarten 房地产	WRI UN	纽约证券交易所	美国	496	102,759.00	0.01

	Investors	投资者公司		所				
582	HNI Corp	HNI 公司	HNI UN	纽约证券交易所	美国	361	102,542.27	0.01
583	Raytheon Technologies Corp	雷神技术公司	RTX UN	纽约证券交易所	美国	186	102,506.67	0.01
584	NCR Corp	NCR 公司	NCR UN	纽约证券交易所	美国	347	102,241.87	0.01
585	Onto Innovation Inc	Onto 创新股份有限公司	ONTO UN	纽约证券交易所	美国	215	101,446.83	0.01
586	AmerisourceBergen Corp	美源伯根	ABC UN	纽约证券交易所	美国	137	101,327.51	0.01
587	Ryder System Inc	莱德系统股份有限公司	R UN	纽约证券交易所	美国	211	101,317.82	0.01
588	KeyCorp	KeyCorp 公司	KEY UN	纽约证券交易所	美国	755	100,717.80	0.01
589	Bank OZK	欧扎克银行	OZK UW	纳斯达克证券交易所	美国	368	100,227.68	0.01
590	Hanesbrands Inc	汉佰有限公司	HBI UN	纽约证券交易所	美国	830	100,106.36	0.01
591	Bio-Rad Laboratories Inc	伯乐生命科学产品有限公司	BIO UN	纽约证券交易所	美国	24	99,892.27	0.01
592	Alnylam Pharmaceuticals Inc	Alnylam 制药股份有限公司	ALNY UW	纳斯达克证券交易所	美国	91	99,655.57	0.01
593	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴巴	BABA UN	纽约证券交易所	美国	68	99,621.46	0.01
594	American Financial Group Inc/OH	美国金融集团公司 / 俄亥俄州	AFG UN	纽约证券交易所	美国	123	99,101.55	0.01
595	Boston Beer Co Inc	波士顿啤酒公司	SAM UN	纽约证券交易所	美国	15	98,917.05	0.01

	c/The			所				
596	VMware Inc	VMware 公司	VMW UN	纽约证券交易所	美国	95	98,175.11	0.01
597	Cigna Corp	信诺集团	CI UN	纽约证券交易所	美国	64	98,015.74	0.01
598	Howard Hughes Corp /The	霍华德休斯公司	HHC UN	纽约证券交易所	美国	155	97,588.21	0.01
599	Beacon Roofing Supply Inc	Beacon Roofing Supply 股份有限公司	BECN UW	纳斯达克证券交易所	美国	283	97,352.09	0.01
600	Carnival Corp	嘉年华公司	CCL UN	纽约证券交易所	美国	569	96,894.01	0.01
601	Hub Group Inc	中心集团	HUBG UW	纳斯达克证券交易所	美国	227	96,755.89	0.01
602	Tyler Technologies Inc	Tyler 科技公司	TYL UN	纽约证券交易所	美国	33	96,437.73	0.01
603	Hawaiian Holdings Inc	夏威夷控股有限公司	HA UW	纳斯达克证券交易所	美国	610	96,033.91	0.01
604	Sensata Technologies Holding PLC	Sensata Technologies Holding PLC	ST UN	纽约证券交易所	美国	256	95,869.95	0.01
605	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	170	95,182.47	0.01
606	BOK Financial Corp	BOK 金融公司	BOKF UW	纳斯达克证券交易所	美国	169	94,546.15	0.01
607	Glaukos Corp	Glaukos 公司	GKOS UN	纽约证券交易所	美国	172	94,257.77	0.01
608	Citi Trends Inc	Citi Trends 股份有限公司	CTRN UW	纳斯达克证券交易所	美国	167	93,858.79	0.01

