

嘉实美国成长股票型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	47
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	47
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	47

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	100
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	102
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	102
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	102
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	102
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	102
7.11 投资组合报告附注.....	104
§8 基金份额持有人信息.....	104
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	104
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	105
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	105
§9 开放式基金份额变动.....	106
§10 重大事件揭示.....	106
10.1 基金份额持有人大会决议.....	106
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	106
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	106
10.4 基金投资策略的改变.....	107
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	107
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	107
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	107
10.8 其他重大事件.....	110
§11 备查文件目录.....	110
11.1 备查文件目录.....	110
11.2 存放地点.....	110
11.3 查阅方式.....	111

§ 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	446,894,271.27 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	441,932,853.00 份	4,961,418.27 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司	
信息披露 负责人	姓名	胡勇钦	许俊
	联系电话	(010)65215588	95566
	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 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年01月01日-2022年06月30日)	
	嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币	嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇
本期已实现收益	3,230,259.40	237,116.22
本期利润	-354,488,475.73	-22,716,663.87
加权平均基金份额本期利润	-0.7887	-4.6394
本期加权平均净值利润率	-26.67%	-25.75%

本期基金份额净值增长率	-22.26%	-26.15%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
期末可供分配利润	300,170,669.25	24,318,031.30
期末可供分配基金份额利润	0.6792	4.9014
期末基金资产净值	1,161,808,682.05	79,556,885.12
期末基金份额净值	2.629	2.389
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	162.90%	138.90%

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

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

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

（4）嘉实美国成长股票(QDII)美元现汇的期末基金份额净值单位为美元。

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
过去一个月	-9.13%	2.04%	-7.59%	2.18%	-1.54%	-0.14%
过去三个月	-15.33%	1.98%	-20.11%	2.09%	4.78%	-0.11%

过去六个月	-22.26%	1.85%	-27.09%	1.93%	4.83%	-0.08%
过去一年	-13.58%	1.47%	-18.41%	1.49%	4.83%	-0.02%
过去三年	32.91%	1.60%	37.29%	1.60%	-4.38%	0.00%
自基金合同生效起 至今	162.90%	1.18%	183.07%	1.15%	-20.17%	0.03%

嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标准 差④	①-③	②-④
过去一个月	-9.82%	2.00%	-7.59%	2.18%	-2.23%	-0.18%
过去三个月	-19.91%	1.97%	-20.11%	2.09%	0.20%	-0.12%
过去六个月	-26.15%	1.82%	-27.09%	1.93%	0.94%	-0.11%
过去一年	-16.79%	1.45%	-18.41%	1.49%	1.62%	-0.04%
过去三年	36.13%	1.58%	37.29%	1.60%	-1.16%	-0.02%
自基金合同生效起 至今	138.90%	1.16%	183.07%	1.15%	-44.17%	0.01%

注：本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

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

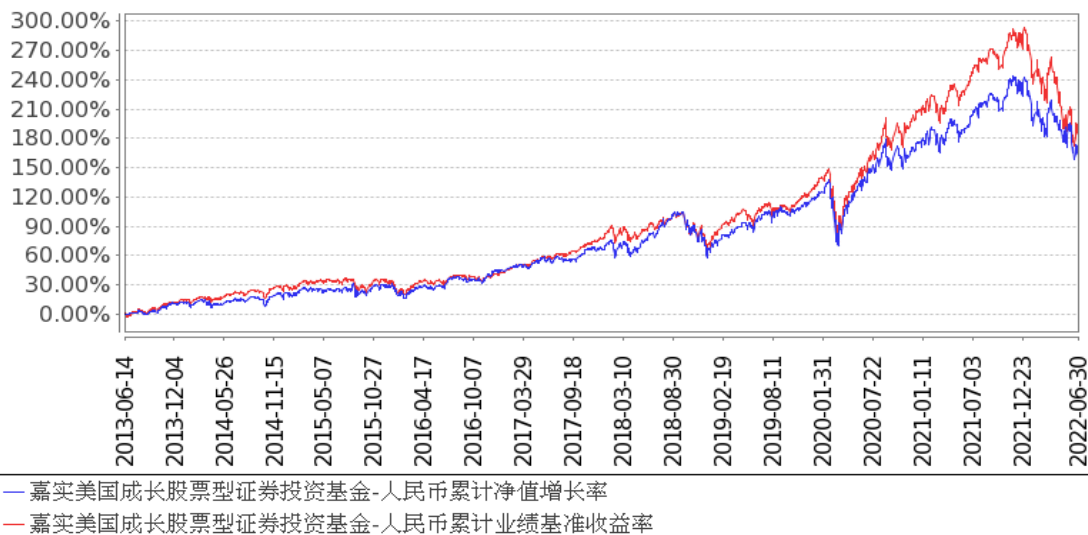
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

