

# 嘉实美国成长股票型证券投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 03 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	11
3.4 过去三年基金的利润分配情况	11
<b>§4 管理人报告</b>	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	16
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
<b>§5 托管人报告</b>	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
<b>§6 审计报告</b>	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
<b>§7 年度财务报表</b>	<b>19</b>
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20

7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	23
<b>§8 投资组合报告 .....</b>	<b>50</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	50
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 .....	50
8.3 期末按行业分类的权益投资组合 .....	50
8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 .....	51
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动 .....	189
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....	190
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 .....	191
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 .....	191
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 .....	191
8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....	191
8.11 投资组合报告附注.....	192
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>193</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	193
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	194
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	195
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>195</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>195</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	195
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	196
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	196
11.4 基金投资策略的改变.....	196
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	196
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	196
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	196
11.8 其他重大事件.....	198
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>199</b>
12.1 备查文件目录.....	199
12.2 存放地点.....	199
12.3 查阅方式.....	199

## § 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	493,403,549.83 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	488,500,747.66 份	4,902,802.17 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	010-66596688
	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 境外投资顾问和境外资产托管人

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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a>
基金年度报告备置地点	北京市朝阳区建国门外大街21号北京国际俱乐部C座写字楼12A层嘉实基金管理有限公司

## 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼
注册登记机构	嘉实基金管理有限公司	北京市朝阳区建国门外大街21号北京国际俱乐部C座写字楼12A层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1	报告期(2021年1月1日-2021年12月31日)	报告期(2020年1月1日-2020年12月31日)	报告期(2019年1月1日-2019年12月31日)
1 期间数据和			

指标						
	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	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	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	73,231,158.63	5,835,543.80	60,328,922.02	3,447,194.89	11,018,861.08	1,197,356.79
本期利润	205,539,509.02	17,389,003.43	240,302,644.30	11,572,962.71	124,373,284.55	12,250,650.46
加权平均基金份额本期利润	0.5960	3.7959	0.6707	3.1570	0.5078	3.0500
本期加权平均净值利润率	19.49%	20.24%	27.91%	21.72%	26.03%	25.53%
本期基金份额净值增长率	22.45%	25.29%	26.93%	35.75%	29.76%	27.48%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
期末可供分配利润	328,137,384.25	23,805,681.19	161,551,067.79	12,249,036.00	70,006,127.58	9,850,888.27
期末可供分配基金份额	0.6717	4.8555	0.4516	3.5145	0.2873	2.5142

利润						
期末基金资产净值	1,652,264,609.89	101,112,998.99	988,053,266.39	58,716,221.41	530,314,760.53	51,986,247.24
期末基金份额净值	3.382	3.235	2.762	2.582	2.176	1.902
3.1.3 累计期末指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
基金份额累计净值增长率	238.20%	223.50%	176.20%	158.20%	117.60%	90.20%

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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	9.77%	1.12%	10.87%	1.06%	-1.10%	0.06%



过去六个月	11.18%	0.97%	11.91%	0.89%	-0.73%	0.08%
过去一年	22.45%	1.13%	25.28%	1.01%	-2.83%	0.12%
过去三年	101.67%	1.46%	125.21%	1.44%	-23.54%	0.02%
过去五年	137.00%	1.30%	178.32%	1.25%	-41.32%	0.05%
自基金合同生效起 至今	238.20%	1.13%	288.25%	1.09%	-50.05%	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
过去三个月	11.63%	1.13%	10.87%	1.06%	0.76%	0.07%
过去六个月	12.68%	0.96%	11.91%	0.89%	0.77%	0.07%
过去一年	25.29%	1.09%	25.28%	1.01%	0.01%	0.08%
过去三年	116.82%	1.44%	125.21%	1.44%	-8.39%	0.00%
过去五年	156.34%	1.28%	178.32%	1.25%	-21.98%	0.03%
自基金合同生效起 至今	223.50%	1.11%	288.25%	1.09%	-64.75%	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：

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

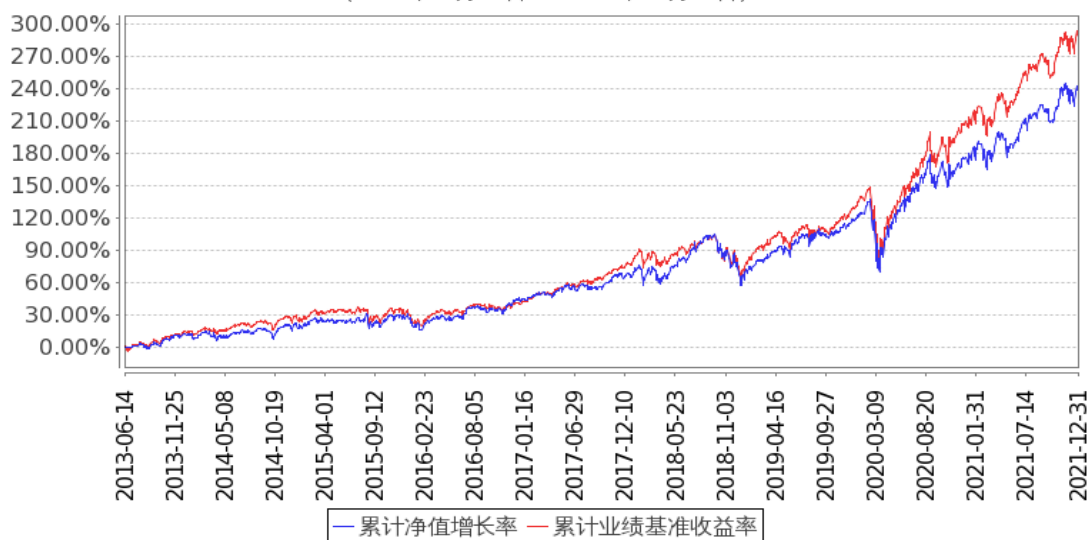
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

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

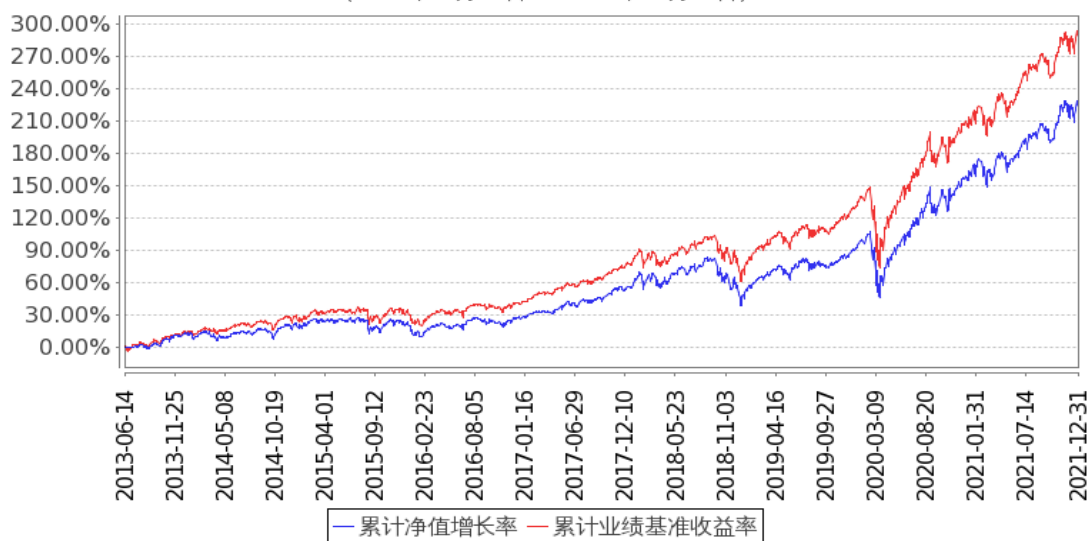
#### 嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013年06月14日至2021年12月31日)



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

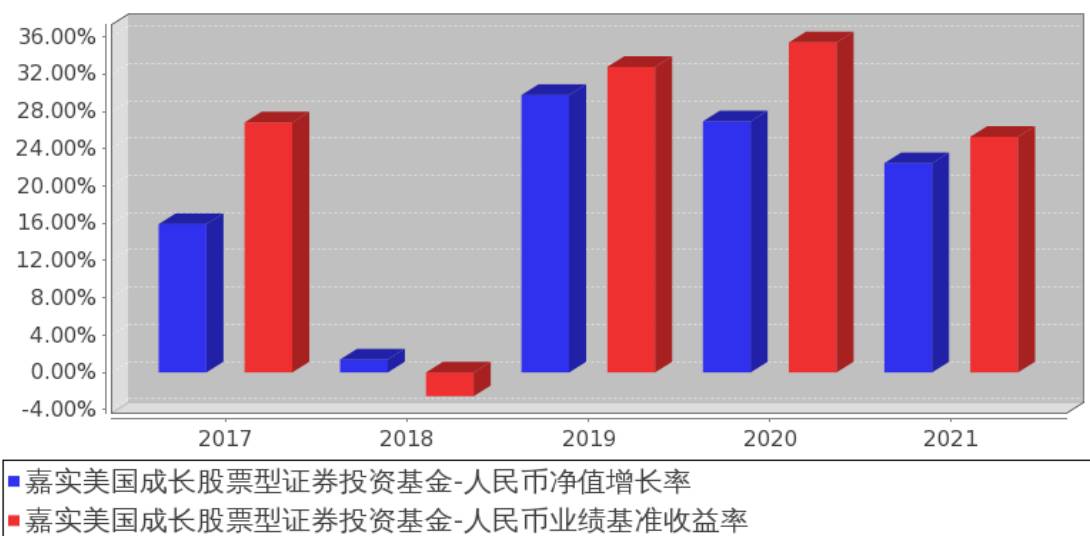
(2013年06月14日至2021年12月31日)



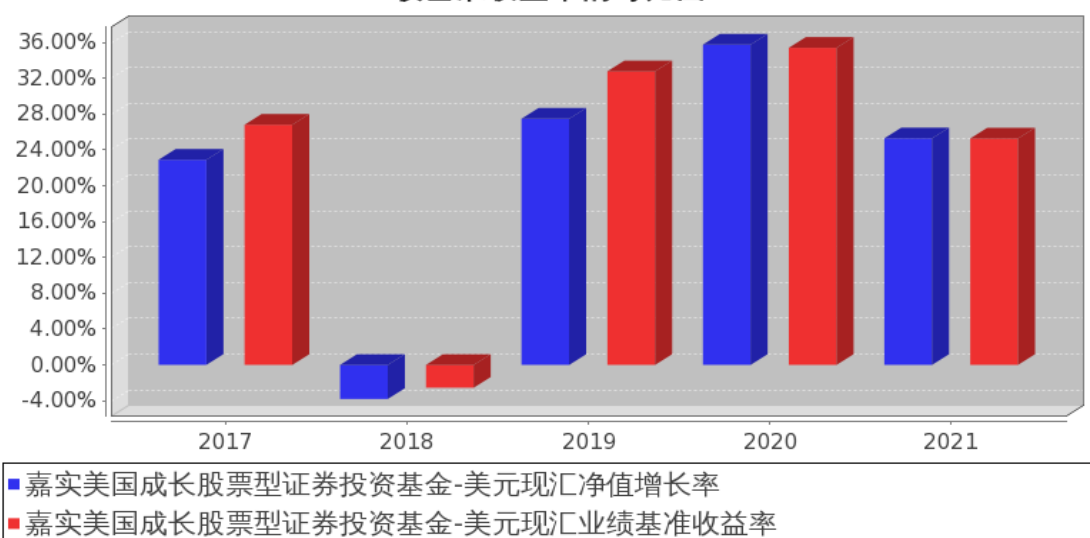
注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

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

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



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



注：上述数据根据基金当年实际存续期计算。

### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止2021年12月31日，基金管理人共管理258只开放式证券投资基金，覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF等不同类别。同时，还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张自力	本基金、嘉实事件驱动股票、嘉实全球价值机会股票（QDII）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 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，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；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的，合计 2 次，其中 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，另 1 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年全年度，美国股票市场延续了多年牛市，整体继续保持上行趋势。

开年后，美国股票市场延续了传统的圣诞-新年的季节效应，即年末到次年初的多个节假日期间市场在历史上大概率有较好的表现。受疫情常态化后的生产恢复、美联储缩减宽松的货币政策的预期影响，2021 年上半年美股市场表现出小市值和价值风格占优的结构，与已持续将近十年之久的大盘成长风格有所不同。在上半年，小盘指数如罗素 2000 以及相应的价值风格如罗素 2000 价值，显著优于相对应的大盘指数罗素 1000 和风格指数罗素 2000 成长。

年内最重要的金融市场事件，是美联储启动了 Tapering 进程，并不断通过鹰派信息向市场传递货币政策逐步退出宽松的预期。市场也从预期 2022 年底启动加息逐步加速到对 2022 年上半年启动加息并增加了加息强度的预期，主要原因之一是美国国内通胀上升的压力，实际上美国长端国债实际利率中枢已经逐步上移。

综合全年，美股市场主要的风险因素，既包括疫情对经济增长和投资者信心的负面影响，也包括为应对疫情而推出的各项货币和财政刺激政策在国民经济和资本市场产生的结构性失衡的系统风险。随着疫情累积感染人数的增加和持续的得不到控制，美国国内包括政府和民众对科学防控措施的有效执行逐步丧失耐心，实际上疫情本身已不像爆发初期那样引起市场的风险偏好下降。此外，美股的核心驱动力，是上市公司的盈利能力，美国企业在本年度内的几次财务披露，大面积大幅度超市场预期，即使剔除低基数效应，也能看出企业显著的强劲盈利能力，这是美股在联储缩减量化宽松操作下，仅有小幅波动就进一步上行的原动力。

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 3.382 元，本报告期基金份额净值增长率为 22.45%；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 3.235 美元，本报告期基金份额净值增长率为 25.29%；业绩比较基准收益率为 25.28%。

#### 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，站在当前时点，仍然是投资美股较好的进入机会，核心逻辑既包括美国上市公司的企业盈利的强劲表现，也包括美联储启动并完成 Tapering，以及在未来启动加息、进行缩表，在实际利率逐步上行的过程中，权益类资产在大类资产配置中的相对优势地位。

在股票市场层面，我们更加关注市场内部结构的变化，尤其是成长类企业的盈利增速与宽松货币环境退出的关系。

在风格和行业层面，我们侧重于在成长风格内进一步控制估值水平，在更优的安全边际上，实现对成长风格的标的优选，并关注在高通胀和加息预期下大宗商品、周期板块等区域的波动对组合的风险影响，积极调整组合。

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

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人有关法律稽核工作情况如下：

(1) 继续内控前置。在基金营销、投资管理、信息披露以及新产品设计开发、海外业务、另类业务、制度建设、合同管理、法律咨询等方面，事前进行合规性审核、监控。全力支持创新业务，新产品新业务从战略规划到具体产品方案、业务模式，在制度流程、投资范围、投资工具、运作规则等方面，防控重大风险。

(2) 全流程开展投资交易监督。一是事前防范，主要从事前研讨，合规风险识别、评估和分析，IT 事前设置，建立禁限库，合规培训、承诺书等方面开展；二是事中实时监控，如实时回答组合经理、交易员投资交易事项，盘中交易审批等；三是事后检查及改进，如检查投资交易合规情况，对异常行为进行提示、处理建议并督促改正。

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

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

(5) 加强差错管理。继续推动各业务单元梳理流程、制度，落实风险责任授权体系，确保所有识别的关键风险点均有相应措施控制。

此外，我们还积极配合监管，按时完成合规报告和各项统计报表及调查、专题报告。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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



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

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

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

# § 6 审计报告

## 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第 23891 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	嘉实美国成长股票型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了嘉实美国成长股票型证券投资基金(以下简称“嘉实美国成长股票(QDII)基金”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了嘉实美国成长股票(QDII)基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于嘉实美国成长股票(QDII)基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>

强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>嘉实美国成长股票(QDII)基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估嘉实美国成长股票(QDII)基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算嘉实美国成长股票(QDII)基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督嘉实美国成长股票(QDII)基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对嘉实美国成长股票(QDII)基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致嘉实美国成长股票(QDII)基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,</p>

	并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	薛竞	周祎
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2022 年 03 月 25 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：嘉实美国成长股票型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	386,008,961.82	76,054,976.46
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	1,651,141,851.14	991,307,002.54
其中：股票投资		1,648,245,698.91	986,869,713.76
基金投资		2,896,152.23	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	11,065,561.54
应收利息	7.4.7.5	11,797.88	5,130.37
应收股利		272,255.93	171,405.92
应收申购款		7,464,249.19	7,374,212.08
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,044,899,115.96	1,085,978,288.91
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-

衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		255,695,400.05	-
应付赎回款		32,855,556.73	36,882,839.89
应付管理人报酬		2,202,834.89	1,643,331.86
应付托管费		428,329.00	319,536.76
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
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	7.4.7.8	339,386.41	356,825.77
负债合计		291,521,507.08	39,208,801.11
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	518,693,260.29	379,227,706.27
未分配利润	7.4.7.10	1,234,684,348.59	667,541,781.53
所有者权益合计		1,753,377,608.88	1,046,769,487.80
负债和所有者权益总计		2,044,899,115.96	1,085,978,288.91

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币基金份额净值 3.382 元，基金份额总额 488,500,747.66 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 3.235 美元，基金份额总额 4,902,802.17 份，基金份额总额合计为 493,403,549.83 份。

## 7.2 利润表

会计主体：嘉实美国成长股票型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		248,136,016.77	273,010,964.13
1. 利息收入		172,982.92	209,322.60
其中：存款利息收入	7.4.7.11	172,982.92	209,322.60
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		104,322,959.91	87,186,826.46

列)			
其中：股票投资收益	7.4.7.12	96,704,140.53	78,673,886.14
基金投资收益	7.4.7.13	424,715.24	1,219,011.31
债券投资收益	7.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收 益	7.4.7.14.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	7,194,104.14	7,293,929.01
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	143,861,810.02	188,099,490.10
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-1,602,951.44	-5,281,858.03
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	1,381,215.36	2,797,183.00
减：二、费用		25,207,504.32	21,135,357.12
1. 管理人报酬	-	20,462,353.64	16,395,893.28
2. 托管费	-	3,978,791.02	3,188,090.44
3. 销售服务费	-	-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	525,850.79	1,273,406.01
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支 出		-	-
6. 税金及附加		1,426.60	14,470.95
7. 其他费用	7.4.7.21	239,082.27	263,496.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		222,928,512.45	251,875,607.01
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		222,928,512.45	251,875,607.01

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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	-	222,928,512.45	222,928,512.45

值变动数（本期净利润）			
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）	139,465,554.02	344,214,054.61	483,679,608.63
其中：1. 基金申购款	519,250,754.35	1,100,489,817.47	1,619,740,571.82
2. 基金赎回款	-379,785,200.33	-756,275,762.86	-1,136,060,963.19
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）	518,693,260.29	1,234,684,348.59	1,753,377,608.88
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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）	-	251,875,607.01	251,875,607.01
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）	111,420,663.38	101,172,209.64	212,592,873.02
其中：1. 基金申购款	960,528,097.67	1,246,087,464.85	2,206,615,562.52
2. 基金赎回款	-849,107,434.29	-1,144,915,255.21	-1,994,022,689.50
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	379,227,706.27	667,541,781.53	1,046,769,487.80

权益（基金净值）			
----------	--	--	--

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>经雷</u>	<u>梁凯</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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

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

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以交易性金融资产列示。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以衍生金融资产列示。

基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中以衍生金融负债列示。基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风



险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的现金红利扣除基金交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算或者发行价计算的利息扣除在交易所在地适用的预缴所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

基金收益分配是指按规定将基金的可分配收益按基金份额进行比例分配。由于本基金两类基金份额类别分别以人民币和美元计价，两类基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同类别的每份基金份额享有同等分配权。基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，对某

一基金份额类别，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利。如果基金份额持有人选择或默认选择现金分红形式，则美元份额以美元进行现金分红，人民币份额以人民币进行现金分红；如果选择红利再投资形式，则同一类别基金份额的分红资金将按除息日该类别的基金份额净值转成相应的同一类别的基金份额，红利再投资的份额免收申购费。在符合基金收益分配条件的情况下，本基金收益每年最多分配 6 次，各类基金份额收益分配比例分别不得低于收益分配基准日该类基金份额的可供分配利润的 10%。基金收益分配后各类基金份额的每一基金份额净值分别不能低于其面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

#### 7.4.4.13 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金无其他重要的会计政策和会计估计。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

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

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

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

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

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

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

## 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
活期存款	386,008,961.82	76,054,976.46
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	386,008,961.82	76,054,976.46

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,216,642,531.14	1,648,245,698.91	431,603,167.77
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	2,964,217.86	2,896,152.23	-68,065.63
其他	-	-	-
合计	1,219,606,749.00	1,651,141,851.14	431,535,102.14
项目	上年度末		
	2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	700,506,506.13	986,869,713.76	286,363,207.63
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	3,127,204.29	4,437,288.78	1,310,084.49
其他	-	-	-
合计	703,633,710.42	991,307,002.54	287,673,292.12

**7.4.7.3 衍生金融资产/负债**

无。

**7.4.7.4 买入返售金融资产****7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

无。

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

无。

**7.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	5,791.00	5,121.31
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	6,006.88	9.06
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	-	-
合计	11,797.88	5,130.37

**7.4.7.6 其他资产**

无。

**7.4.7.7 应付交易费用**

无。

**7.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-

应付赎回费	118,386.41	126,825.77
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	221,000.00	230,000.00
合计	339,386.41	356,825.77

#### 7.4.7.9 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12月31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	498,996,684.38	498,996,684.38
本期赎回（以“-”号填列）	-368,253,710.11	-368,253,710.11
-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	488,500,747.66	488,500,747.66

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12月31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	3,288,763.63	20,254,069.97
本期赎回（以“-”号填列）	-1,871,291.36	-11,531,490.22
-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	4,902,802.17	30,192,512.63

注：

申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 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	73,231,158.63	132,308,350.39	205,539,509.02
本期基金份	93,355,157.83	234,573,702.38	327,928,860.21

额交易产生的变动数			
其中：基金申购款	301,571,663.05	757,896,661.77	1,059,468,324.82
基金赎回款	-208,216,505.22	-523,322,959.39	-731,539,464.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	328,137,384.25	835,626,477.98	1,163,763,862.23

## 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	5,835,543.80	11,553,459.63	17,389,003.43
本期基金份额交易产生的变动数	5,721,101.39	10,564,093.01	16,285,194.40
其中：基金申购款	14,216,859.40	26,804,633.25	41,021,492.65
基金赎回款	-8,495,758.01	-16,240,540.24	-24,736,298.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,805,681.19	47,114,805.17	70,920,486.36

## 7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	166,347.40	208,371.30
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	6,635.52	951.30
合计	172,982.92	209,322.60

## 7.4.7.12 股票投资收益

## 7.4.7.12.1 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
----	-----------------------------	----------------------------------



股票投资收益——买卖 股票差价收入	96,704,140.53	78,673,886.14
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	96,704,140.53	78,673,886.14

#### 7.4.7.12.2 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12月31 日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日
卖出股票成交总额	538,449,476.80	866,404,177.73
减：卖出股票成本总 额	441,745,336.27	787,730,291.59
买卖股票差价收入	96,704,140.53	78,673,886.14

#### 7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 7.4.7.13 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12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月 31日
卖出/赎回基金成交总额	6,394,914.33	14,606,024.40
减：卖出/赎回基金成本总额	5,970,199.09	13,387,013.09
基金投资收益	424,715.24	1,219,011.31

#### 7.4.7.14 债券投资收益

##### 7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

无。

7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

7.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.15 贵金属投资收益

7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	7,186,380.92	7,237,102.87
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	7,723.22	56,826.14
合计	7,194,104.14	7,293,929.01

## 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	143,861,810.02	188,099,490.10
股票投资	145,239,960.14	186,836,880.74
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-1,378,150.12	1,262,609.36
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	143,861,810.02	188,099,490.10

## 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
基金赎回费收入	1,381,215.36	2,797,183.00
合计	1,381,215.36	2,797,183.00

## 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	525,850.79	1,273,406.01
银行间市场交易费用	-	-
合计	525,850.79	1,273,406.01

## 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	101,000.00	110,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	18,082.27	33,496.44
合计	239,082.27	263,496.44

## 7.4.7.22 分部报告

无。

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 7.4.8.1 或有事项

无。

## 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

## 7.4.9 关联方关系

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

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 7.4.10.1.1 股票交易

无。

## 7.4.10.1.2 债券交易

无。

## 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

## 7.4.10.1.4 基金交易

无。

## 7.4.10.1.5 权证交易

无。

## 7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

## 7.4.10.2 关联方报酬

## 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	20,462,353.64	16,395,893.28
其中：支付销售机构的客户维护费	6,837,928.35	6,144,291.10

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.80%/当年天数。2.

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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,978,791.02	3,188,090.44

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

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司 _活期	386,008,961.82	166,347.40	76,054,976.46	208,371.30

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

本期(2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日), 本基金未实施利润分配。

#### 7.4.12 期末(2021 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

### 7.4.13.2 信用风险

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

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

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



#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 7.4.13.3 流动性风险

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

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合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。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

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

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	386,008,961.82	-	-	-	386,008,961.82
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	1,651,141,851.14	1,651,141,851.14
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-

应收利息	-	-	-	11,797.88	11,797.88
应收股利	-	-	-	272,255.93	272,255.93
应收申购款	-	-	-	7,464,249.19	7,464,249.19
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	386,008,961.82	-	-	1,658,890,154.14	2,044,899,115.96
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	-	-	-	255,695,400.05	255,695,400.05
应付赎回款	-	-	-	32,855,556.73	32,855,556.73
应付管理人报酬	-	-	-	2,202,834.89	2,202,834.89
应付托管费	-	-	-	428,329.00	428,329.00
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	-	-	-	339,386.41	339,386.41
负债总计	-	-	-	291,521,507.08	291,521,507.08
利率敏感度缺口	386,008,961.82	-	-	-1,367,368,647.06	1,753,377,608.88
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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	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12月31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	-	-

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
----	--------------------

	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
银行存款	299,734,7 47.33	-	-	299,734,747.33
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资 产	1,651,141 ,851.14	-	-	1,651,141,851.14
衍生金融资产	-	-	-	-
应收股利	272,255.9 3	-	-	272,255.93
应收利息	1,237.72	-	-	1,237.72
应收申购款	101,847.8 5	-	-	101,847.85
应收证券清算 款	-	-	-	-
其它资产	-	-	-	-
资产合计	1,951,251 ,939.97	-	-	1,951,251,939.97
以外币计价的 负债				
应付证券清算 款	255,695,4 00.05	-	-	255,695,400.05
衍生金融负债	-	-	-	-
应付赎回款	9,443,645 .02	-	-	9,443,645.02
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	35,284.34	-	-	35,284.34
负债合计	265,174,329.41	-	-	265,174,329.41
资产负债表外 汇风险敞口净 额	1,686,077,610.56	-	-	1,686,077,610.56
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民 币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
银行存款	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

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
	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12月31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%	84,303,880.53	51,845,038.14
	所有外币相对人民币贬值 5%	-84,303,880.53	-51,845,038.14

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运

用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31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	1,648,245,698.91	94.00	986,869,713.76	94.28
交易性金融资产—基金投资	2,896,152.23	0.17	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	1,651,141,851.14	94.17	991,307,002.54	94.70

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准以外的其他市场变量保持不变		
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12月31日）	上年度末（2020年12月31日）	
分析	业绩比较基准上升5%	94,845,261.59	51,239,291.72
	业绩比较基准下降5%	-94,845,261.59	-51,239,291.72

#### 7.4.14 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 1,651,141,851.14 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) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”）相关衔接规定，以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,648,245,698.91	80.60
	其中：普通股	1,611,310,907.57	78.80
	存托凭证	14,286,691.39	0.70
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	22,648,099.95	1.11
2	基金投资	2,896,152.23	0.14
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	386,008,961.82	18.88
8	其他各项资产	7,748,303.00	0.38
9	合计	2,044,899,115.96	100.00

### 8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
美国	1,648,245,698.91	94.00
合计	1,648,245,698.91	94.00

### 8.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
信息技术	743,943,347.58	42.43
非必需消费品	283,477,078.08	16.17
通信服务	171,725,610.01	9.79
医疗保健	138,150,728.08	7.88
金融	103,591,826.72	5.91
工业	75,116,892.34	4.28
必需消费品	47,254,964.09	2.70

能源	29,577,274.33	1.69
原材料	28,510,873.05	1.63
房地产	2,368,409.08	0.14
公用事业	1,880,595.60	0.11
房地产信托特殊类	11,969,209.68	0.68
房地产信托抵押类	170,215.12	0.01
房地产信托住宅类	1,939,278.05	0.11
房地产信托工业类	2,229,481.87	0.13
房地产信托零售类	6,230,815.78	0.36
房地产信托酒店及度假村类	109,099.45	0.01
合计	1,648,245,698.91	94.00

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（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	149,489.00	169,241,437.36	9.65
2	Microsoft Corp	微软	MSFT UW	纳斯达克证券交易所	美国	71,315.00	152,919,001.86	8.72

				所				
3	Alphabet Inc	Alphabet 公司	GOO GL UW	纳斯达克 证券交易 所	美国	5,470.0 0	101,034,49 8.87	5.7 6
4	NVIDIA Corp	英伟达	NVD A UW	纳斯达克 证券交易 所	美国	40,907. 00	76,707,052 .59	4.3 7
5	Amazon.com Inc	亚马逊公司	AMZ N UW	纳斯达克 证券交易 所	美国	3,477.0 0	73,916,679 .10	4.2 2
6	Tesla Inc	特斯拉公司	TSL A UW	纳斯达克 证券交易 所	美国	8,198.0 0	55,235,764 .99	3.1 5
7	Meta Platforms Inc	Meta 平台股份有限 公司	FB UW	纳斯达	美国	24,531. 00	52,605,912 .50	3.0 0

				克 证 券 交 易 所				
8	Home Depot Inc/The	家得宝	HD UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	10,238. 00	27,089,535 .63	1.5 4
9	Advanced Micro Devices Inc	AMD 公司	AMD UR	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	25,153. 00	23,076,952 .62	1.3 2
10	Broadcom Inc	博通股份有限公司	AVG O UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	5,199.0 0	22,056,521 .14	1.2 6
11	Costco Wholesale Corp	开市客	COS T UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	5,724.0 0	20,717,931 .51	1.1 8

12	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM M UN	纳斯达克 证券交易 所	美国	14,953. 00	17,434,065 .44	0.9 9
13	Visa Inc	维萨公司	V UN	纽约证 券交易 所	美国	11,779. 00	16,274,784 .54	0.9 3
14	Lowe's Cos Inc	劳氏	LOW UN	纽约证 券交易 所	美国	9,651.0 0	15,904,760 .52	0.9 1
15	Adobe Inc	奥多比	ADBE E UN	纳斯 达克证 券交易 所	美国	4,392.0 0	15,878,856 .31	0.9 1
16	Eli Lilly & Co	礼来	LLY UN	纽约证 券交易 所	美国	7,867.0 0	13,854,541 .08	0.7 9
17	Mastercard Inc	万事达股份有限公	MA	纽	美	5,952.0	13,635,535	0.7

		司	UN	约 证 券 交 易 所	国	0	.15	8
18	Accenture PLC	埃森哲公司	ACN UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	4,907.0 0	12,969,428 .86	0.7 4
19	NIKE Inc	耐克公司	NKE UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	11,545. 00	12,268,154 .77	0.7 0
20	Netflix Inc	奈飞公司	NFL X UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	3,096.0 0	11,891,663 .89	0.6 8
21	Intuit Inc	Intuit 公司	INT U UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,780.0 0	11,400,718 .16	0.6 5
22	Applied Materials Inc	应用材料	AMA T UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	11,060. 00	11,096,278 .48	0.6 3

				达克 证 券 交 易 所				
23	ASML Holding NV	阿斯麦控股公司	ASML L UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,878.0 0	9,532,633. 72	0.5 4
24	Intuitive Surgical Inc	直觉外科手术公司	ISRG G UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	3,936.0 0	9,016,545. 54	0.5 1
25	Fortinet Inc	Fortinet 股份有限 公司	FTNT T UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	3,772.0 0	8,643,261. 06	0.4 9
26	Oracle Corp	甲骨文	ORCL L UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	14,439. 00	8,028,442. 04	0.4 6



27	Lam Research Corp	泛林集团	LRC X UW	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	1,657.0 0	7,597,485. 27	0.4 3
28	AbbVie Inc	艾伯维公司	ABB V UN	纽约 证 券 交 易 所	美国	8,762.0 0	7,563,969. 81	0.4 3
29	Pfizer Inc	辉瑞制药	PFE UN	纽约 证 券 交 易 所	美国	20,005. 00	7,531,584. 13	0.4 3
30	KLA Corp	KLA 公司	KLA C UW	纳斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,678.0 0	7,343,751. 73	0.4 2
31	Blackstone Inc	黑石集团股份有限 公司	BX UN	纽约 证 券 交 易 所	美国	8,802.0 0	7,261,225. 95	0.4 1