609	Northern Trust Corp	北美信托	NTRS UW	纳斯达克证券交易所	美国	125	93,364.60	0.01
610	AMC Networks Inc	AMC 网络公司	AMCX UW	纳斯达克证券交易所	美国	210	90,622.28	0.01
611	Xerox Holdings Corp	Xerox Holdings Corp	XRX UN	纽约证券交易所	美国	591	89,682.92	0.01
612	Triumph Bancorp Inc	Triumph 银行股份有限公司	TBK UW	纳斯达克证券交易所	美国	186	89,217.21	0.01
613	Nuance Communications Inc	Nuance 通讯股份有限公司	NUAN UW	纳斯达克证券交易所	美国	252	88,625.34	0.01
614	Lazard Ltd	Lazard 有限公司	LAZ UN	纽约证券交易所	美国	303	88,572.82	0.01
615	Rambus Inc	Rambus 股份有限公司	RMBS UW	纳斯达克证券交易所	美国	577	88,378.50	0.01
616	Fox Corp	福克斯公司	FOXA UW	纳斯达克证券交易所	美国	363	87,070.46	0.01
617	Pilgrim's Pride Corp	Pilgrim's Pride 公司	PPC UW	纳斯达克证券交易所	美国	604	86,544.15	0.01
618	Intercontinental Exchange Inc	洲际交易所 (ICE)	ICE UN	纽约证券交易所	美国	111	85,116.34	0.01
619	BlackRock Inc	贝莱德有限公司	BLK UN	纽约证券交易所	美国	15	84,785.91	0.01
620	Glacier Bancorp Inc	冰川万通金控	GBCI UW	纳斯达克证券交易所	美国	236	83,974.06	0.01
621	Quest Diagnostics Inc	Quest Diagnostics 股份有限公司	DGX UN	纽约证券交易所	美国	98	83,548.86	0.01
622	Hillenbrand Inc	Hillenbrand 公司	HI UN	纽约证券交易所	美国	292	83,150.27	0.01

623	Translate Bio Inc	Translate Bio Inc	TBIO UW	纳斯达克证券交易所	美国	459	81,661.22	0.01
624	Ross Stores Inc	Ross 商店有限公司	ROST UW	纳斯达克证券交易所	美国	101	80,906.29	0.01
625	Sony Group Corp	索尼集团公司	SONY UN	纽约证券交易所	美国	128	80,390.52	0.01
626	Global Industrial Co	Global Industrial 公司	GIC UN	纽约证券交易所	美国	337	79,919.64	0.01
627	Asbury Automotive Group Inc	阿斯伯里汽车集团公司	ABG UN	纽约证券交易所	美国	70	77,494.71	0.01
628	Dow Inc	Dow Inc	DOW UN	纽约证券交易所	美国	185	75,627.10	0.01
629	Plexus Corp	Plexus 有限公司	PLXS UW	纳斯达克证券交易所	美国	128	75,586.27	0.01
630	Boise Cascade Co	Boise Cascade 公司	BCC UN	纽约证券交易所	美国	198	74,635.47	0.01
631	Lockheed Martin Corp	洛克希德马丁	LMT UN	纽约证券交易所	美国	30	73,325.37	0.01
632	Vishay Intertechnology Inc	威世公司	VSH UN	纽约证券交易所	美国	499	72,691.95	0.01
633	Nevro Corp	Nevro 公司	NVRO UN	纽约证券交易所	美国	65	69,616.30	0.01
634	Monster Beverage Corp	怪兽饮料公司	MNST UW	纳斯达克证券交易所	美国	116	68,455.10	0.01
635	Digital Turbine Inc	Digital Turbine 股份有限公司	APPS UR	纳斯达克证券交易所	美国	138	67,780.27	0.01
636	PennyMac Financial Services Inc	PennyMac Financial Services I	PFSI UN	纽约证券交易所	美国	166	66,187.08	0.01