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

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

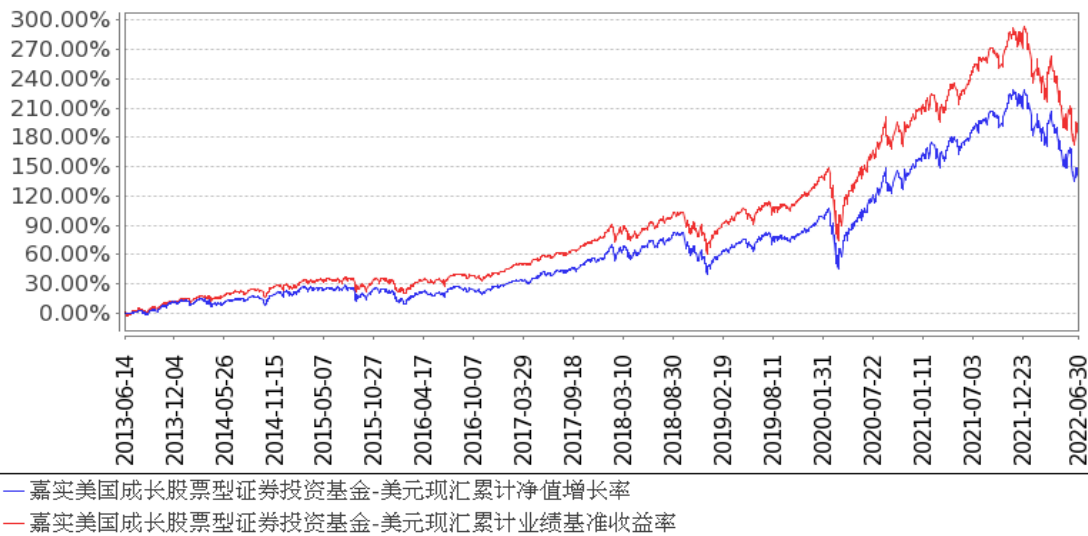
嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013年06月14日至2022年06月30日)



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

(2013年06月14日至2022年06月30日)



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

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5 号文批准，于 1999 年 3 月 25 日成立，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 2022 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 277 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	-	26 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行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的，合计 4 次，其中 1 次为旗下组合被动跟踪模拟组合权重配置需要与其他组合发生反向交易，另 3 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 上半年，在报告期内，全球较为重大的经济事件，为美联储在量化宽松退出操作并缩表的进程中，达到了单次加息 75bps 的强度，并吹风将在随后的三季度内进一步保持如此强度的加息节奏。新冠疫情已进入第三年，部分国家已经逐步放松或进一步宣称与新冠共存，但新变种对社会秩序和经济复苏进程的持续影响依然存在，国内核心经济区包括上海北京也先后经历了疫情的反弹和管控应对过程。二月下旬爆发的俄乌冲突尚未看到明确的妥协空间和终止路径，但对国际资源能源及农业等基础大宗商品的影响则持续存在。