32	UnitedHealth Group Inc	联合健康集团	UNH UN	纽约 证 券 交 易 所	美 国	2,143.0 0	6,860,801. 64	0.3 9
33	PayPal Holdings Inc	Paypal 控股股份有限公司	PYP L UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	5,697.0 0	6,849,671. 20	0.3 9
34	Estee Lauder Cos Inc/The	雅诗兰黛	EL UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	2,636.0 0	6,221,708. 99	0.3 5
35	Deere & Co	迪尔	DE UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	2,787.0 0	6,092,838. 44	0.3 5
36	CVS Health Corp	CVS 保健公司	CVS UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	8,938.0 0	5,878,676. 44	0.3 4
37	HCA Healthcare Inc	HCA 医疗保健有限公司	HCA UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	3,470.0 0	5,684,015. 61	0.3 2

				券交易所				
38	Simon Property Group Inc	西蒙房地产集团公司	SPG UN	纽约证券交易所	美国	5,218.0 0	5,315,292. 68	0.3 0
39	salesforce.com Inc	Salesforce.com 股份有限公司	CRM UN	纽约证券交易所	美国	3,168.0 0	5,132,973. 04	0.2 9
40	West Pharmaceutical Services Inc	西氏医药服务公司	WST UN	纽约证券交易所	美国	1,715.0 0	5,128,308. 00	0.2 9
41	Xilinx Inc	赛灵思	XLN X UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,724.0 0	5,034,250. 93	0.2 9
42	Gartner Inc	Gartner 公司	IT UN	纽约证券交易所	美国	2,328.0 0	4,962,187. 93	0.2 8

				所				
43	McKesson Corp	McKesson 公司	MCK UN	纽约证 券交 易所	美 国	3,093.0 0	4,901,810. 37	0.2 8
44	Thermo Fisher Scientific Inc	Thermo Fisher Scientific 公司	TMO UN	纽约证 券交 易所	美 国	1,132.0 0	4,815,666. 18	0.2 7
45	Chevron Corp	雪佛龙	CVX UN	纽约证 券交 易所	美 国	6,375.0 0	4,769,701. 02	0.2 7
46	ON Semiconductor Corp	安森美半导体公司	ON UW	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美 国	10,756. 00	4,657,751. 82	0.2 7
47	Align Technology Inc	Align 科技股份有 限公司	ALG N UW	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美 国	1,093.0 0	4,579,650. 90	0.2 6

48	Capital One Financial Corp	第一资本金融	COF UN	纽约 证 券 交 易 所	美 国	4,945.0 0	4,574,373. 80	0.2 6
49	Berkshire Hathaway Inc	伯克希尔哈撒韦公 司	BRK /B UN	纽约 证 券 交 易 所	美 国	2,393.0 0	4,561,857. 98	0.2 6
50	IDEXX Laboratories Inc	爱德士股份有限公 司	IDX X UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,082.0 0	4,542,391. 18	0.2 6
51	Dexcom Inc	Dexcom 股份有限公 司	DXC M UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,276.0 0	4,368,299. 38	0.2 5
52	Moderna Inc	莫德纳公司	MRN A UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,688.0 0	4,352,679. 17	0.2 5

				所				
53	KKR & Co Inc	KKR & Co 股份有限公司	KKR UN	纽约 证券 交易 所	美 国	9,129.0 0	4,336,180. 51	0.2 5
54	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	3,108.0 0	4,247,291. 91	0.2 4
55	General Motors Co	通用汽车公司	GM UN	纽约 证券 交易 所	美 国	11,177. 00	4,178,044. 09	0.2 4
56	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	15,485. 00	4,119,907. 53	0.2 3
57	Booking Holdings Inc	Booking 控股股份 有限公司	BKN G UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	269	4,114,831. 32	0.2 3
58	HP Inc	惠普	HPQ	纽 美	美 国	17,066.	4,098,785.	0.2

			UN	约 证 券 交 易 所	国	00	92	3
59	S&P Global Inc	标普全球	SPG I UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,345.0 0	4,046,949. 12	0.2 3
60	Zoetis Inc	硕腾股份有限公司	ZTS UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	2,525.0 0	3,928,551. 73	0.2 2
61	Abbott Laboratories	雅培制药	ABT UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	4,374.0 0	3,924,860. 26	0.2 2
62	O'Reilly Automotive Inc	O'Reilly 汽车股份 有限公司	ORL Y UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	869	3,912,855. 52	0.2 2
63	Marvell Technology Inc	Marvell Technology Inc	MRV L UW	纳 斯 达 克	美 国	6,998.0 0	3,903,554. 33	0.2 2

				证 券 交 易 所				
64	AutoZone Inc	AutoZone 公司	AZO UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	288	3,849,394. 67	0.2 2
65	Atlassian Corp PLC	Atlassian 公共有 限公司	TEA M UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,575.0 0	3,828,810. 28	0.2 2
66	ServiceNow Inc	ServiceNow 公司	NOW UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	913	3,778,478. 46	0.2 2
67	TJX Cos Inc/The	TJX 公司	TJX UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	7,796.0 0	3,773,600. 35	0.2 2
68	Cadence Design Systems Inc	Cadence 设计系统 股份有限公司	CDN S UW	纳 斯 达 克 证	美 国	3,169.0 0	3,765,125. 96	0.2 1



				券交易所				
69	Synopsys Inc	新思科技公司	SNP S UW	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	1,582.0 0	3,716,822. 70	0.2 1
70	Texas Instruments Inc	德州仪器	TXN UW	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	3,090.0 0	3,713,031. 07	0.2 1
71	EPAM Systems Inc	EPAM 系统公司	EPA M UN	纽约 证 券 交 易 所	美国	855	3,643,870. 35	0.2 1
72	MongoDB Inc	MongoDB Inc	MDB UQ	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	1,076.0 0	3,631,475. 03	0.2 1
73	Extra Space Storage Inc	额外空间仓储公司	EXR UN	纽约 证 券 交 易 所	美国	2,511.0 0	3,629,807. 34	0.2 1

				证 券 交 易 所				
74	Zebra Technologies Corp	斑马技术公司	ZBR A UN	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	946	3,589,896. 54	0.2 0
75	Albertsons Cos Inc	艾伯森股份有限公 司	ACI UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	18,468. 00	3,554,764. 65	0.2 0
76	MaxLinear Inc	美国 MaxLinear 股 份有限公司	MXL UN	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	7,367.0 0	3,542,930. 65	0.2 0
77	Wells Fargo & Co	富国银行	WFC UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	11,555. 00	3,534,744. 82	0.2 0
78	Snowflake Inc	Snowflake Inc	SNO W UN	纽 约 证	美 国	1,633.0 0	3,526,901. 76	0.2 0

				券交易所				
79	Palo Alto Networks Inc	Palo Alto Networks 股份有限公司	PAN W UN	纳斯达克证券交易所	美国	987	3,503,902.82	0.20
80	Datadog Inc	Datadog Inc	DDO G UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,076.00	3,493,031.55	0.20
81	Bath & Body Works Inc	Bath & Body Works 股份有限公司	BBW I UN	纽约证券交易所	美国	7,820.00	3,479,588.01	0.20
82	Capri Holdings Ltd	Capri 控股有限公司	CPR I UN	纽约证券交易所	美国	8,402.00	3,477,139.86	0.20
83	Devon Energy Corp	戴文能源	DVN UN	纽约证券交易所	美国	12,047.00	3,383,394.95	0.19

				交易所				
84	HubSpot Inc	HubSpot 公司	HUB S UN	纽约 证券 交易 所	美国	792	3,328,413. 78	0.1 9
85	Builders FirstSource Inc	Builders FirstSource 股 份 有 限 公 司	BLD R UN	纽约 证券 交易 所	美国	5,940.0 0	3,245,979. 81	0.1 9
86	SVB Financial Group	硅谷银行金融集团	SIV B UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	737	3,186,975. 76	0.1 8
87	Procter & Gamble Co/The	宝洁	PG UN	纽约 证 券 交 易 所	美国	3,051.0 0	3,182,000. 81	0.1 8
88	Olin Corp	奥林公司	OLN UN	纽约 证 券 交 易 所	美国	8,599.0 0	3,153,513. 54	0.1 8

89	Charles Schwab Corp/The	嘉信理财	SCHW UN	纽约证券交易所	美国	5,717.00	3,065,434.65	0.17
90	Union Pacific Corp	联合太平洋	UNP UN	纽约证券交易所	美国	1,904.00	3,058,262.11	0.17
91	Starbucks Corp	星巴克	SBU X UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,953.00	2,948,011.53	0.17
92	eBay Inc	eBay 公司	EBA Y UW	纳斯达克证券交易所	美国	6,945.00	2,944,569.23	0.17
93	Synaptics Inc	Synaptics 股份有限公司	SYN A UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,577.00	2,910,872.19	0.17

				所				
94	Atkore Inc	Atkore 股份有限公司	ATK R UN	纽约证 券交 易所	美国	4,081.0 0	2,893,078. 37	0.1 7
95	Macy's Inc	梅西百货	M UN	纽约证 券交 易所	美国	16,833. 00	2,809,694. 10	0.1 6
96	Herc Holdings Inc	Herc 控股公司	HRI UN	纽约证 券交 易所	美国	2,769.0 0	2,763,782. 75	0.1 6
97	Bill.com Holdings Inc	Bill.com Holdings Inc	BIL L UN	纽约证 券交 易所	美国	1,713.0 0	2,721,110. 19	0.1 6
98	Ford Motor Co	福特汽车	F UN	纽约证 券交 易所	美国	20,040. 00	2,653,762. 71	0.1 5
99	Chipotle Mexican Grill Inc	Chipotle Mexican Grill 股份有限公司	CMG UN	纽约证	美国	238	2,652,823. 57	0.1 5

				券交易所				
100	Sherwin-Williams Co/The	宣伟	SHW UN	纽约证券交易所	美国	1,158.00	2,600,018.62	0.15
101	Dell Technologies Inc	Dell Technologies Inc	DELL UN	纽约证券交易所	美国	7,258.00	2,599,257.23	0.15
102	Cheniere Energy Inc	Cheniere 能源公司	LNG UA	纽约证券交易所	美国	4,018.00	2,598,133.20	0.15
103	Lattice Semiconductor Corp	莱迪斯半导体公司	LSC C UW	纳斯达克证券交易所	美国	5,196.00	2,552,854.25	0.15
104	Life Storage Inc	Life 仓储公司	LSI UN	纽约证券交易所	美国	2,604.00	2,543,143.81	0.15

				所				
10 5	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	1,460.0 0	2,529,125. 43	0.1 4
10 6	PepsiCo Inc	百事可乐	PEP UN	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	2,246.0 0	2,487,496. 31	0.1 4
10 7	MSCI Inc	MSCI 明晟	MSC I UN	纽约证 券交 易所	美国	635	2,480,518. 05	0.1 4
10 8	Expedia Group Inc	亿客行集团股份有 限公司	EXP E UN	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	2,133.0 0	2,457,677. 80	0.1 4
10 9	Kroger Co/The	克罗格公司	KR UN	纽约证 券交 易所	美国	8,381.0 0	2,418,456. 41	0.1 4



11 0	Paychex Inc	Paychex 公司	PAY X UW	纳斯达克 证 券 交 易 所	美 国	2,720.0 0	2,367,169. 90	0.1 4
11 1	Morgan Stanley	摩根士丹利	MS UN	纽约 证 券 交 易 所	美 国	3,772.0 0	2,360,663. 62	0.1 3
11 2	ResMed Inc	瑞思迈股份有限公 司	RMD UN	纽约 证 券 交 易 所	美 国	1,421.0 0	2,359,914. 86	0.1 3
11 3	APA Corp	APA Corp	APA UW	纳斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	13,616. 00	2,334,362. 07	0.1 3
11 4	Crowdstrike Holdings Inc	CrowdStrike 控 股 股份有限公 司	CRW D UW	纳斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,785.0 0	2,330,182. 87	0.1 3

				所				
11 5	Live Nation Entertainment Inc	Live Nation 娱乐公司	LYV UN	纽约 证券 交易 所	美 国	3,023.0 0	2,306,874. 07	0.1 3
11 6	Sony Group Corp	索尼集团公司	SON Y UN	纽约 证券 交易 所	美 国	2,857.0 0	2,302,423. 39	0.1 3
11 7	Keysight Technologies Inc	是德科技公司	KEY S UN	纽约 证券 交易 所	美 国	1,746.0 0	2,298,863. 58	0.1 3
11 8	Agilent Technologies Inc	安捷伦	A UN	纽约 证券 交易 所	美 国	2,253.0 0	2,293,284. 78	0.1 3
11 9	Cisco Systems Inc/Delaware	Cisco Systems Inc/Delaware	CSC O UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	5,675.0 0	2,292,859. 52	0.1 3
12	Mettler-Toledo	梅特勒-托利多国际	MTD	纽 美		211	2,283,210.	0.1

0	International Inc	股份有限公司	UN	约 证 券 交 易 所	国		28	3
12 1	Cloudflare Inc	Cloudflare Inc	NET UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	2,706.0 0	2,268,722. 71	0.1 3
12 2	Regeneron Pharmaceuticals Inc	再生元制药股份有 限公司	REG N UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	560	2,254,773. 96	0.1 3
12 3	Donnelley Financial Solutions Inc	当纳利金融解决方 案股份有限公司	DFI N UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	7,156.0 0	2,150,739. 36	0.1 2
12 4	Caterpillar Inc	卡特彼勒	CAT UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,625.0 0	2,141,932. 35	0.1 2
12 5	Old Dominion Freight Line Inc	Old Dominion Freight Line 股份 有限公司	ODF L UW	纳 斯 达 克	美 国	937	2,140,973. 19	0.1 2

				证 券 交 易 所				
12 6	Exxon Mobil Corp	埃克森美孚石油	XOM UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	5,470.0 0	2,134,006. 08	0.1 2
12 7	Nucor Corp	纽柯公司	NUE UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	2,841.0 0	2,067,640. 47	0.1 2
12 8	Alcoa Corp	美国铝业公司	AA UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	5,376.0 0	2,042,149. 97	0.1 2
12 9	Zscaler Inc	Zscaler 股份有限 公司	ZS UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	994	2,036,411. 46	0.1 2
13 0	Arista Networks Inc	Arista 网络股份有 限公司	ANE T UN	纽 约 证 券 交	美 国	2,217.0 0	2,031,895. 74	0.1 2

				易所				
13 1	Expeditors International of Washington Inc	华盛顿康捷国际物 流公司	EXP D UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,373.0 0	2,031,745. 40	0.1 2
13 2	FactSet Research Systems Inc	FactSet 研究系统 股份有限公司	FDS UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	655	2,029,618. 34	0.1 2
13 3	CDW Corp/DE	特拉华 CDW 公司	CDW UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,550.0 0	2,023,704. 56	0.1 2
13 4	Avantor Inc	Avantor 股份有限 公司	AVT R UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	7,517.0 0	2,019,607. 41	0.1 2
13 5	Tractor Supply Co	拖拉机供应公司	TSC O UW	纳 斯 达 克 证 券	美 国	1,315.0 0	2,000,433. 26	0.1 1

				交易所				
13 6	Tyson Foods Inc	泰森食品公司	TSN UN	纽约证 券交 易所	美国	3,598.0 0	1,999,430. 23	0.1 1
13 7	Analog Devices Inc	亚德诺半导体	ADI UW	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	1,768.0 0	1,981,321. 20	0.1 1
13 8	Iron Mountain Inc	美国铁山公司	IRM UN	纽约证 券交 易所	美国	5,920.0 0	1,975,151. 06	0.1 1
13 9	Franklin Resources Inc	富兰克林资源	BEN UN	纽约证 券交 易所	美国	9,238.0 0	1,972,518. 02	0.1 1
14 0	Bank of America Corp	美国银行公司	BAC UN	纽约证 券交 易所	美国	6,872.0 0	1,949,276. 42	0.1 1

14 1	JPMorgan Chase & Co	摩根大通	JPM UN	纽约 证 券 交 易 所	美 国	1,926.0 0	1,944,474. 37	0.1 1
14 2	PNC Financial Services Group Inc/The	PNC 财务服务	PNC UN	纽约 证 券 交 易 所	美 国	1,517.0 0	1,939,416. 79	0.1 1
14 3	Ameriprise Financial Inc	阿默普莱斯金融公 司	AMP UN	纽约 证 券 交 易 所	美 国	1,001.0 0	1,925,216. 96	0.1 1
14 4	Kohl's Corp	Kohl's 公司	KSS UN	纽约 证 券 交 易 所	美 国	6,100.0 0	1,920,864. 52	0.1 1
14 5	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	台积电	TSM UN	纽约 证 券 交 易 所	美 国	2,495.0 0	1,913,815. 87	0.1 1
14 6	Lululemon Athletica Inc	Lululemon Athletica 股份有 限公司	LUL U UW	纳 斯 达 克	美 国	766	1,911,758. 11	0.1 1