		nc						
637	Cerence Inc	Cerence Inc	CRNC UW	纳斯达克证券交易所	美国	94	64,799.58	0.01
638	BankUnited Inc	BankUnited 公司	BKU UN	纽约证券交易所	美国	231	63,705.57	0.01
639	Twist Bioscience Corp	Twist Bioscience Corp	TWST UW	纳斯达克证券交易所	美国	74	63,699.82	0.01
640	TripAdvisor Inc	猫途鹰股份有限公司	TRIP UW	纳斯达克证券交易所	美国	242	63,002.77	0.01
641	EW Scripps Co/The	E.W. Scripps 公司	SSP UW	纳斯达克证券交易所	美国	444	58,484.32	0.01
642	MicroStrategy Inc	微策略公司	MSTR UW	纳斯达克证券交易所	美国	13	55,805.57	0.01
643	10X Genomics Inc	10X Genomics Inc	TXG UW	纳斯达克证券交易所	美国	43	54,395.72	0.01
644	Pinterest Inc	Pinterest 股份有限公司	PINS UN	纽约证券交易所	美国	106	54,062.64	0.01
645	ANSYS Inc	ANSYS 股份有限公司	ANSS UW	纳斯达克证券交易所	美国	24	53,809.02	0.01
646	Zynga Inc	Zynga 股份有限公司	ZNGA UW	纳斯达克证券交易所	美国	778	53,425.93	0.00
647	McDonald's Corp	麦当劳	MCD UN	纽约证券交易所	美国	35	52,227.65	0.00
648	IPG Photonics Corp	IPG 光子公司	IPGP UW	纳斯达克证券交易所	美国	37	50,379.03	0.00
649	Iovance Biopharmaceuticals Inc	Iovance 生物医疗股份有限公司	IOVA UQ	纳斯达克证券交易所	美国	297	49,923.27	0.00
650	Las Vegas Sands Corp	拉斯维加斯金沙集团	LVS UN	纽约证券交易所	美国	145	49,355.49	0.00

651	Container Store Group Inc/The	Container Store 集团股份有限公司	TCS UN	纽约证券交易所	美国	570	48,016.63	0.00
652	Covetrus Inc	Covetrus Inc	CVET UW	纳斯达克证券交易所	美国	272	47,442.97	0.00
653	Smartsheet Inc	Smartsheet Inc	SMAR UN	纽约证券交易所	美国	101	47,186.64	0.00
654	Dollar General Corp	达乐公司	DG UN	纽约证券交易所	美国	33	46,130.73	0.00
655	Cinemark Holdings Inc	喜满客控股公司	CNK UN	纽约证券交易所	美国	304	43,106.96	0.00
656	New Relic Inc	New Relic 股份有限公司	NEWR UN	纽约证券交易所	美国	98	42,398.02	0.00
657	LendingClub Corp	LendingClub 公司	LC UN	纽约证券交易所	美国	350	40,992.56	0.00
658	Colgate-Palmolive Co	高露洁棕榄	CL UN	纽约证券交易所	美国	77	40,465.74	0.00
659	Goodyear Tire & Rubber Co/The	固特异轮胎橡胶	GT UW	纳斯达克证券交易所	美国	322	35,674.61	0.00
660	Chemed Corp	Chemed 公司	CHE UN	纽约证券交易所	美国	11	33,718.49	0.00
661	Altice USA Inc	美国 Altice 公司	ATUS UN	纽约证券交易所	美国	151	33,302.72	0.00
662	Groupon Inc	Groupon 股份有限公司	GRPN UW	纳斯达克证券交易所	美国	118	32,900.51	0.00
663	Magnite Inc	Magnite 股份有限公司	MGNI UW	纳斯达克证券交易所	美国	134	29,293.71	0.00
664	Fulgent Genetics Inc	Fulgent Genetics Inc	FLGT UQ	纳斯达克证券交易所	美国	49	29,194.94	0.00