就美股而言，2022 年一季度，美国股票市场在开年后开始持续下行，短暂离开各大股指持续多年的强势上行轨迹，并在三月份中旬重拾上行趋势；二季度，美国股票市场延续了开年后一季度的持续下行，在二季度内继续回调，至 6 月中旬的上半年累积回调幅度已经达到近几年的最大值。结构上，价值风格显著占优，且扭曲强度较大。一季度内，大盘价值指数罗素 1000 价值超越同期大盘成长指数罗素 1000 成长达到 8%以上，小市值内价值相对成长风格的超额收益接近 10%，分化显著。美股在 2021 年初就逐步显现了价值风格的回暖，并在 2022 年随着大宗商品价格上行，拉动产业链相关上游板块的盈利上行，通胀交易与价值风格有所叠加。

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 2.629 元，本报告期基金份额净值增长率为-22.26%；截至本报告期末嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇基金份额净值为 2.389 美元，本报告期基金份额净值增长率为-26.15%；业绩比较基准收益率为-27.09%。

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，在各个大类资产配置中，权益类资产是相对较好的配置方向，在全球基础能源矿产材料和农产品价格上升以及近年的过度宽松的货币政策累积效果下，经济高通胀显现，美联储坚持货币缩紧进程，在大类资产中明显的相对性的利好权益类资产。其次，对权益类资产，美股股票的估值水平目前有所偏高，但尚未达到泡沫区域，在投资组合建立过程中会更加注重风格方向和结构配置，规避过高估值的区域。

美国宏观经济层面，国内的通胀指标 PCE，在二季度中期连续三期保持稳定略降，市场对通胀的担忧已经退居第二位，排在首位的则是对美国经济是否会陷入衰退的担忧，即在“滞胀”之中，已经从担心“胀”进一步转移到“滞”，在进入三季度的数据显示通胀依然高位且有所抬头。实际上，当前美国非政府部门资产负债表状况相对较为健康，至少不会面临较大的债务危机风险，大概率不会出现类似 2008 年金融危机的深度衰退。因而在当前“经济增长放缓，但未进入衰退”的大背景下，当美联储政策完成既定目标之后，如通胀出现拐点、且联邦基金利率有效超过中性利率时，联储的货币政策同时也达到退坡甚至转向的话，那么市场则可以进入增长放缓且政策宽松的交易逻辑，在当前通胀和长远的利率抬升大周期内，权益类资产是较好的配置选择。就相对比较而言，面临油气资源、矿产资源与农产品等短缺风险的欧洲，将比美国更需要担心衰退风险。

在行业层面，我们依然倾向于成长风格，科技、生物等依然是投资者最关注的区域。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金

份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实美国成长股票型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	95,327,471.60	386,008,961.82
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,153,947,569.64	1,651,141,851.14
其中：股票投资		1,148,727,831.42	1,648,245,698.91
基金投资		5,219,738.22	2,896,152.23
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		515,665.87	272,255.93
应收申购款		7,670,514.77	7,464,249.19
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	11,797.88
资产总计		1,257,461,221.88	2,044,899,115.96
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	255,695,400.05
应付赎回款		13,594,234.04	32,855,556.73

应付管理人报酬		1,884,182.90	2,202,834.89
应付托管费		366,368.90	428,329.00
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	250,868.87	339,386.41
负债合计		16,095,654.71	291,521,507.08
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	472,488,941.28	518,693,260.29
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	768,876,625.89	1,234,684,348.59
净资产合计		1,241,365,567.17	1,753,377,608.88
负债和净资产总计		1,257,461,221.88	2,044,899,115.96

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币基金份额净值 2.629 元，基金份额总额 441,932,853.00 份，嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇基金份额净值 2.389 美元，基金份额总额 4,961,418.27 份，基金份额总额合计为 446,894,271.27 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实美国成长股票型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-361,910,440.85	109,641,059.65
1. 利息收入		107,063.45	77,626.76
其中：存款利息收入	6.4.7.13	107,063.45	77,626.76
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		14,386,359.92	57,895,425.84
其中：股票投资收益	6.4.7.14	7,807,448.40	54,632,953.93
基金投资收益	6.4.7.15	-7,731.34	161,199.88
债券投资收益	6.4.7.16	-	-
资产支持证券投资收	6.4.7.17	-	-