				证 券 交 易 所				
14 7	Marathon Petroleum Corp	马拉松石油公司	MPC UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	4,677.0 0	1,908,127. 34	0.1 1
14 8	Molina Healthcare Inc	Molina Healthcare 股份有限公司	MOH UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	937	1,900,219. 75	0.1 1
14 9	Waste Management Inc	废品管理	WM UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,784.0 0	1,898,362. 12	0.1 1
15 0	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	2,560.0 0	1,876,842. 86	0.1 1
15 1	Credit Acceptance Corp	Credit Acceptance 公司	CAC C UW	纳 斯 达 克 证 券 交	美 国	427	1,872,156. 47	0.1 1



				易所				
15 2	Victoria's Secret & Co	Victoria's Secret & Co	VSC O UN	纽约证 券交 易所	美 国	5,259.0 0	1,862,245. 44	0.1 1
15 3	GXO Logistics Inc	GXO Logistics Inc	GXO UN	纽约证 券交 易所	美 国	3,189.0 0	1,846,765. 31	0.1 1
15 4	Stryker Corp	史赛克	SYK UN	纽约证 券交 易所	美 国	1,074.0 0	1,831,158. 93	0.1 0
15 5	Exelon Corp	Exelon 公司	EXC UN	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美 国	4,935.0 0	1,818,623. 80	0.1 0
15 6	Etsy Inc	Etsy 股份有限公司	ETS Y UW	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美 国	1,298.0 0	1,811,872. 69	0.1 0

				所				
15 7	Entegris Inc	Entegris 股份有限 公司	ENT G UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,043.0 0	1,805,081. 43	0.1 0
15 8	Goldman Sachs Group Inc/The	高盛	GS UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	725	1,768,292. 43	0.1 0
15 9	Microchip Technology Inc	微芯科技股份有限 公司	MCH P UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	3,184.0 0	1,767,337. 92	0.1 0
16 0	Tapestry Inc	TPR-DRS-RS	TPR UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	6,816.0 0	1,764,344. 91	0.1 0
16 1	Jabil Inc	捷普集团	JBL UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	3,881.0 0	1,740,746. 85	0.1 0

16 2	NXP Semiconductors NV	恩智浦半导体公司	NXP I UW	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,184.0 0	1,719,472. 22	0.1 0
16 3	Navient Corp	Navient 公司	NAV I UW	纳斯达克 证券交易 所	美国	12,671. 00	1,714,289. 42	0.1 0
16 4	Crocs Inc	卡骆弛股份有限公 司	CRO X UW	纳斯达克 证券交易 所	美国	2,086.0 0	1,705,288. 84	0.1 0
16 5	Matador Resources Co	Matador 资源公司	MTD R UN	纽约证 券交易 所	美国	7,232.0 0	1,702,346. 58	0.1 0
16 6	Micron Technology Inc	美光科技股份有限 公司	MU UW	纳斯 达克证 券	美国	2,839.0 0	1,686,072. 04	0.1 0

				交易所				
167	Pure Storage Inc	Pure 储存股份有限公司	PST G UN	纽约 证券 交易 所	美国	8,087.0 0	1,678,287. 31	0.1 0
168	United Rentals Inc	联合租赁公司	URI UN	纽约 证券 交易 所	美国	776	1,644,019. 13	0.0 9
169	Perficient Inc	Perficient 股份有限公司	PRF T UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,977.0 0	1,629,669. 28	0.0 9
170	Signet Jewelers Ltd	英国西格尼珠宝有限公司	SIG UN	纽约 证券 交易 所	美国	2,897.0 0	1,607,479. 16	0.0 9
171	Amphenol Corp	安费诺公司	APH UN	纽约 证券 交易 所	美国	2,881.0 0	1,606,499. 54	0.0 9

17 2	Pool Corp	Pool 公司	POOL L UW	纳斯达克 证券交易 所	美国	445	1,605,847. 56	0.0 9
17 3	Lennar Corp	Lennar 公司	LEN UN	纽约证 券交易 所	美国	2,157.0 0	1,597,477. 03	0.0 9
17 4	American International Group Inc	美国国际集团	AIG UN	纽约证 券交易 所	美国	4,382.0 0	1,588,572. 73	0.0 9
17 5	Summit Materials Inc	Summit 材料股份有 限公司	SUM UN	纽约证 券交易 所	美国	6,201.0 0	1,586,963. 63	0.0 9
17 6	Medpace Holdings Inc	Medpace 控股股份 有限公司	MED P UW	纳斯 达克证 券交易 所	美国	1,142.0 0	1,584,647. 59	0.0 9

177	MGM Resorts International	美高梅国际酒店集团	MGM UN	纽约证券交易所	美国	5,529.00	1,582,075.89	0.09
178	Ovintiv Inc	Ovintiv Inc	OVV UN	纽约证券交易所	美国	7,248.00	1,557,313.18	0.09
179	Johnson Controls International plc	江森自控国际有限公司	JCI UN	纽约证券交易所	美国	2,998.00	1,554,187.68	0.09
180	Signature Bank/New York NY	Signature 银行/纽约	SBN Y UW	纳斯达克证券交易所	美国	751	1,548,823.11	0.09
181	Coca-Cola Co/The	可口可乐	KO UN	纽约证券交易所	美国	4,094.00	1,545,506.28	0.09
182	Tenet Healthcare Corp	Tenet 医疗保健公司	THC UN	纽约证	美国	2,927.00	1,524,472.14	0.09

				券交易所				
183	Skyline Champion Corp	Skyline Champion 公司	SKY UN	纽约证券交易所	美国	2,999.00	1,510,154.81	0.09
184	McDonald's Corp	麦当劳	MCD UN	纽约证券交易所	美国	883	1,509,165.23	0.09
185	Carrier Global Corp	Carrier Global Corp	CAR UN	纽约证券交易所	美国	4,342.00	1,501,541.62	0.09
186	Monolithic Power Systems Inc	芯源系统有限公司	MPWR UN	纳斯达克证券交易所	美国	476	1,497,174.26	0.09
187	Altria Group Inc	高特利	MO UN	纽约证券交易所	美国	4,918.00	1,485,946.27	0.08

				所				
188	Bio-Techne Corp	Bio-technne 公司	TECH H UW	纳斯达克 证券交易 所	美国	450	1,484,282. 09	0.0 8
189	Onto Innovation Inc	Onto 创新股份有限 公司	ONT O UN	纽约证 券交易 所	美国	2,299.0 0	1,483,802. 44	0.0 8
190	Avery Dennison Corp	艾利丹尼森	AVY UN	纽约证 券交易 所	美国	1,071.0 0	1,478,821. 11	0.0 8
191	Merck & Co Inc	默克	MRK UN	纽约证 券交易 所	美国	3,022.0 0	1,476,650. 88	0.0 8
192	Automatic Data Processing Inc	ADP 公司	ADP UW	纳斯 达克证 券交易 所	美国	930	1,462,071. 70	0.0 8



193	Quanta Services Inc	Quanta 服务股份有限公司	PWR UN	纽约证券交易所	美国	1,977.00	1,445,261.66	0.08
194	Block Inc	Block 股份有限公司	SQ UN	纽约证券交易所	美国	1,390.00	1,431,337.64	0.08
195	Brightsphere Investment Group Inc	Brightsphere 投资集团有限公司	BSIG UN	纽约证券交易所	美国	8,677.00	1,416,241.89	0.08
196	General Dynamics Corp	通用动力	GD UN	纽约证券交易所	美国	1,063.00	1,412,878.14	0.08
197	Louisiana-Pacific Corp	路易斯安娜太平洋	LPX UN	纽约证券交易所	美国	2,814.00	1,405,694.57	0.08
198	Trane Technologies PLC	特灵科技公共有限公司	TT UN	纽约证券交易所	美国	1,084.00	1,396,281.62	0.08

				交易所				
19 9	Ally Financial Inc	Ally 金融公司	ALL Y UN	纽约证 券交 易所	美国	4,587.0 0	1,392,370. 44	0.0 8
20 0	Fifth Third Bancorp	五三银行	FIT B UN	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	5,006.0 0	1,389,974. 65	0.0 8
20 1	Waters Corp	沃特世公司	WAT UN	纽约证 券交 易所	美国	582	1,382,590. 95	0.0 8
20 2	Edwards Lifesciences Corp	爱德华生命科学公 司	EW UN	纽约证 券交 易所	美国	1,661.0 0	1,371,939. 38	0.0 8
20 3	Juniper Networks Inc	瞻博网络股份有限 公司	JNP R UN	纽约证 券交 易所	美国	6,015.0 0	1,369,472. 63	0.0 8

204	American Tower Corp	美国发射塔公司	AMT UN	纽约证券交易所	美国	732	1,365,101.13	0.08
205	Teradyne Inc	泰瑞达	TER UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,307.00	1,362,702.01	0.08
206	CBRE Group Inc	世邦魏理仕	CBRE UN	纽约证券交易所	美国	1,957.00	1,353,905.84	0.08
207	CF Industries Holdings Inc	CF 工业控股股份有限公司	CF UN	纽约证券交易所	美国	2,993.00	1,350,657.23	0.08
208	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	5,038.00	1,336,545.51	0.08

20 9	Williams-Sonoma Inc	威廉斯-索纳玛公司	WSM UN	纽约 证 券 交 易 所	美 国	1,229.0 0	1,325,257. 91	0.0 8
21 0	Brighthouse Financial Inc	Brighthouse 金 融 股份有限公司	BHF UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	3,960.0 0	1,307,834. 59	0.0 7
21 1	TopBuild Corp	TopBuild 公司	BLD UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	741	1,303,507. 47	0.0 7
21 2	Public Storage	公共存储公司	PSA UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	544	1,299,116. 71	0.0 7
21 3	VMware Inc	VMware 公司	VMW UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,741.0 0	1,286,278. 86	0.0 7
21 4	PulteGroup Inc	Pulte 集团公司	PHM UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	3,515.0 0	1,280,989. 07	0.0 7

				券交易所				
21 5	Novanta Inc	Novanta 股份有限公司	NOV T UW	纳斯达克证 券交易所	美国	1,133.0 0	1,273,749. 40	0.0 7
21 6	Moody's Corp	穆迪	MCO UN	纽约证 券交易所	美国	508	1,265,032. 22	0.0 7
21 7	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	449	1,261,071. 89	0.0 7
21 8	Toll Brothers Inc	托尔兄弟公司	TOL UN	纽约证 券交易所	美国	2,677.0 0	1,235,534. 34	0.0 7
21 9	ArcBest Corp	Arkansas Best 公司	ARC B UW	纳斯 达克证 券	美国	1,608.0 0	1,228,717. 25	0.0 7

				交易所				
22 0	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	504	1,210,727. 07	0.0 7
22 1	TD SYNEX Corp	TD SYNEX 公司	SNX UN	纽约 证券 交易 所	美国	1,660.0 0	1,210,347. 59	0.0 7
22 2	Discover Financial Services	Discover 金融服务 公司	DFS UN	纽约 证券 交易 所	美国	1,616.0 0	1,190,629. 84	0.0 7
22 3	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	8,670.0 0	1,178,512. 44	0.0 7
22 4	Camden Property Trust	Camden 房地产信托 公司	CPT UN	纽约 证券 交易 所	美国	1,034.0 0	1,177,943. 22	0.0 7

22 5	General Electric Co	通用电气	GE UN	纽约 证 券 交 易 所	美 国	1,917.0 0	1,154,632. 83	0.0 7
22 6	WESCO International Inc	西科国际有限公司	WCC UN	纽约 证 券 交 易 所	美 国	1,375.0 0	1,153,595. 25	0.0 7
22 7	Illumina Inc	Illumina 公司	ILM N UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	466	1,130,316. 23	0.0 6
22 8	Ulta Beauty Inc	Ulta 美容产品公司	ULT A UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	428	1,125,193. 23	0.0 6
22 9	Tempur Sealy International Inc	泰普尔国际公司	TPX UN	纽约 证 券 交 易 所	美 国	3,747.0 0	1,123,534. 84	0.0 6

230	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	1,644.00	1,120,488.47	0.06
231	DR Horton Inc	霍顿房屋公司	DHI UN	纽约证券交易所	美国	1,601.00	1,107,002.91	0.06
232	Envista Holdings Corp	Envista Holdings Corp	NVST UN	纽约证券交易所	美国	3,825.00	1,098,880.59	0.06
233	Principal Financial Group Inc	信安金融	PFGUW	纳斯达克证券交易所	美国	2,364.00	1,090,168.96	0.06
234	Horizon Therapeutics Plc	Horizon Therapeutic 公共有限公司	HZNPUW	纳斯达克证券交易所	美国	1,561.00	1,072,477.92	0.06
23	Morningstar Inc	晨星公司	MOR	纳	美	490	1,068,408.	0.0



5			N UN	斯 达 克 证 券 交 易 所	国		57	6
23 6	SeaWorld Entertainment Inc	海洋世界娱乐股份 有限公司	SEA S UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	2,571.0 0	1,063,180. 24	0.0 6
23 7	Dillard's Inc	Dillard's 公司	DDS UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	680	1,062,278. 33	0.0 6
23 8	T Rowe Price Group Inc	普徠仕	TRO W UN	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	836	1,048,107. 95	0.0 6
23 9	AutoNation Inc	AutoNation 公司	AN UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,370.0 0	1,020,650. 75	0.0 6
24 0	Aon PLC	Aon PLC	AON UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	529	1,013,712. 33	0.0 6

				证 券 交 易 所				
24 1	Jones Lang LaSalle Inc	仲量联行	JLL UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	584	1,002,862. 93	0.0 6
24 2	AMERCO	Amerco	UHA L UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	216	1,000,128. 52	0.0 6
24 3	Stifel Financial Corp	斯迪富融资公司	SF UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	2,218.0 0	995,830.53	0.0 6
24 4	RH	RH	RH UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	291	994,344.86	0.0 6
24 5	EOG Resources Inc	EOG 资源	EOG UN	纽 约 证 券 交	美 国	1,743.0 0	987,154.03	0.0 6

				易所				
24 6	Apollo Global Management Inc	Apollo Global Management Inc	APO UN	纽约证 券交易 所	美国	2,131.0 0	984,078.65	0.0 6
24 7	Nexstar Media Group Inc	Nexstar 媒体集团 股份有限公司	NXS T UW	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	1,021.0 0	982,817.85	0.0 6
24 8	Invesco Ltd	景顺有限公司	IVZ UN	纽约证 券交易 所	美国	6,580.0 0	965,737.48	0.0 6
24 9	Ambarella Inc	安霸股份有限公司	AMB A UW	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	744	962,412.94	0.0 5
25 0	Century Communities Inc	世纪社区有限公司	CCS UN	纽约证 券交易 所	美国	1,844.0 0	961,587.92	0.0 5

				所				
25 1	Carlyle Group Inc/The	凯雷投资集团	CG UN	纳斯达克 证券交易 所	美国	2,744.0 0	960,471.15	0.0 5
25 2	Johnson & Johnson	强生	JNJ UN	纽约证 券交易 所	美国	874	953,263.93	0.0 5
25 3	Alnylam Pharmaceuticals Inc	Alnylam 制药股份 有限公司	ALN Y UN	纳斯 达克证 券交易 所	美国	874	944,961.11	0.0 5
25 4	Diamondback Energy Inc	Diamondback 能源 股份有限公司	FAN G UN	纳斯 达克证 券交易 所	美国	1,340.0 0	921,409.79	0.0 5
25 5	Unity Software Inc	Unity Software Inc	U UN	纽约证 券交	美国	960	875,194.89	0.0 5

				易所				
25 6	Repligen Corp	Repligen 公司	RGE N UW	纳斯达克 证券交易 所	美国	499	842,581.65	0.0 5
25 7	Syneos Health Inc	Syneos 健康公司	SYN H UW	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,205.0 0	788,861.54	0.0 4
25 8	MetLife Inc	大都会集团	MET UN	纽约证 券交易 所	美国	1,979.0 0	788,468.22	0.0 4
25 9	Regency Centers Corp	Regency Centers 公司	REG UW	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,609.0 0	772,978.07	0.0 4
26 0	Eaton Corp PLC	伊顿	ETN UN	纽约证 券	美国	696	766,886.54	0.0 4