665	ABIOMED Inc	Abiomed 股份有限公司	ABMD UW	纳斯达克证券交易所	美国	13	26,211.40	0.00
666	Teleflex Inc	泰利福公司	TFX UN	纽约证券交易所	美国	10	25,956.04	0.00
667	Aspen Technology Inc	艾斯本科技公司	AZPN UW	纳斯达克证券交易所	美国	29	25,767.14	0.00
668	Encompass Health Corp	南方保健公司	EHC UN	纽约证券交易所	美国	47	23,691.84	0.00
669	Elastic NV	Elastic NV	ESTC UN	纽约证券交易所	美国	22	20,715.73	0.00
670	Coupa Software Inc	Coupa 软件股份有限公司	COUP UW	纳斯达克证券交易所	美国	12	20,319.08	0.00
671	QIAGEN NV	德国 QIAGEN 公共有限公司	QGEN UN	纽约证券交易所	美国	64	20,002.54	0.00
672	Silvergate Capital Corp	Silvergate Capital Corp	SI UN	纽约证券交易所	美国	27	19,765.58	0.00
673	RingCentral Inc	RingCentral 股份有限公司	RNG UN	纽约证券交易所	美国	8	15,017.41	0.00
674	Sage Therapeutics Inc	Sage Therapeutics 公司	SAGE UQ	纳斯达克证券交易所	美国	38	13,945.93	0.00
675	Fair Isaac Corp	费埃哲公司	FICO UN	纽约证券交易所	美国	4	12,989.45	0.00
676	Chegg Inc	Chegg 股份有限公司	CHGG UN	纽约证券交易所	美国	20	10,737.98	0.00
677	FMC Corp	FMC 公司	FMC UN	纽约证券交易所	美国	12	8,387.79	0.00
678	Invitae Corp	Invitae 公司	NVTA UN	纽约证券交易所	美国	34	7,408.57	0.00

679	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	21	6,648.80	0.00
680	StoneCo Ltd	StoneCo Ltd	STNE UW	纳斯达克证券交易所	美国	6	2,599.29	0.00
681	WEX Inc	WEX 股份有限公司	WEX UN	纽约证券交易所	美国	1	1,252.61	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“Apple Inc”市值占净值比例被动超过 10%，已于 2021 年 7 月 21 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	Apple Inc	AAPL UW	6,634,077.06	0.63
2	Microsoft Corp	MSFT UW	3,897,286.72	0.37
3	Facebook Inc	FB UW	3,696,809.26	0.35
4	Eli Lilly & Co	LLY UN	3,201,190.66	0.31
5	Alphabet Inc	GOOGL UW	2,544,164.59	0.24
6	Oracle Corp	ORCL UN	2,461,960.95	0.24
7	Capital One Financial Corp	COF UN	2,395,894.60	0.23
8	UnitedHealth Group Inc	UNH UN	2,379,673.65	0.23
9	NVIDIA Corp	NVDA UW	2,090,651.96	0.20
10	Wells Fargo & Co	WFC UN	1,941,149.60	0.19
11	Expedia Group Inc	EXPE UW	1,928,679.15	0.18
12	Simon Property Group Inc	SPG UN	1,912,926.68	0.18
13	Ford Motor Co	F UN	1,898,089.61	0.18
14	eBay Inc	EBAY UW	1,855,414.45	0.18
15	L Brands Inc	LB UN	1,558,467.94	0.15
16	Mastercard Inc	MA UN	1,535,304.66	0.15
17	Zoom Video Communications Inc	ZM UW	1,513,194.40	0.14
18	Fortinet Inc	FTNT UW	1,432,136.22	0.14
19	Advanced Micro	AMD UR	1,423,681.51	0.14

	Devices Inc			
20	Home Depot Inc/Target	HD UN	1,377,977.93	0.13

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	Amazon.com Inc	AMZN UW	10,954,275.31	1.05
2	Tesla Inc	TSLA UW	7,985,844.51	0.76
3	UnitedHealth Group Inc	UNH UN	7,548,257.54	0.72
4	QUALCOMM Inc	QCOM UW	5,417,971.31	0.52
5	NIKE Inc	NKE UN	5,344,874.84	0.51
6	NVIDIA Corp	NVDA UW	5,297,952.68	0.51
7	Square Inc	SQ UN	5,080,567.99	0.49
8	Microsoft Corp	MSFT UW	4,897,401.06	0.47
9	Adobe Inc	ADBE UW	4,809,266.87	0.46
10	Costco Wholesale Corp	COST UW	4,779,071.11	0.46
11	ServiceNow Inc	NOW UN	4,562,510.46	0.44
12	Netflix Inc	NFLX UW	4,474,217.57	0.43
13	Facebook Inc	FB UW	4,467,637.54	0.43
14	salesforce.com Inc	CRM UN	4,207,516.30	0.40
15	Procter & Gamble Co/Ther	PG UN	4,103,482.39	0.39
16	Apple Inc	AAPL UW	4,087,298.52	0.39
17	Thermo Fisher Scientific Inc	TMO UN	3,714,234.54	0.35
18	Advanced Micro Devices Inc	AMD UR	3,686,853.50	0.35
19	Charter Communications Inc	CHTR UW	3,619,116.39	0.35
20	United Parcel Service Inc	UPS UN	3,299,926.64	0.32