益			
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	6,586,642.86	3,101,272.03
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-380,672,515.22	51,190,799.00
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		3,479,792.14	-325,117.49
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	788,858.86	802,325.54
减：二、营业总支出		15,294,698.75	11,409,343.28
1. 管理人报酬		12,710,047.07	9,218,850.72
2. 托管费		2,471,397.99	1,792,554.30
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		-	524.02
8. 其他费用	6.4.7.24	113,253.69	397,414.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-377,205,139.60	98,231,716.37
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-377,205,139.60	98,231,716.37
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-377,205,139.60	98,231,716.37

6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基	518,693,260.29	-	1,234,684,348.59	1,753,377,608.88

金净值)				
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	518,693,260.29	-	1,234,684,348.59	1,753,377,608.88
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-46,204,319.01	-	-465,807,722.70	-512,012,041.71
(一)、综合收益总额	-	-	-377,205,139.60	-377,205,139.60
(二)、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)	-46,204,319.01	-	-88,602,583.10	-134,806,902.11
其中:1.基金申购款	176,014,811.29	-	342,764,476.85	518,779,288.14
2.基金赎回款	-222,219,130.30	-	-431,367,059.95	-653,586,190.25
(三)、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)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	472,488,941.28	-	768,876,625.89	1,241,365,567.17
项目	上年度可比期间			
	2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	379,227,706.27	-	667,541,781.53	1,046,769,487.80
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	379,227,706.27	-	667,541,781.53	1,046,769,487.80
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-26,198,404.04	-	52,379,409.46	26,181,005.42
(一)、综合收益总额	-	-	98,231,716.37	98,231,716.37
(二)、本期基金份额	-26,198,404.04	-	-45,852,306.91	-72,050,710.95

交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）				
其中：1. 基金申购款	202,887,484.12	-	375,521,289.73	578,408,773.85
2. 基金赎回款	-229,085,888.16	-	-421,373,596.64	-650,459,484.80
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	353,029,302.23	-	719,921,190.99	1,072,950,493.22

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

经雷

基金管理人负责人

梁凯

主管会计工作负责人

李袁

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实美国成长股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

除下述变更的会计政策外,本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具,是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时,确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类

取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资 and 基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具（主要为股票投资）按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债的分类

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

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则（截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则）

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(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。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认

后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息扣除在交易所在地适用的预缴所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利扣除基金交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。

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

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

6.4.4.4 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。

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《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》及《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”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、应收利息、应收股利和应收申购款，金额分别为 386,008,961.82 元、11,797.88 元、272,255.93 元和 7,464,249.19 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、其他资产-应收利息、应收股利和应收申购款，金额分别为 386,014,752.82 元、0.00 元、272,255.93 元和 7,470,256.07 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 1,651,141,851.14 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 1,651,141,851.14 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人

报酬、应付托管费和其他负债-其他应付款，金额分别为 255,695,400.05 元、32,855,556.73 元、2,202,834.89 元、428,329.00 元和 339,386.41 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费和其他负债-其他应付款，金额分别为 255,695,400.05 元、32,855,556.73 元、2,202,834.89 元、428,329.00 元和 339,386.41 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税

的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	95,327,471.60
等于：本金	95,321,399.31
加：应计利息	6,072.29
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	95,327,471.60

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,096,931,530.42	-	1,148,727,831.42	51,796,301.00
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	6,189,219.33	-	5,219,738.22	-969,481.11
其他	-	-	-	-
合计	1,103,120,749.75	-	1,153,947,569.64	50,826,819.89

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	40,276.99
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	210,591.88
合计	250,868.87

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	488,500,747.66	488,500,747.66
本期申购	170,878,328.17	170,878,328.17
本期赎回（以“-”号填列）	-217,446,222.83	-217,446,222.83
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	441,932,853.00	441,932,853.00

嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,902,802.17	30,192,512.63
本期申购	833,913.40	5,136,483.12
本期赎回（以“-”号填列）	-775,297.30	-4,772,907.47
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	4,961,418.27	30,556,088.28