				交易所				
26 1	Western Alliance Bancorp	Western Alliance Bancorp	WAL UN	纽约 证券 交易 所	美国	1,104.0 0	757,723.89	0.0 4
26 2	IQVIA Holdings Inc	IQVIA 控股股份有 限公司	IQV UN	纽约 证券 交易 所	美国	421	757,311.64	0.0 4
26 3	Rockwell Automation Inc	罗克韦尔自动化	ROK UN	纽约 证券 交易 所	美国	340	756,215.40	0.0 4
26 4	Terreno Realty Corp	Terreno 房地产公 司	TRN O UN	纽约 证券 交易 所	美国	1,389.0 0	755,315.22	0.0 4
26 5	STAG Industrial Inc	STAG 实业公司	STA G UN	纽约 证券 交易 所	美国	2,455.0 0	750,686.39	0.0 4
26	Berry Global Group	Berry 全球集团股	BER	纽 美		1,590.0	747,934.64	0.0

6	Inc	份有限公司	Y UN	约 证 券 交 易 所	国	0		4
26 7	Huntsman Corp	亨斯迈公司	HUN UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	3,301.0 0	734,090.96	0.0 4
26 8	Illinois Tool Works Inc	伊利诺伊工具	ITW UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	464	730,114.56	0.0 4
26 9	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	730,011.02	0.0 4
27 0	Prologis Inc	安博	PLD UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	674	723,480.26	0.0 4
27 1	Bristol-Myers Squibb Co	百时美施贵宝公司	BMY UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,815.0 0	721,507.68	0.0 4

				所				
27 2	Meta Financial Group Inc	梅塔金融集团	CAS H UN	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,895.0 0	720,809.23	0.0 4
27 3	Mosaic Co/The	Mosaic 公司	MOS UN	纽约证 券交易 所	美国	2,877.0 0	720,692.10	0.0 4
27 4	IHS Markit Ltd	IHS Markit 有限公 司	INF O UN	纽约证 券交易 所	美国	846	716,949.51	0.0 4
27 5	NetApp Inc	美国网域存储技术 有限公司	NTA P UN	纳斯 达克证 券交易 所	美国	1,205.0 0	706,733.27	0.0 4
27 6	Albemarle Corp	雅保公司	ALB UN	纽约证 券交易 所	美国	474	706,472.06	0.0 4



27 7	Tetra Tech Inc	Tetra 科技股份有 限公司	TTE K UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	650	703,686.01	0.0 4
27 8	Ingersoll Rand Inc	英格索兰股份有 限公司	IR UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,779.0 0	701,752.45	0.0 4
27 9	Rambus Inc	Rambus 股份有 限公司	RMB S UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	3,723.0 0	697,622.53	0.0 4
28 0	Landstar System Inc	Landstar 系统股份 有限公司	LST R UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	611	697,381.84	0.0 4
28 1	ONEOK Inc	Oneok 股份有 限公司	OKE UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,845.0 0	691,203.66	0.0 4

				所				
28 2	ConocoPhillips	康菲石油	COP UN	纽约证 券交 易所	美 国	1,489.0 0	685,234.86	0.0 4
28 3	Okta Inc	Okta Inc	OKT A UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	468	668,884.63	0.0 4
28 4	H&R Block Inc	H&R Block 公司	HRB UN	纽约证 券交 易所	美 国	4,398.0 0	660,630.14	0.0 4
28 5	Hilton Grand Vacations Inc	希尔顿度假酒店集 团	HGV UN	纽约证 券交 易所	美 国	1,981.0 0	658,162.94	0.0 4
28 6	Virtus Investment Partners Inc	维德思投资合伙人 股份有限公司	VRT S UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	347	657,294.50	0.0 4

287	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	BJ UN	纽约证券交易所	美国	1,538.00	656,696.21	0.04
288	Penumbra Inc	Penumbra 股份有限公司	PEN UN	纽约证券交易所	美国	354	648,480.61	0.04
289	Comerica Inc	Comerica 公司	CMA UN	纽约证券交易所	美国	1,165.00	646,209.07	0.04
290	Transcat Inc	Transcat 股份有限公司	TRNS UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,089.00	641,754.18	0.04
291	Lincoln National Corp	林肯国民	LNC UN	纽约证券交易所	美国	1,470.00	639,751.76	0.04
292	Targa Resources Corp	Targa 资源公司	TRGP UN	纽约	美国	1,917.00	638,488.61	0.04

				证 券 交 易 所				
29 3	Jefferies Financial Group Inc	杰富瑞金融集团	JEF UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	2,577.0 0	637,490.94	0.0 4
29 4	Comfort Systems USA Inc	美国舒适系统公司	FIX UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,006.0 0	634,596.63	0.0 4
29 5	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	1,085.0 0	633,932.03	0.0 4
29 6	Paylocity Holding Corp	Paylocity 控股公 司	PCT Y UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	418	629,376.46	0.0 4
29 7	Wintrust Financial Corp	Wintrust 金融公司	WTF C UW	纳 斯 达 克	美 国	1,081.0 0	625,943.40	0.0 4

				克 证 券 交 易 所				
29 8	Hershey Co/The	好时公司	HSY UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	504	621,687.37	0.0 4
29 9	Dynatrace Inc	Dynatrace Inc	DT UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,598.0 0	614,868.05	0.0 4
30 0	B Riley Financial Inc	B Riley 金融公司	RIL Y UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,080.0 0	611,868.28	0.0 3
30 1	Magnolia Oil & Gas Corp	Magnolia Oil & Gas Corp	MGY UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	5,068.0 0	609,728.34	0.0 3
30 2	Under Armour Inc	安德玛公司	UAA UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	4,458.0 0	602,280.63	0.0 3

				交易所				
30 3	Axon Enterprise Inc	Axon 企业股份有限公司	AXON UN	纳斯达克 证券交易所	美国	599	599,589.96	0.0 3
30 4	Humana Inc	Humana 公司	HUM UN	纽约 证券交易所	美国	202	597,401.30	0.0 3
30 5	Coca-Cola Consolidated Inc	可口可乐装瓶有限公司	COK E UN	纳斯达克 证券交易所	美国	151	596,113.22	0.0 3
30 6	AECOM	AECOM 公司	ACM UN	纽约 证券交易所	美国	1,206.0 0	594,751.44	0.0 3
30 7	Textron Inc	德事隆	TXT UN	纽约 证券交	美国	1,172.0 0	576,863.13	0.0 3

				易所				
308	Carvana Co	Carvana 公司	CVN A UN	纽约证 券交 易所	美国	390	576,351.17	0.03
309	Occidental Petroleum Corp	西方石油	OXY UN	纽约证 券交 易所	美国	3,114.00	575,565.42	0.03
310	Robert Half International Inc	罗致恒富国际公司	RHI UN	纽约证 券交 易所	美国	808	574,502.60	0.03
311	Marriott International Inc/MD	万豪国际	MAR UW	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	542	571,008.20	0.03
312	Amgen Inc	AMGEN-T	AMG N UW	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	395	566,564.79	0.03

				所				
31 3	Murphy Oil Corp	墨菲石油公司	MUR UN	纽约 证券 交易 所	美 国	3,401.0 0	566,162.86	0.0 3
31 4	Darden Restaurants Inc	达登饭店	DRI UN	纽约 证券 交易 所	美 国	586	562,815.17	0.0 3
31 5	Caesars Entertainment Inc	凯撒娱乐集团	CZR UN	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	932	555,769.51	0.0 3
31 6	PVH Corp	PVH 公司	PVH UN	纽约 证券 交易 所	美 国	815	554,174.25	0.0 3
31 7	Foot Locker Inc	富乐客公司	FL UN	纽约 证券 交易 所	美 国	1,987.0 0	552,727.35	0.0 3
31	Tradeweb Markets	Tradeweb Markets	TW	纳	美	855	545,885.52	0.0



8	Inc	Inc	UW	斯达克证 券交易 所	国			3
31 9	EMCOR Group Inc	埃姆科集团公司	EME UN	纽约证 券交易 所	美国	670	544,174.28	0.0 3
32 0	Quest Diagnostics Inc	Quest Diagnostics 股份有限公司	DGX UN	纽约证 券交易 所	美国	490	540,499.33	0.0 3
32 1	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	635	526,354.52	0.0 3
32 2	Anthem Inc	Anthem 股份有限公 司	ANT M UN	纽约证 券交易 所	美国	173	511,282.81	0.0 3
32 3	Boise Cascade Co	Boise Cascade 公司	BCC UN	纽约证 券	美国	1,096.0 0	497,529.02	0.0 3

				交易所				
324	Synchrony Financial	同步金融公司	SYF UN	纽约证券交易所	美国	1,672.00	494,525.30	0.03
325	American Express Co	美国运通	AXP UN	纽约证券交易所	美国	473	493,369.52	0.03
326	Ares Management Corp	阿瑞斯管理有限合伙企业	ARE S UN	纽约证券交易所	美国	949	491,727.33	0.03
327	Toro Co/The	托罗公司	TTC UN	纽约证券交易所	美国	767	488,576.08	0.03
328	Artisan Partners Asset Management Inc	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	1,590.00	482,943.97	0.03
32	Under Armour Inc	安德玛公司	UA	纽美		4,157.0	478,128.28	0.0

9			UN	约 证 券 交 易 所	国	0		3
33 0	CSX Corp	CSX 公司	CSX UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,974.0 0	473,219.76	0.0 3
33 1	SiTime Corp	SiTime Corp	SIT M UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	248	462,556.52	0.0 3
33 2	SiteOne Landscape Supply Inc	SiteOne Landscape Supply 股份有限公 司	SIT E UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	299	461,866.67	0.0 3
33 3	Manhattan Associates Inc	曼哈顿联合软件公 司	MAN H UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	460	456,024.49	0.0 3

33 4	Pioneer Natural Resources Co	Pioneer 自然资源公司	PXD UN	纽约 证 券 交 易 所	美 国	393	455,727.64	0.0 3
33 5	Moelis & Co	Moelis 公司	MC UN	纽约 证 券 交 易 所	美 国	1,126.0 0	448,761.68	0.0 3
33 6	PPG Industries Inc	PPG 工业	PPG UN	纽约 证 券 交 易 所	美 国	408	448,565.69	0.0 3
33 7	Penske Automotive Group Inc	Penske 汽车集团股份有限公司	PAG UN	纽约 证 券 交 易 所	美 国	653	446,392.47	0.0 3
33 8	Sysco Corp	Sysco 公司	SY UN	纽约 证 券 交 易 所	美 国	890	445,722.00	0.0 3
33 9	Resideo Technologies Inc	Resideo Technologies Inc	REZ I UN	纽约 证 券 交	美 国	2,679.0 0	444,605.42	0.0 3

				易所				
34 0	Ingredion Inc	宜瑞安公司	ING R UN	纽约证 券交易 所	美国	715	440,545.57	0.0 3
34 1	Carlisle Cos Inc	卡莱股份有限公司	CSL UN	纽约证 券交易 所	美国	277	438,197.02	0.0 2
34 2	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	435,951.30	0.0 2
34 3	Marathon Oil Corp	Marathon 石油公司	MRO UN	纽约证 券交易 所	美国	4,154.0 0	434,878.08	0.0 2
34 4	Chesapeake Energy Corp	切萨皮克能源公司	CHK UW	纳斯达 克证 券交易 所	美国	1,055.0 0	433,984.97	0.0 2

34 5	PerkinElmer Inc	珀金埃尔默	PKI UN	纽约 证券 交易 所	美国	335	429,435.91	0.0 2
34 6	Trex Co Inc	Trex 公司	TRE X UN	纽约 证券 交易 所	美国	498	428,733.56	0.0 2
34 7	Deckers Outdoor Corp	德克斯户外用品公司	DEC K UN	纽约 证券 交易 所	美国	183	427,393.33	0.0 2
34 8	Lincoln Electric Holdings Inc	林肯电气控股份有限公司	LEC O UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	478	425,046.62	0.0 2
34 9	Omniceil Inc	Omniceil 股份有限公司	OMC L UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	367	422,208.29	0.0 2
35	Tandem Diabetes	Tandem 糖尿病护理	TND	纳	美	437	419,375.95	0.0

0	Care Inc	股份有限公司	M UQ	斯达克证 券交易 所	国			2
35 1	A O Smith Corp	AO 史密斯公司	AOS UN	纽约证 券交易 所	美国	765	418,725.69	0.0 2
35 2	Continental Resources Inc/OK	美国大陆资源股份 有限公司(俄克拉何 马州)	CLR UN	纽约证 券交易 所	美国	1,453.0 0	414,651.81	0.0 2
35 3	Mattel Inc	美泰	MAT UW	纳斯达 克证 券交易 所	美国	3,016.0 0	414,579.64	0.0 2
35 4	UFP Industries Inc	UFP Industries 股 份有限公司	UFP I UW	纳斯达 克证 券交易 所	美国	700	410,639.71	0.0 2

35 5	Republic Services Inc	公共服务公司	RSG UN	纽约 证 券 交 易 所	美 国	461	409,871.12	0.0 2
35 6	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	409,752.72	0.0 2
35 7	Advanced Drainage Systems Inc	先进排水系统公司	WMS UN	纽约 证 券 交 易 所	美 国	465	403,584.68	0.0 2
35 8	GMS Inc	GMS 股份有限公司	GMS UN	纽约 证 券 交 易 所	美 国	1,049.0 0	402,022.25	0.0 2
35 9	Seagate Technology Holdings PLC	Seagate Technology Holdings PLC	STX UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	558	401,942.23	0.0 2
36 0	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	1,980.0 0	401,818.29	0.0 2



				券交易所				
36 1	Sea Ltd	Sea 有限公司	SE UN	纽约证 券交易 所	美国	281	400,792.51	0.0 2
36 2	FedEx Corp	联邦快递	FDX UN	纽约证 券交易 所	美国	242	399,060.67	0.0 2
36 3	Santander Consumer Holdings Inc	USA 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	1,474.0 0	394,894.79	0.0 2
36 4	UDR Inc	UDR 公司	UDR UN	纽约证 券交易 所	美国	1,030.0 0	393,952.59	0.0 2
36 5	Bruker Corp	布鲁克公司	BRK R UW	纳斯 达克证 券交易 所	美国	735	393,213.97	0.0 2

				所				
366	Vertiv Holdings Co	Vertiv Holdings Co	VRT UN	纽约 证券 交易 所	美国	2,461.0 0	391,794.22	0.0 2
367	Target Corp	塔吉特公司	TGT UN	纽约 证券 交易 所	美国	261	385,129.51	0.0 2
368	Smartsheet Inc	Smartsheet Inc	SMA R UN	纽约 证券 交易 所	美国	765	377,755.44	0.0 2
369	Marriott Vacations Worldwide Corp	万豪环球度假	VAC UN	纽约 证券 交易 所	美国	348	374,923.29	0.0 2
370	Eagle Materials Inc	鹰牌材料有限公司	EXP UN	纽约 证券 交易 所	美国	351	372,515.96	0.0 2
371	SBA Communications Corp	SBA 通信公司	SBA C UW	纳 斯 达	美国	150	372,041.22	0.0 2

				克 证 券 交 易 所				
37 2	CIT Group Inc	CIT 集团公司	CIT UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,111.0 0	363,661.89	0.0 2
37 3	McAfee Corp	McAfee Corp	MCF E UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,204.0 0	362,402.18	0.0 2
37 4	Bio-Rad Laboratories Inc	伯乐生命医学产品 有限公司	BIO UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	75	361,296.57	0.0 2
37 5	Hess Corp	赫斯公司	HES UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	765	361,074.70	0.0 2
37 6	Sprout Social Inc	Sprout Social Inc	SPT UR	纳 斯 达 克	美 国	621	359,069.80	0.0 2

				证 券 交 易 所				
37 7	3M Co	3M 公司	MMM UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	317	359,007.44	0.0 2
37 8	United Bankshares Inc/WV	United Bankshares 股份有限公司/WV	UBS I UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,538.0 0	355,755.39	0.0 2
37 9	Boeing Co/The	波音	BA UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	277	355,544.99	0.0 2
38 0	Saia Inc	Saia 股份有限公司	SAI A UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	164	352,403.56	0.0 2
38 1	Shopify Inc	Shopify 股份有限 公司	SHO P UN	纽 约 证	美 国	40	351,273.02	0.0 2

				券交易所				
38 2	AmerisourceBergen Corp	美源伯根	ABC UN	纽约证 券交 易所	美国	413	349,921.18	0.0 2
38 3	Graphic Packaging Holding Co	图像包装控股公司	GPK UN	纽约证 券交 易所	美国	2,810.0 0	349,356.48	0.0 2
38 4	Linde PLC	Linde PLC	LIN UN	纽约证 券交 易所	美国	158	348,979.93	0.0 2
38 5	Middleby Corp/The	美得彼公司	MID D UW	纳斯 达克 证 券交 易所	美国	278	348,746.20	0.0 2
38 6	Nutanix Inc	Nutanix 股份有限 公司	NTN X UW	纳斯 达克 证 券	美国	1,705.0 0	346,336.31	0.0 2