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	247,835,886.76
卖出收入 (成交) 总额	324,345,602.73

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	ARK Innovation ETF	ETF	交易型开放式	ARK Investment Management LLC	1,144,774.29	0.11
2	ARK Fintech Innovation ETF	ETF	交易型开放式	ARK Investment Management LLC	458,267.93	0.04
3	iShares 20+ Year Treasury Bond ETF	ETF	交易型开放	BlackRock Fund Advisors	149,202.47	0.01

			式			
4	ARK Next Generation Internet ETF	ETF	交易型开放式	ARK Investment Management LLC	106,497.91	0.01
5	VanEck Vectors Gold Miners ETF	ETF	交易型开放式	Van Eck Associates Corp	94,391.11	0.01
6	ARK Autonomous Technology & Robotics ETF	ETF	交易型开放式	ARK Investment Management LLC	72,957.20	0.01
7	SPDR Gold Shares	ETF	交易型开放式	World Gold Trust Services LLC	58,849.25	0.01
8	iPath Series B S&P 500 VIX Short-Term Futures ETN	ETN	交易型开放式	Barclays Capital Inc	9,515.73	-

注：报告期末，本基金仅持有上述 8 支基金。

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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

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	应收证券清算款	6,120,329.69
3	应收股利	251,924.40
4	应收利息	4,261.91
5	应收申购款	7,542,150.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,918,666.82

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	215,161	1,513.72	616,371.75	0.19	325,076,235.61	99.81

基金-人民币						
嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇	500	8,878.03	-	-	4,439,015.12	100.00
合计	215,607	1,531.17	616,371.75	0.19	329,515,250.73	99.81

注：(1) 嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币：机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币份额占嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币总份额比例、个人投资者持有嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币份额占嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币总份额比例；

(2) 嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇：机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇份额占嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇总份额比例、个人投资者持有嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇份额占嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇总份额比例。

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	嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币	31,513.32	0.01
	嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇	-	-

有本基金			
	合计	31,513.32	0.01

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
	嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币	0
	嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇	0
	合计	0

§ 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	357,757,773.39	3,485,329.90
本报告期基金总申购份额	193,659,003.99	1,499,161.36
减：本报告期基金总赎回份额	225,724,170.02	545,476.14
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	325,692,607.36	4,439,015.12

§ 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

2021 年 5 月 29 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，杨竞霜先生任公司副总经理、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

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(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

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
野村证券 NOMURA	-	329,855,377.02	57.99%	235,025.00	85.72%	-
瑞士信贷（香港）有限公司 Credit Suisse	-	238,963,264	42.0	39,153.	14.2	-

(Hong Kong) Limited		.82	1%	10	8%	
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	-	-	-	-	-	-
瑞银集团 Union Bank of Switzerland	-	-	-	-	-	-
中信证券国际有限公司 CITIC Securities International Company Limited	-	-	-	-	-	-

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) 研究能力较强；

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

3. 报告期内，本基金新增以下交易单元：

- (1) 野村证券 NOMURA。

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	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	-	-	-	-	-	5,893,755.24	68.81%
瑞士信贷（香港）有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	2,671,448.21	31.19%
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	-	-	-	-	-	-	-
瑞银集团 Union Bank of Switzerland	-	-	-	-	-	-	-
中信证券国际有限公司 CITIC Securities International Company Limited	-	-	-	-	-	-	-

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）2021 年 1 月 18 日暂停申购、赎回及定投业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 01 月 14 日
2	关于嘉实美国成长股票（QDII）2021 年 4 月 2 日暂停申购、赎回及定投业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 31 日
3	嘉实基金管理有限公司关于终止凤凰金信（银川）基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	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	2021 年 05 月 07 日
4	关于嘉实美国成长股票（QDII）2021 年 5 月 31 日暂停申购、赎回及定投业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 05 月 27 日

5	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 05 月 29 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

2021 年 8 月 27 日