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	328,137,384.25	835,626,477.98	1,163,763,862.23
本期利润	3,230,259.40	-357,718,735.13	-354,488,475.73
本期基金份额交易产生的变动数	-31,196,974.40	-58,202,583.05	-89,399,557.45
其中：基金申购款	116,743,105.04	215,931,823.48	332,674,928.52
基金赎回款	-147,940,079.44	-274,134,406.53	-422,074,485.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	300,170,669.25	419,705,159.80	719,875,829.05

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
本期期初	23,805,681.19	47,114,805.17	70,920,486.36
本期利润	237,116.22	-22,953,780.09	-22,716,663.87
本期基金份额交易产生的变动数	275,233.89	521,740.46	796,974.35
其中：基金申购款	4,091,206.19	5,998,342.14	10,089,548.33
基金赎回款	-3,815,972.30	-5,476,601.68	-9,292,573.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	24,318,031.30	24,682,765.54	49,000,796.84

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	106,234.56
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	828.89
合计	107,063.45

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	7,807,448.40
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	7,807,448.40

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	457,494,620.33
减：卖出股票成本总额	449,355,968.81
减：交易费用	331,203.12
买卖股票差价收入	7,807,448.40

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	70,106.44
减：卖出/赎回基金成本总额	76,140.38
减：买卖基金差价收入应缴纳增值 税额	-
减：交易费用	1,697.40
基金投资收益	-7,731.34

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	6,586,015.63
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	627.23
合计	6,586,642.86

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	-380,672,515.22
股票投资	-379,771,099.74
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-901,415.48
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	-380,672,515.22

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	788,858.86
合计	788,858.86

6.4.7.23 信用减值损失

无。

6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	50,084.51

信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	3,661.81
合计	113,253.69

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	12,710,047.07	9,218,850.72
其中：支付销售机构的客户维护费	4,116,475.82	1,727,455.55

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,471,397.99	1,792,554.30

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

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司活期	95,327,471.60	106,234.56	77,275,732.04	77,342.15

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本期(2022年1月1日至2022年6月30日),本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理**6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金主要投资于美国大盘成长型股票，属于主动投资的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金与混合型基金，为证券投资基金中的较高预期风险、较高预期收益

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	95,327,471.60	-	-	-	95,327,471.60
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-1,153,947,569.64	1,153,947,569.64
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	515,665.87	515,665.87
应收申购款	-	-	-	7,670,514.77	7,670,514.77
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	95,327,471.60	-	-	-1,162,133,750.28	1,257,461,221.88
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-

衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	13,594,234.04	13,594,234.04
应付管理人报酬	-	-	-	1,884,182.90	1,884,182.90
应付托管费	-	-	-	366,368.90	366,368.90
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	250,868.87	250,868.87
负债总计	-	-	-	16,095,654.71	16,095,654.71
利率敏感度缺口	95,327,471.60	-	-	-1,146,038,095.57	1,241,365,567.17
上年度末 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

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

无。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
银行存款	39,520,388.04	-	-	39,520,388.04
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	1,153,947,569.64	-	-	1,153,947,569.64
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	513,464.96	-	2,200.91	515,665.87
应收申购款	567,153.37	-	-	567,153.37

应收清算款	-	-	-	-
其它资产	-	-	-	-
资产合计	1,194,548 ,576.01	-	2,200.91	1,194,550,776.92
以外币计价的 负债				
应付清算款	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
应付赎回款	103,678.5 1	-	-	103,678.51
应付管理人报 酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务 费	-	-	-	-
应付投资顾问 费	-	-	-	-
其他负债	235.91	-	-	235.91
负债合计	103,914.4 2	-	-	103,914.42
资产负债表外 汇风险敞口净 额	1,194,444 ,661.59	-	2,200.91	1,194,446,862.50
项目	上年度末 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	-	-	1,651,141,851.14

	, 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, 3 29. 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

6. 4. 13. 4. 2. 2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的	

	动	影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	所有外币相对人民币升值 5%	59,722,343.13	84,303,880.53
	所有外币相对人民币贬值 5%	-59,722,343.13	-84,303,880.53