				交易所				
387	Omnicom Group Inc	Omnicom 集团	OMC UN	纽约 证券 交易 所	美国	741	346,156.33	0.0 2
388	Danaher Corp	丹纳赫	DHR UN	纽约 证券 交易 所	美国	165	346,115.39	0.0 2
389	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	MACOM 技术解决方案控股股份有限公司	MTS I UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	691	344,959.16	0.0 2
390	Franklin Electric Co Inc	Franklin 电气有限公司	FEL E UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	566	341,233.58	0.0 2
391	Steel Dynamics Inc	Steel Dynamics 股份有限公司	STL D UW	纳 斯 达 克 证	美国	861	340,731.88	0.0 2

				券交易所				
39 2	Walt Disney Co/The	华特迪士尼公司	DIS UN	纽约证 券交易 所	美国	345	340,698.60	0.0 2
39 3	Clearfield Inc	Clearfield 股份有 限公司	CLF D UQ	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	631	339,627.29	0.0 2
39 4	Avnet Inc	安富利股份有限公 司	AVT UW	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	1,291.0 0	339,365.31	0.0 2
39 5	NVR Inc	NVR 股份有限公司	NVR UN	纽约证 券交易 所	美国	9	339,058.64	0.0 2
39 6	Alaska Air Group Inc	阿拉斯加航空集团 公司	ALK UN	纽约证 券	美国	1,016.0 0	337,488.75	0.0 2

				交易所				
39 7	Antero Resources Corp	Antero 资源公司	AR UN	纽约 证券 交易 所	美国	2,982.0 0	332,715.90	0.0 2
39 8	Dover Corp	多佛	DOV UN	纽约 证券 交易 所	美国	287	332,296.38	0.0 2
39 9	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	331,014.10	0.0 2
40 0	Hancock Whitney Corp	Hancock Whitney 公 司	HWC UN	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,036.0 0	330,393.36	0.0 2
40 1	First Citizens BancShares Inc/NC	第一公民银行 (北 卡)	FCN CA UN	纳 斯 达 克 证 券 交	美国	62	328,030.28	0.0 2



				易所				
40 2	Argo Group International Holdings Ltd	ARGO 集团国际控 股有限公司	ARG O UN	纽约证 券交 易所	美国	882	326,773.88	0.0 2
40 3	Amcor PLC	Amcor PLC	AMC R UN	纽约证 券交 易所	美国	4,261.0 0	326,273.96	0.0 2
40 4	Airbnb Inc	爱彼迎股份有限公 司	ABN B UW	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	305	323,754.54	0.0 2
40 5	Pinnacle Financial Partners Inc	Pinnacle 财务合 伙人股份有限公司	PNF P UW	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	526	320,270.54	0.0 2
40 6	Truist Financial Corp	Truist 金融公司	TFC UN	纽约证 券交 易	美国	854	318,795.84	0.0 2

				所				
40 7	MKS Instruments Inc	MKS Instruments 股份有限公司	MKS I UW	纳斯达克证券交易所	美国	287	318,700.78	0.02
40 8	Activision Blizzard Inc	动视暴雪股份有限公司	ATV I UW	纳斯达克证券交易所	美国	751	318,555.67	0.02
40 9	Prudential Financial Inc	保德信金融集团	PRU UN	纽约证券交易所	美国	458	316,068.44	0.02
41 0	Popular Inc	Popular 股份有限公司	BPO P UW	纳斯达克证券交易所	美国	602	314,883.58	0.02
41 1	XPO Logistics Inc	XPO 物流公司	XPO UN	纽约证券交易所	美国	637	314,468.08	0.02

				易所				
41 2	Veritiv Corp	Veritiv 有限公司	VRT V UN	纽约证 券交 易所	美国	400	312,587.82	0.0 2
41 3	Investors Bancorp Inc	Investors Bancorp 股份公司	ISB C UW	纳斯 达克 证 券交 易所	美国	3,221.0 0	311,122.36	0.0 2
41 4	Encompass Health Corp	南方保健公司	EHC UN	纽约证 券交 易所	美国	743	309,146.09	0.0 2
41 5	Lithia Motors Inc	利西亚车行	LAD UN	纽约证 券交 易所	美国	161	304,815.52	0.0 2
41 6	Evercore Inc	Evercore 股份有限 公司	EVR UN	纽约证 券交 易所	美国	351	304,014.73	0.0 2

417	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	303,779.02	0.02
418	FNB Corp/PA	FNB/宾州	FNBUN	纽约证券交易所	美国	3,914.00	302,697.96	0.02
419	Gladstone Land Corp	Gladstone 地产公司	LAND UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,394.00	300,049.62	0.02
420	Red Rock Resorts Inc	红岩赌场度假村股份有限公司	RRRUW	纳斯达克证券交易所	美国	853	299,170.35	0.02
421	Calix Inc	Calix 公司	CALX UN	纽约证券交易所	美国	585	298,270.87	0.02

42 2	Parker-Hannifin Corp	派克汉尼汾	PH UN	纽约 证券 交易 所	美国	147	298,150.94	0.0 2
42 3	Applied Industrial Technologies Inc	应用工业技术公司	AIT UN	纽约 证券 交易 所	美国	449	293,998.19	0.0 2
42 4	Unum Group	尤纳姆集团	UNM UN	纽约 证券 交易 所	美国	1,872.0 0	293,250.58	0.0 2
42 5	DXC Technology Co	DXC 技术公司	DXC UN	纽约 证券 交易 所	美国	1,423.0 0	292,047.67	0.0 2
42 6	Valley National Bancorp	Valley National Bancorp	VLY UN	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	3,330.0 0	291,927.36	0.0 2
42 7	Laboratory Corp of America Holdings	美国实验控股	LH UN	纽 约	美国	143	286,473.14	0.0 2

				证 券 交 易 所				
42 8	Aptiv PLC	Aptiv 公共有限公司	APT V UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	272	286,054.71	0.0 2
42 9	IPG Photonics Corp	IPG 光子公司	IPG P UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	260	285,353.38	0.0 2
43 0	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	1,050.0 0	284,314.78	0.0 2
43 1	Vicor Corp	Vicor 公司	VIC R UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	351	284,164.82	0.0 2
43 2	Terex Corp	特雷克斯公司	TEX UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,006.0 0	281,893.29	0.0 2

				券交易所				
43 3	Altair Engineering Inc	Altair Engineering Inc	ALT R UN	纳斯达克证 券交易所	美国	565	278,527.56	0.0 2
43 4	FMC Corp	FMC 公司	FMC UN	纽约证 券交易所	美国	396	277,447.77	0.0 2
43 5	Metropolitan Bank Holding Corp	Metropolitan Bank Holding Corp	MCB UN	纽约证 券交易所	美国	407	276,435.75	0.0 2
43 6	Celanese Corp	塞拉尼斯公司	CE UN	纽约证 券交易所	美国	257	275,375.54	0.0 2
43 7	Granite Construction Inc	Granite 建筑公司	GVA UN	纽约证 券交易	美国	1,116.0 0	275,361.38	0.0 2

				所				
438	Ameris Bancorp	Ameris Bancorp	ABC B UW	纳斯达克 证券交易所	美国	868	274,934.47	0.02
439	Huntington Ingalls Industries Inc	Huntington Ingalls 工业公司	HII UN	纽约证 券交易 所	美国	230	273,837.59	0.02
440	ExlService Holdings Inc	ExlService 控股公 司	EXL S UW	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	294	271,364.97	0.02
441	Paycom Software Inc	Paycom 软件股份有 限公司	PAY C UN	纽约证 券交易 所	美国	102	270,006.94	0.02
442	Qorvo Inc	Qorvo 股份有限公 司	QRV O UW	纳斯 达克 证 券 交	美国	270	269,215.85	0.02



				易所				
44 3	Fabrinet	Fabrinet 公司	FN UN	纽约 证券 交易 所	美国	356	268,897.19	0.0 2
44 4	PacWest Bancorp	西太平洋银行	PAC W UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	933	268,695.01	0.0 2
44 5	Generac Holdings Inc	Generac 控股公司	GNR C UN	纽约 证 券 交 易 所	美国	119	267,004.62	0.0 2
44 6	United Airlines Holdings Inc	美国联合航空控股 股份有限公司	UAL UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	949	264,892.61	0.0 2
44 7	Cooper Cos Inc/The	库柏股份有限公司	COO UN	纽约 证 券 交 易 所	美国	99	264,432.54	0.0 2

				所				
448	Five9 Inc	Five9 公司	FIV N UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	302	264,404.36	0.02
449	Home BancShares Inc/AR	阿 肯 色 Home BancShares 公司	HOM B UN	纽约证 券交易 所	美国	1,692.00	262,680.12	0.01
450	ServisFirst Bancshares Inc	ServisFirst Bancshares 股份有 限公司	SFB S UN	纽约证 券交易 所	美国	484	262,111.15	0.01
451	JB Hunt Transport Services Inc	JB Hunt 运输服务股 份有限公司	JBH T UW	纳斯 达克证 券交易 所	美国	201	261,941.81	0.01
452	Silicon Laboratories Inc	芯科实验室有限公 司	SLA B UW	纳斯 达克证 券交	美国	199	261,898.33	0.01

				易所				
45 3	Synovus Financial Corp	Synovus 金融	SNV UN	纽约证 券交 易所	美国	851	259,729.25	0.0 1
45 4	Ecolab Inc	艺康集团	ECL UN	纽约证 券交 易所	美国	169	252,769.15	0.0 1
45 5	Marsh & McLennan Cos Inc	Marsh & McLennan 股份有限公司	MMC UN	纽约证 券交 易所	美国	228	252,675.11	0.0 1
45 6	Korn Ferry	光辉国际	KFY UN	纽约证 券交 易所	美国	523	252,521.01	0.0 1
45 7	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	251,063.84	0.0 1
45 8	Digital Turbine Inc	Digital Turbine 股 份有限公司	APP S UR	纳 斯	美国	645	250,810.79	0.0 1

				达克 证券 交易 所				
45 9	American National Group Inc	American National Group Inc	ANA T UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	208	250,429.34	0.0 1
46 0	Crane Co	(美国) 克瑞公司	CR UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	383	248,413.79	0.0 1
46 1	API Group Corp	API Group Corp	APG UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,508.0 0	247,767.10	0.0 1
46 2	Avient Corp	Avient 公司	AVN T UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	690	246,137.09	0.0 1
46 3	Athene Holding Ltd	Athene 控股有限公 司	ATH UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	463	245,985.92	0.0 1

				券交易所				
46 4	SPX FLOW Inc	斯必克流体公司	FLOW UN	纽约证券交易所	美国	446	245,911.26	0.01
46 5	Equifax Inc	Equifax 公司	EFX UN	纽约证券交易所	美国	129	240,809.62	0.01
46 6	East West Bancorp Inc	华美银行集团公司	EWB C UW	纳斯达克证券交易所	美国	479	240,285.60	0.01
46 7	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	375	240,045.11	0.01
46 8	Globus Medical Inc	Globus 医疗公司	GME D UN	纽约证券交易所	美国	512	235,686.68	0.01

				所				
469	Zoom Video Communications Inc	Zoom Video Communications Inc	ZM UW	纳斯达克证券交易所	美国	201	235,683.55	0.01
470	Xponential Fitness Inc	Xponential Fitness Inc	XPO F UN	纽约证券交易所	美国	1,806.00	235,356.67	0.01
471	United States Steel Corp	美国钢铁	X UN	纽约证券交易所	美国	1,549.00	235,146.59	0.01
472	Valero Energy Corp	Valero 能源	VLO UN	纽约证券交易所	美国	487	233,213.99	0.01
473	Magna International Inc	麦格纳国际公司	MGA UN	纽约证券交易所	美国	446	230,157.92	0.01
47	Alliance Data	联合数据系统公司	ADS	纽美		537	227,919.10	0.0

4	Systems Corp		UN	国 约 证 券 交 易 所				1
47 5	Regions Financial Corp	地区金融公司	RF UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,635.0 0	227,249.08	0.0 1
47 6	Hilltop Holdings Inc	Hilltop 控股股份有限公司	HTH UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,012.0 0	226,730.60	0.0 1
47 7	Cboe Global Markets Inc	Cboe 环球市场公司	CBO E UF	芝 加 哥 期 权 交 易 所	美 国	272	226,138.43	0.0 1
47 8	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	171	226,084.04	0.0 1
47 9	Regal Rexnord Corp	Regal Rexnord 公司	RRX UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	208	225,683.46	0.0 1

				券交易所				
480	ZoomInfo Technologies Inc	ZoomInfo Technologies Inc	ZI UN	纳斯达克证券交易所	美国	547	223,898.01	0.01
481	State Street Corp	道富集团	STT UN	纽约证券交易所	美国	377	223,538.42	0.01
482	Zions Bancorp NA	ZB NA-用于基本面	ZIO UN	纳斯达克证券交易所	美国	550	221,479.07	0.01
483	Otis Worldwide Corp	Otis Worldwide Corp	OTI UN	纽约证券交易所	美国	393	218,166.95	0.01
484	Zurn Water Solutions Corp	Zurn 水务解决方案公司	ZWS UN	纽约证券交易所	美国	937	217,454.72	0.01



				交易所				
485	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	217,342.00	0.01
486	Asana Inc	Asana Inc	ASAN UN	纽约证券交易所	美国	457	217,215.95	0.01
487	Equitable Holdings Inc	Equitable 控股股份有限公司	EQH UN	纽约证券交易所	美国	1,023.00	213,867.56	0.01
488	Allegiant Travel Co	忠实旅游公司	ALGT UW	纳斯达克证券交易所	美国	178	212,266.95	0.01
489	Cathay General Bancorp	国泰万通金控	CATY UW	纳斯达克证券交易所	美国	774	212,146.70	0.01

				易所				
49 0	New Relic Inc	New Relic 股份有限公司	NEW R UN	纽约证 券交 易所	美国	302	211,723.74	0.0 1
49 1	CarMax Inc	CarMax 股份有限公司	KMX UN	纽约证 券交 易所	美国	254	210,898.08	0.0 1
49 2	Citizens Financial Group Inc	公民金融集团	CFG UN	纽约证 券交 易所	美国	699	210,575.03	0.0 1
49 3	Raytheon Technologies Corp	雷神技术公司	RTX UN	纽约证 券交 易所	美国	379	207,954.55	0.0 1
49 4	Royal Caribbean Cruises Ltd	皇家加勒比国际游轮有限公司	RCL UN	纽约证 券交 易所	美国	424	207,883.52	0.0 1
49 5	Vail Resorts Inc	范尔度假村管理公司公司	MTN UN	纽约 证 券 交 易 所	美国	99	206,968.61	0.0 1

				证 券 交 易 所				
49 6	Sanmina Corp	Sanmina 公司	SAN M UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	778	205,653.81	0.0 1
49 7	JetBlue Airways Corp	捷蓝航空公司	JBL U UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,264.0 0	205,548.49	0.0 1
49 8	Skyworks Solutions Inc	思佳讯解决方案公司	SWK S UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	207	204,749.10	0.0 1
49 9	Schlumberger NV	斯伦贝谢公众有限公司	SLB UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,063.0 0	202,982.20	0.0 1
50	Philip Morris	菲利普莫里斯国际	PM	纽 美		335	202,906.65	0.0

0	International Inc	集团公司	UN	约 证 券 交 易 所	国			1
50 1	Insteel Industries Inc	Insteel 工业股份 有限公司	III N UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	798	202,545.66	0.0 1
50 2	Cincinnati Financial Corp	辛辛那提金融	CIN F UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	274	199,029.08	0.0 1
50 3	Simmons First National Corp	西蒙斯第一国民公 司	SFN C UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,034.0 0	195,005.38	0.0 1
50 4	Vulcan Materials Co	Vulcan 材料	VMC UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	146	193,226.30	0.0 1
50 5	BorgWarner Inc	博格华纳股份有限 公司	BWA UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	671	192,813.73	0.0 1

				证 券 交 易 所				
50 6	Children's Place Inc/The	Children's Place 股份有限公司	PLC E UN	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	381	192,606.65	0.0 1
50 7	Range Resources Corp	Range 资源公司	RRC UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,690.0 0	192,117.06	0.0 1
50 8	Phillips 66	Phillips 66	PSX UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	415	191,723.04	0.0 1
50 9	Alleghany Corp	Alleghany 公司	Y UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	45	191,535.91	0.0 1
51 0	Citigroup Inc	花旗集团	C UN	纽 约 证 券 交	美 国	496	190,974.15	0.0 1

				易所				
51 1	Enphase Energy Inc	Enphase 能源公司	ENPH H UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	163	190,118.40	0.0 1
51 2	Cadence Bank	Cadence 银行	CAD E UN	纽约证 券交易 所	美国	987	187,462.99	0.0 1
51 3	CNO Financial Group Inc	CNO 金融集团公司	CNO UN	纽约证 券交易 所	美国	1,220.0 0	185,435.96	0.0 1
51 4	Chart Industries Inc	查特工业公司	GTL S UN	纽约证 券交易 所	美国	179	182,018.01	0.0 1
51 5	Pacific Premier Bancorp Inc	太平洋第一合众银 行	PPB I UW	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	713	181,971.34	0.0 1

				所				
516	MillerKnoll Inc	MillerKnoll 股份有限公司	MLKNW	纳斯达克证券交易所	美国	728	181,900.76	0.01
517	Henry Schein Inc	亨利香恩公司	HSICW	纳斯达克证券交易所	美国	367	181,411.04	0.01
518	Hanesbrands Inc	汉佰有限公司	HBIUN	纽约证券交易所	美国	1,696.00	180,796.49	0.01
519	Callaway Golf Co	卡拉威高尔夫公司	ELYUN	纽约证券交易所	美国	1,024.00	179,147.99	0.01
520	Kraft Heinz Co/The	卡夫亨氏公司	KHCW	纳斯达克证券交易所	美国	780	178,532.35	0.01

				易所				
52 1	Southwest Airlines Co	西南航空	LUV UN	纽约证 券交易 所	美国	645	176,172.07	0.0 1
52 2	Charter Communications Inc	查特通信公司	CHT R UW	纳斯达 克证 券交易 所	美国	42	174,584.14	0.0 1
52 3	Jack in the Box Inc	Jack in the Box 公 司	JAC K UW	纳斯达 克证 券交易 所	美国	306	170,670.35	0.0 1
52 4	Annaly Capital Management Inc	Annaly 资本管理股 份有限公司	NLY UN	纽约证 券交易 所	美国	3,414.0 0	170,215.12	0.0 1
52 5	ROBLOX Corp	Roblox 公司	RBL X UN	纽约证 券交易 所	美国	256	168,375.61	0.0 1



				所				
52 6	Globant SA	Globant 股份有限公司	GLOB UN	纽约证券交易所	美国	84	168,213.66	0.01
52 7	Best Buy Co Inc	百思买	BBY UN	纽约证券交易所	美国	257	166,477.18	0.01
52 8	Veeva Systems Inc	Veeva Systems 股份有限公司	VEEV UN	纽约证券交易所	美国	101	164,515.25	0.01
52 9	Matson Inc	美森公司	MATX UN	纽约证券交易所	美国	284	163,017.21	0.01
53 0	SLM Corp	SLM 公司	SLMUW	纳斯达克证券交易所	美国	1,280.00	160,524.82	0.01
53	Scientific Games	Scientific Games	SGM	纳	美	371	158,078.66	0.0

1	Corp	Corp	S UW	斯 达 克 证 券 交 易 所	国			1
53 2	Change Healthcare Inc	Change Healthcare Inc	CHN G UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,158.0 0	157,849.84	0.0 1
53 3	Workday Inc	Workday 股份有限 公司	WDA Y UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	90	156,754.24	0.0 1
53 4	Webster Financial Corp	韦伯斯特金融公司	WBS UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	434	154,512.28	0.0 1
53 5	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	1,327.0 0	151,951.55	0.0 1

				所				
53 6	Catalent Inc	康泰伦特股份有限公司	CTL T UN	纽约 证 券 交 易 所	美 国	184	150,195.68	0.0 1
53 7	Ciena Corp	讯远通信	CIE N UN	纽约 证 券 交 易 所	美 国	295	144,767.60	0.0 1
53 8	Kimco Realty Corp	Kimco 房地产公司	KIM UN	纽约 证 券 交 易 所	美 国	907	142,545.03	0.0 1
53 9	Emerson Electric Co	艾默生电气	EMR UN	纽约 证 券 交 易 所	美 国	240	142,259.72	0.0 1
54 0	Nasdaq Inc	纳斯达克股份有限公司	NDA Q UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	106	141,929.84	0.0 1
54	Triumph Bancorp	Triumph 银行股份	TBK	纳	美	186	141,214.61	0.0

1	Inc	有限公司	UW	斯达克证 券交易 所	国			1
54 2	Uber Technologies Inc	优步技术股份有 限公司	UBE R UN	纽 约证 券交 易所	美 国	520	139,013.21	0.0 1
54 3	F5 Inc	F5 股份有限公司	FFI V UW	纳 斯达 克证 券交 易所	美 国	89	138,857.58	0.0 1
54 4	DocuSign Inc	DocuSign 股份有 限公司	DOC U UW	纳 斯达 克证 券交 易所	美 国	142	137,893.77	0.0 1
54 5	Coterra Energy Inc	Coterra 能源股份 有限公司	CTR A UN	纽 约证 券交 易所	美 国	1,135.0 0	137,491.97	0.0 1

546	Workiva Inc	Workiva 股份有限公司	WK UN	纽约 证券 交易 所	美国	165	137,274.24	0.0 1
547	Archer-Daniels-Midland Co	Archer-Daniels-Midland 公司	ADM UN	纽约 证券 交易 所	美国	318	137,036.87	0.0 1
548	KBR Inc	KBR 股份有限公司	KBR UN	纽约 证券 交易 所	美国	449	136,321.26	0.0 1
549	UMB Financial Corp	UMB 金融公司	UMB F UN	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	197	133,275.53	0.0 1
550	ASGN Inc	ASGN 股份有限公司	ASG N UN	纽约 证券 交易 所	美国	168	132,175.91	0.0 1
551	Twitter Inc	推特公司	TWT R UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	478	131,716.61	0.0 1

				券交易所				
55 2	Mid-America Apartment Communities Inc	Mid-America Apartment Communities 股份 有限公司	MAA UN	纽约证 券交易 所	美国	90	131,655.65	0.0 1
55 3	VICI Properties Inc	VICI Properties Inc	VIC I UN	纽约证 券交易 所	美国	681	130,733.15	0.0 1
55 4	Boyd Gaming Corp	波伊德博彩公司	BYD UN	纽约证 券交易 所	美国	311	130,015.00	0.0 1
55 5	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	2,039.0 0	129,740.52	0.0 1
55 6	Univar Solutions Inc	尤尼威尔解决方案 股份有限公司	UNV R UN	纽约证 券交易 所	美国	708	127,971.78	0.0 1

557	Planet Fitness Inc	Planet 健身股份有限公司	PLNTUN	纽约证券交易所	美国	219	126,474.89	0.01
558	Littelfuse Inc	Littelfuse 股份有限公司	LFUSW	纳斯达克证券交易所	美国	63	126,397.23	0.01
559	Scotts Miracle-Gro Co/The	Scotts Miracle-Gro 公司	SMGUN	纽约证券交易所	美国	123	126,257.99	0.01
560	CubeSmart	CubeSmart	CUBEUN	纽约证券交易所	美国	345	125,180.18	0.01
561	LKQ Corp	LKQ 公司	LKQUW	纳斯达克证券交易所	美国	327	125,153.78	0.01
56	Scholastic Corp	Scholastic 公司	SCH	纳	美	483	123,055.35	0.0

2			L UW	斯达克证 券交易 所	国			1
56 3	Hub Group Inc	中心集团	HUB G UW	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美 国	227	121,919.20	0.0 1
56 4	AvalonBay Communities Inc	AvalonBay 社区股 份有限公司	AVB UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	74	119,172.42	0.0 1
56 5	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	118,455.41	0.0 1
56 6	Hain Celestial Group Inc/The	海恩时富集团股份 有限公司	HAI N UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	436	118,447.50	0.0 1



56 7	Nordstrom Inc	诺德斯特龙公司	JWN UN	纽约 证券 交易 所	美国	820	118,259.03	0.0 1
56 8	Safehold Inc	Safehold Inc	SAF E UN	纽约 证券 交易 所	美国	230	117,092.92	0.0 1
56 9	Equity Residential	公寓物业权益信托	EQR UN	纽约 证券 交易 所	美国	202	116,554.17	0.0 1
57 0	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	115,541.71	0.0 1
57 1	Silvergate Capital Corp	Silvergate Capital Corp	SI UN	纽约 证券 交易 所	美国	122	115,275.21	0.0 1
57 2	Interpublic Group of Cos Inc/The	Interpublic 集团	IPG UN	纽约 证券 交	美国	479	114,370.81	0.0 1

				易所				
57 3	BOK Financial Corp	BOK 金融公司	BOK F UW	纳斯达克 证券交易 所	美国	169	113,664.77	0.0 1
57 4	Tyler Technologies Inc	Tyler 科技公司	TYL UN	纽约证 券交易 所	美国	33	113,183.66	0.0 1
57 5	Crown Castle International Corp	冠城国际公司	CCI UN	纽约证 券交易 所	美国	84	111,792.54	0.0 1
57 6	Spirit Airlines Inc	Spirit 航空股份有 限公司	SAV E UN	纽约证 券交易 所	美国	800	111,447.24	0.0 1
57 7	KeyCorp	KeyCorp 公司	KEY UN	纽约证 券交易 所	美国	755	111,339.81	0.0 1

578	Rapid7 Inc	Rapid7 股份有限公司	RPDUQ	纳斯达克证券交易所	美国	148	111,052.71	0.01
579	Cleveland-Cliffs Inc	Cleveland-Cliffs 股份有限公司	CLF UN	纽约证券交易所	美国	799	110,900.39	0.01
580	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	110,890.83	0.01
581	International Flavors & Fragrances Inc	国际香料	IFF UN	纽约证券交易所	美国	115	110,457.41	0.01
582	Upwork Inc	Upwork Inc	UPWK UW	纳斯达克证券交易所	美国	506	110,203.72	0.01
58	Gilead Sciences	吉利德科学	GIL	纳	美	238	110,179.62	0.0

3	Inc		D UW	斯 达 克 证 券 交 易 所	国			1
58 4	Bank OZK	欧扎克银行	OZK UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	368	109,171.37	0.0 1
58 5	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	109,099.45	0.0 1
58 6	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴巴	BAB A UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	144	109,061.19	0.0 1
58 7	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	107,687.87	0.0 1

588	Wolfspeed Inc	Wolfspeed 股份有限公司	WOLF UN	纽约证券交易所	美国	151	107,604.41	0.01
589	HEICO Corp	海科航空公司	HEI/A UN	纽约证券交易所	美国	131	107,342.05	0.01
590	Umpqua Holdings Corp	Umpqua 控股公司	UMP Q UW	纳斯达克证券交易所	美国	855	104,881.54	0.01
591	Discovery Inc	探索通信公司	DIS CK UW	纳斯达克证券交易所	美国	716	104,538.53	0.01
592	Beacon Roofing Supply Inc	Beacon Roofing Supply 股份有限公司	BEC N UW	纳斯达克证券交易所	美国	283	103,477.93	0.01

59 3	Bunge Ltd	邦吉有限公司	BG UN	纽约 证 券 交 易 所	美 国	171	101,785.25	0.0 1
59 4	Upstart Holdings Inc	Upstart Holdings Inc	UPS T UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	105	101,287.56	0.0 1
59 5	CNA Financial Corp	CNA 金融公司	CNA UN	纽约 证 券 交 易 所	美 国	360	101,174.71	0.0 1
59 6	Citi Trends Inc	Citi Trends 股份有 限公司	CTR N UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	167	100,884.30	0.0 1
59 7	Lumen Technologies Inc	Lumen 科技股份有 限公司	LUM N UN	纽约 证 券 交 易 所	美 国	1,259.0 0	100,738.93	0.0 1

598	Sensata Technologies Holding PLC	Sensata Technologies Holding PLC	ST UN	纽约证券交易所	美国	256	100,689.13	0.01
599	Seaboard Corp	Seaboard 公司	SEB UA	纽约证券交易所	美国	4	100,353.77	0.01
600	Garmin Ltd	佳明有限公司	GRM N UN	纽约证券交易所	美国	114	98,972.41	0.01
601	Intercontinental Exchange Inc	洲际交易所 (ICE)	ICE UN	纽约证券交易所	美国	111	96,792.50	0.01
602	Hillenbrand Inc	Hillenbrand 公司	HI UN	纽约证券交易所	美国	292	96,790.01	0.01
603	First Horizon Corp	第一线国民银行	FHN UN	纽约证券交	美国	925	96,306.54	0.01

				易所				
604	Northern Trust Corp	北美信托	NTRS UW	纳斯达克证券交易所	美国	125	95,324.68	0.01
605	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	627	93,942.75	0.01
606	Coinbase Global Inc	Coinbase Global Inc	COIN UW	纳斯达克证券交易所	美国	57	91,715.02	0.01
607	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	88,881.34	0.01
608	Global Industrial Co	Global Industrial 公司	GIC UN	纽约	美国	337	87,878.19	0.01



				证 券 交 易 所				
60 9	BlackRock Inc	贝莱德有限公司	BLK UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	15	87,560.04	0.0 0
61 0	Brink's Co/The	Brink's 公司	BCO UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	208	86,955.37	0.0 0
61 1	Viasat Inc	ViaSat 股份有限公 司	VSA T UN	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	306	86,895.95	0.0 0
61 2	DoorDash Inc	DoorDash Inc	DAS H UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	91	86,390.10	0.0 0
61 3	MasTec Inc	MasTec 股份有限公 司	MTZ UN	纽 约 证 券 交	美 国	146	85,899.04	0.0 0

				易所				
61 4	Sterling Bancorp/DE	Sterling 银行集团	STL UN	纽约证 券交 易所	美国	521	85,667.67	0.0 0
61 5	Plug Power Inc	普拉格动力公司	PLU G UR	纳斯 达克 证 券交 易所	美国	471	84,773.41	0.0 0
61 6	Lazard Ltd	Lazard 有限公司	LAZ UN	纽约证 券交 易所	美国	303	84,286.05	0.0 0
61 7	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	108	84,233.45	0.0 0
61 8	PDC Energy Inc	PDC 能源股份有限公司	PDC E UW	纳斯 达克 证 券交 易所	美国	265	82,416.76	0.0 0

				所				
619	Plexus Corp	Plexus 有限公司	PLXS UN	纳斯达克 证券交易所	美国	128	78,254.83	0.00
620	Norfolk Southern Corp	诺福克南方	NSC UN	纽约证 券交易 所	美国	41	77,822.50	0.00
621	MercadoLibre Inc	Mercadolibre 股份 有限公司	MEL I UN	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	9	77,372.94	0.00
622	Adient PLC	安道拓	ADN T UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	252	76,927.67	0.00
623	Westrock Co	WestRock 公司	WRK UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	268	75,797.38	0.00

624	Snap Inc	Snap 股份有限公司	SNA P UN	纽约 证券 交易 所	美国	250	74,962.29	0.0 0
625	PTC Inc	PTC 公司	PTC UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	97	74,924.36	0.0 0
626	Wynn Resorts Ltd	永利渡假村有限公司	WYN N UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	137	74,279.97	0.0 0
627	PennyMac Financial Services Inc	PennyMac Financial Services Inc	PFS I UN	纽约 证 券 交 易 所	美国	166	73,852.79	0.0 0
628	Ross Stores Inc	Ross 商店有限公司	ROS T UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	101	73,590.11	0.0 0

				所				
629	Sonos Inc	搜诺思	SONO UW	纳斯达克 证券交易 所	美国	386	73,338.40	0.00
630	OneMain Holdings Inc	OneMain 控股股份 有限公司	OMF UN	纽约证 券交易 所	美国	229	73,060.17	0.00
631	Carnival Corp	嘉年华公司	CCL UN	纽约证 券交易 所	美国	569	72,990.80	0.00
632	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	71,444.18	0.00
633	Primerica Inc	Primerica 股份有 限公司	PRI UN	纽约证 券交易 所	美国	73	71,335.86	0.00

634	Vishay Intertechnology Inc	威世公司	VSH UN	纽约证券交易所	美国	499	69,578.84	0.00
635	Honeywell International Inc	霍尼韦尔	HON UN	纳斯达克证券交易所	美国	51	67,796.01	0.00
636	Dow Inc	Dow Inc	DOW UN	纽约证券交易所	美国	185	66,901.50	0.00
637	Valmont Industries Inc	维蒙特工业公司	VMI UN	纽约证券交易所	美国	41	65,481.63	0.00
638	BankUnited Inc	BankUnited 公司	BKU UN	纽约证券交易所	美国	231	62,313.61	0.00
639	AES Corp/The	爱伊斯	AES UN	纽约	美国	400	61,971.80	0.00

				证 券 交 易 所				
64 0	Snap-on Inc	Snap-On 公司	SNA UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	45	61,793.92	0.0 0
64 1	ANSYS Inc	ANSYS 股份有限公 司	ANS S UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	24	61,378.10	0.0 0
64 2	Altra Industrial Motion Corp	Altra Industrial Motion 公司	AIM C UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	181	59,511.87	0.0 0
64 3	Southern Copper Corp	南方铜业公司	SCC O UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	151	59,410.11	0.0 0
64 4	Unisys Corp	优利系统	UIS UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	446	58,492.07	0.0 0

				券交易所				
64 5	Manulife Financial Corp	宏利金融	MFC UN	纽约证 券交易 所	美国	457	55,564.16	0.0 0
64 6	CommScope Holding Co Inc	康普控股股份有限 公司	COM M UW	纳斯达 克证 券交易 所	美国	786	55,324.75	0.0 0
64 7	LendingClub Corp	LendingClub 公司	LC UN	纽约证 券交易 所	美国	350	53,957.55	0.0 0
64 8	Big Lots Inc	Big Lots 公司	BIG UN	纽约证 券交易 所	美国	185	53,136.68	0.0 0
64 9	Twilio Inc	Twilio 股份有限公 司	TWL O UN	纽约证 券交易 所	美国	31	52,048.28	0.0 0



				所				
65 0	PagerDuty Inc	PagerDuty Inc	PD UN	纽约 证券 交易 所	美国	225	49,850.00	0.0 0
65 1	Dollar General Corp	达乐公司	DG UN	纽约 证券 交易 所	美国	33	49,618.18	0.0 0
65 2	Arcosa Inc	Arcosa Inc	ACA UN	纽约 证券 交易 所	美国	146	49,055.91	0.0 0
65 3	Biogen Inc	百健	BII B UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	32	48,949.05	0.0 0
65 4	Masimo Corp	Masimo 公司	MAS I UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	26	48,533.61	0.0 0

65 5	Skechers USA Inc	斯凯奇美国公司	SKX UN	纽约 证 券 交 易 所	美 国	174	48,146.74	0.0 0
65 6	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	42	46,253.54	0.0 0
65 7	AMC Networks Inc	AMC 网络公司	AMC X UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	210	46,111.61	0.0 0
65 8	JELD-WEN Holding Inc	JELD-WEN 控股公司	JEL D UN	纽约 证 券 交 易 所	美 国	271	45,545.20	0.0 0
65 9	MicroStrategy Inc	微策略公司	MST R UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	13	45,129.56	0.0 0

660	UniFirst Corp/MA	UniFirst 公司/马萨诸塞州	UNF UN	纽约 证券 交易 所	美国	32	42,926.31	0.0 0
661	TripAdvisor Inc	猫途鹰股份有限公司	TRI P UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	242	42,059.98	0.0 0
662	Kinder Morgan Inc	特拉华州金德摩根公司	KMI UN	纽约 证 券 交 易 所	美国	415	41,964.22	0.0 0
663	Colgate-Palmolive Co	高露洁棕榄	CL UN	纽约 证 券 交 易 所	美国	77	41,895.87	0.0 0
664	10X Genomics Inc	10X Genomics 股份有限公司	TXG UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	43	40,838.14	0.0 0
66	ViacomCBS Inc	维亚康姆哥伦比亚	VIA	纳	美	207	39,830.66	0.0

5		广播公司	C UW	纳斯达克证 券交易所	国			0
66 6	Cerence Inc	Cerence Inc	CRN C UW	纳斯达克证 券交易所	美国	81	39,579.33	0.0 0
66 7	ModivCare Inc	ModivCare 股份有 限公司	MOD V UW	纳斯达克证 券交易所	美国	41	38,763.55	0.0 0
66 8	ABM Industries Inc	ABM Industries 公 司	ABM UN	纽约证 券交易所	美国	147	38,285.76	0.0 0
66 9	Chemed Corp	Chemed 公司	CHE UN	纽约证 券交易所	美国	11	37,103.00	0.0 0

67 0	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	34,797.30	0.0 0
67 1	Covetrus Inc	Covetrus Inc	CVE T UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	272	34,631.78	0.0 0
67 2	Zynga Inc	Zynga 股份有限公司	ZNG A UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	778	31,745.89	0.0 0
67 3	Oramed Pharmaceuticals Inc	Oramed 医药股份有限公司	ORM P UR	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	344	31,319.48	0.0 0
67 4	Cinemark Holdings Inc	喜满客控股公司	CNK UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	304	31,243.99	0.0 0

675	Peloton Interactive Inc	Peloton Interactive Inc	PTON	纳斯达克证券交易所	美国	131	29,867.35	0.00
676	Aspen Technology Inc	艾斯本科技公司	AZPN	纳斯达克证券交易所	美国	29	28,141.06	0.00
677	Stanley Black & Decker Inc	史丹利百得公司	SWKUN	纽约证券交易所	美国	21	25,254.28	0.00
678	News Corp	新闻集团	NWSUN	纳斯达克证券交易所	美国	172	24,673.96	0.00
679	Pinterest Inc	Pinterest 股份有限公司	PINSUN	纽约证券交易所	美国	106	24,566.21	0.00

				所				
680	AstraZeneca PLC	阿斯利康公共有限公司	AZNUW	纳斯达克证券交易所	美国	66	24,511.38	0.00
681	Wayfair Inc	Wayfair 股份有限公司	WUN	纽约证券交易所	美国	19	23,012.64	0.00
682	AZEK Co Inc/The	AZEK Co Inc/The	AZEKUN	纽约证券交易所	美国	77	22,700.55	0.00
683	QIAGEN NV	德国 QIAGEN 公共有限公司	QGENUN	纽约证券交易所	美国	64	22,679.13	0.00
684	Dolby Laboratories Inc	杜比实验室有限公司	DLBUN	纽约证券交易所	美国	37	22,462.48	0.00
68	Teleflex Inc	泰利福公司	TFX	纽	美	10	20,942.90	0.0

5			UN	约 证 券 交 易 所	国			0
68 6	iHeartMedia Inc	iHeartMedia 股份 有限公司	IHR T UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	156	20,926.58	0.0 0
68 7	Cardinal Health Inc	嘉德诺健康集团	CAH UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	58	19,040.52	0.0 0
68 8	Yum China Holdings Inc	百胜中国	YUM C UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	56	17,794.83	0.0 0
68 9	Owens & Minor Inc	Owens & Minor 公司	OMI UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	63	17,472.61	0.0 0
69 0	Groupon Inc	Groupon 股份有限 公司	GRP N UW	纳 斯 达 克	美 国	118	17,424.02	0.0 0



				证 券 交 易 所				
69 1	LPL Financial Holdings Inc	LPL 金融控股公司	LPL A UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	17	17,351.66	0.0 0
69 2	ABIOMED Inc	Abiomed 股份有限 公司	ABM D UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	7	16,029.72	0.0 0
69 3	SkyWest Inc	SkyWest 股份有限 公司	SKY W UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	63	15,785.60	0.0 0
69 4	Magnite Inc	Magnite 股份有限 公司	MGN I UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	134	14,951.02	0.0 0

69 5	Five Below Inc	Five Below 股份有限公司	FIVE UW	纳斯达克 证券交易 所	美国	10	13,190.69	0.0 0
69 6	Coupa Software Inc	Coupa 软件股份有限公司	COU P UW	纳斯达克 证券交易 所	美国	12	12,092.15	0.0 0
69 7	Fair Isaac Corp	费埃哲公司	FIC O UN	纽约证 券交易 所	美国	4	11,059.80	0.0 0
69 8	Zillow Group Inc	Zillow 股份有限公司	Z UW	纳斯达克 证券交易 所	美国	27	10,991.39	0.0 0
69 9	RingCentral Inc	RingCentral 股份有限公司	RNG UN	纽约证 券交易 所	美国	8	9,555.90	0.0 0

				所				
70 0	Universal Display Corp	美国通用显示器公司	OLE D UN	纳斯达克 证券交易 所	美国	9	9,469.64	0.0 0
70 1	Eastman Chemical Co	伊士曼化工	EMN UN	纽约证 券交易 所	美国	10	7,708.86	0.0 0
70 2	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	7,292.97	0.0 0
70 3	Yelp Inc	Yelp 公司	YEL P UN	纽约证 券交易 所	美国	22	5,083.22	0.0 0
70 4	Chegg Inc	Chegg 股份有限公司	CHG G UN	纽约证 券交易 所	美国	20	3,914.68	0.0 0
70	Trip.com Group Ltd	携程集团	TCO	纳	美	22	3,453.33	0.0

5			M U W	斯达克证 券交易 所	国			0
70 6	Churchill Inc	Downs 丘吉尔唐 斯股份有 限公司	CHD N U W	纳斯 达克证 券交易 所	美国	2	3,071.81	0.0 0
70 7	Brunswick Corp/DE	布伦兹威 克	BC UN	纽约证 券交易 所	美国	3	1,926.67	0.0 0
70 8	WEX Inc	WEX 股份 有限公司	WEX UN	纽约证 券交易 所	美国	1	895.08	0.0 0
70 9	Howard Corp/The	Hughes 霍华德休 斯公司	HHC UN	纽约证 券交易 所	美国	1	648.92	0.0 0
71 0	PACCAR Inc	帕卡	PCA R U W	纳斯 达克证 券交易 所	美国	1	562.72	0.0 0

				达克 证券 交易所				
71 1	Altice USA Inc	美国 Altice 公司	ATU S UN	纽约 证券 交易所	美国	2	206.32	0.0 0

注：本表所使用的证券代码为彭博代码。

## 8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	Apple Inc	AAPL UW	48,750,528.59	4.66
2	Microsoft Corp	MSFT UW	37,783,341.26	3.61
3	Alphabet Inc	GOOGL UW	32,025,135.08	3.06
4	NVIDIA Corp	NVDA UW	29,864,973.11	2.85
5	Tesla Inc	TSLA UW	18,214,961.95	1.74
6	Home Depot Inc/The	HD UN	17,741,005.14	1.69
7	Meta Platforms Inc	FB UW	16,961,052.32	1.62
8	Advanced Micro Devices Inc	AMD UR	14,666,978.80	1.40
9	QUALCOMM Inc	QCOM UW	13,006,874.93	1.24
10	Adobe Inc	ADBE UW	11,680,697.98	1.12
11	Costco Wholesale Corp	COST UW	10,190,404.03	0.97
12	Eli Lilly & Co	LLY UN	8,074,457.39	0.77
13	Intuit Inc	INTU UW	7,686,594.13	0.73
14	Oracle Corp	ORCL UN	7,560,167.84	0.72
15	Amazon.com Inc	AMZN UW	7,541,474.03	0.72
16	Blackstone Inc	BX UN	7,362,975.81	0.70
17	Broadcom Inc	AVGO UW	7,206,156.76	0.69
18	Lowe's Cos Inc	LOW UN	7,178,633.82	0.69

19	Netflix Inc	NFLX UW	7,090,901.89	0.68
20	Fortinet Inc	FTNT UW	6,442,660.64	0.62

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	UnitedHealth Group Inc	UNH UN	15,260,301.95	1.46
2	Apple Inc	AAPL UW	15,225,139.55	1.45
3	Microsoft Corp	MSFT UW	14,307,851.69	1.37
4	Amazon.com Inc	AMZN UW	13,254,947.81	1.27
5	PayPal Holdings Inc	PYPL UW	10,945,837.81	1.05
6	Tesla Inc	TSLA UW	9,162,711.54	0.88
7	Block Inc	SQ UN	8,122,767.32	0.78
8	QUALCOMM Inc	QCOM UW	7,554,010.02	0.72
9	Meta Platforms Inc	FB UW	6,950,290.13	0.66
10	NVIDIA Corp	NVDA UW	6,408,099.52	0.61
11	Netflix Inc	NFLX UW	6,249,267.72	0.60
12	Mastercard Inc	MA UN	6,085,087.72	0.58
13	Visa Inc	V UN	6,022,184.44	0.58
14	Adobe Inc	ADBE UW	5,999,604.91	0.57
15	Avis Budget Group Inc	CAR UW	5,458,940.34	0.52
16	NIKE Inc	NKE UN	5,344,874.84	0.51
17	Charter Communications Inc	CHTR UW	5,300,151.34	0.51
18	Thermo Fisher Scientific Inc	TMO UN	4,798,160.14	0.46
19	Costco Wholesale Corp	COST UW	4,779,071.15	0.46
20	salesforce.com Inc	CRM UN	4,735,684.03	0.45

### 8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	957,881,361.28
卖出收入（成交）总额	538,449,476.80

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

### 8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

无。

## 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

无。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

无。

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

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	SPDR Gold Shares	ETF	交易型开放式	World Gold Trust Services LLC	2,308,598.13	0.13
2	iShares 20+ Year Treasury Bond ETF	ETF	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	151,170.40	0.01
3	VanEck Gold Miners ETF/USA	ETF	交易型开放式	Van Eck Associates Corp	87,811.88	0.01
4	ARK Next Generation Internet ETF	ETF	交易型	ARK Investment Management LLC	80,895.26	-

			开放式			
5	iPath Series B S&P 500 VIX Short-Term Futures ETN	ETN	交易型开放式	Barclays Capital Inc	76,910.26	-
6	ARK Innovation ETF	ETF	交易型开放式	ARK Investment Management LLC	73,575.45	-
7	ARK Autonomous Technology & Robotics ETF	ETF	交易型开放式	ARK Investment Management LLC	64,320.04	-
8	ARK Fintech Innovation ETF	ETF	交易型开放式	ARK Investment Management LLC	52,870.81	-

注：报告期末，本基金仅持有上述 8 支基金。

## 8.11 投资组合报告附注

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

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。

### 8.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-



3	应收股利	272,255.93
4	应收利息	11,797.88
5	应收申购款	7,464,249.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,748,303.00

#### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（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（%）
嘉实美国成长股票票型证券投资基金-人民	222,062	2,199.84	123,331,076.89	25.25	365,169,670.77	74.75

币						
嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇	632	7,757.60	-	-	4,902,802.17	100.00
合计	222,627	2,216.28	123,331,076.89	25.00	370,072,472.94	75.00

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。

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币	87,140.80	0.02
	嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇	-	-

	合计	87,140.80	0.02
--	----	-----------	------

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实美国成长股票型证券投资基金-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	498,996,684.38	3,288,763.63
减：本报告期基金总赎回份额	368,253,710.11	1,871,291.36
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	488,500,747.66	4,902,802.17

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

## 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

### (1) 基金管理人的重大人事变动情况

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。

2021 年 7 月 23 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》，龚康先生任公司副总经理。

### (2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

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。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。报告年度应支付普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的审计费 101,000.00 元，该审计机构已连续 9 年为本基金提供审计服务。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
瑞士信贷(香港)有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	911,990,346.16	61.60%	117,993.07	22.88%	-

野村证券 NOMURA	-	568,046,424.07	38.37%	397,632.91	77.09%	-
瑞银集团 Union Bank of Switzerland	-	369,974.34	0.02%	155.34	0.03%	-
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	-	-	-	-	-	-
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。

## 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
野村证券 NOMURA	-	-	-	-	-	-	6,133,021.36	50.21%
瑞士信贷（香港）有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	6,081,847.10	49.79%

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于嘉实美国成长股票（QDII）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1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3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5月7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5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5月29日
6	关于嘉实美国成长股票（QDII）2021年7月5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7月1日
7	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7月23日
8	关于嘉实美国成长股票（QDII）2021年9月6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9月2日
9	嘉实基金管理有限公司关于继续在网上直销开展基金认购、申购、转换费率优惠活动的公告	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9月28日

10	嘉实基金管理有限公司关于旗下部分公募基金参与北京证券交易所股票投资及相关风险提示的公告	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 11 月 16 日
11	关于嘉实美国成长股票（QDII）2021 年 11 月 25 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 11 月 23 日
12	嘉实基金管理有限公司关于对中信银行借记卡持卡人开通网上直销电子支付业务的公告	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 12 月 3 日
13	嘉实基金管理有限公司关于对中国邮政储蓄银行借记卡持卡人开通网上直销电子支付业务的公告	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 12 月 3 日
14	关于嘉实美国成长股票（QDII）2021 年 12 月 24 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 12 月 22 日
15	嘉实基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善客户身份信息的公告	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 12 月 24 日

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

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

### 12.3 查阅方式

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

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

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

嘉实基金管理有限公司

2022 年 3 月 30 日