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021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	1,148,727,831.42	92.54	1,648,245,698.91	94.00
交易性金融资产—基金投资	5,219,738.22	0.42	2,896,152.23	0.17
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	1,153,947,569.64	92.96	1,651,141,851.14	94.17

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准以外的其他市场变量保持不变	
	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准上升 5%	57,970,298.07	94,845,261.59
	业绩比较基准下降 5%	-57,970,298.07	-94,845,261.59

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	1,153,947,569.64	1,651,141,851.14
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	1,153,947,569.64	1,651,141,851.14

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本报告中资产负债表和利润表的上期比较数据，已根据本年《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〉》中的格式要求进行列示调整。其中：

原“应收利息”、“其他资产”项目，合并列示在“其他资产”项目；

原“应付交易费用”、“应付利息”、“其他负债”项目，合并列示在“其他负债”项目；

原“交易费用”、“其他费用”项目，合并列示在“其他费用”项目。

§ 7 投资组合报告**7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,148,727,831.42	91.35
	其中：普通股	1,133,430,058.73	90.14
	存托凭证	5,393,648.22	0.43
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	9,904,124.47	0.79
2	基金投资	5,219,738.22	0.42
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	95,327,471.60	7.58
8	其他各项资产	8,186,180.64	0.65
9	合计	1,257,461,221.88	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
美国	1,148,727,831.42	92.54
合计	1,148,727,831.42	92.54

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
信息技术	448,293,056.23	36.11
非必需消费品	159,549,573.20	12.85
医疗保健	104,803,878.75	8.44
通信服务	101,624,204.69	8.19
金融	89,064,722.96	7.17
能源	72,390,865.71	5.83
必需消费品	67,049,037.01	5.40
工业	62,563,740.16	5.04
原材料	27,304,326.16	2.20
公用事业	4,977,289.94	0.40
房地产	1,203,012.14	0.10
房地产信托特殊类	4,001,410.44	0.32
房地产信托零售类	3,146,870.16	0.25
房地产信托工业类	1,593,667.37	0.13
房地产信托住宅类	923,211.33	0.07
房地产信托抵押类	135,414.17	0.01
房地产信托酒店及度假村类	103,551.00	0.01
合计	1,148,727,831.42	92.54

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	Apple Inc	苹果公司	AAPL UW	纳斯达克证券交易所	美国	129,502	118,828,782.90	9.57
2	Microsoft Corp	微软	MSFT UW	纳斯达克证券交易所	美国	64,508	111,191,721.11	8.96
3	Alphabet Inc	Alphabet 公司	GOOGL UW	纳斯达克证券	美国	4,728	69,151,186.95	5.57

				交易所				
4	Amazon. com Inc	亚马逊公司	AMZN UW	纳斯达克证券交易所	美国	63,667	45,382,970.49	3.66
5	Tesla Inc	特斯拉公司	TSLA UW	纳斯达克证券交易所	美国	8,727	39,442,470.55	3.18
6	NVIDIA Corp	英伟达	NVDA UW	纳斯达克证券交易所	美国	30,343	30,870,395.51	2.49
7	Costco Wholesale Corp	开市客	COST UW	纳斯达克证券交易所	美国	6,965	22,403,896.15	1.80
8	Meta Platforms Inc	Meta 平台股份有限公司	META UW	纳斯达克证券交易所	美国	20,089	21,740,581.98	1.75
9	Broadcom Inc	博通股份有限公司	AVGO UW	纳斯达克证券交易所	美国	5,918	19,295,433.25	1.55
10	AbbVie Inc	艾伯维公司	ABBV UN	纽约证券交易所	美国	17,108	17,585,621.55	1.42
11	Visa Inc	维萨公司	V UN	纽约证券交易所	美国	12,003	15,860,854.77	1.28
12	Mastercard Inc	万事达股份有限公司	MA UN	纽约证券交易所	美国	7,063	14,954,577.99	1.20
13	Eli Lilly & Co	礼来	LLY UN	纽约证券交易所	美国	6,783	14,760,060.48	1.19
14	Home Depot Inc/The	家得宝	HD UN	纽约证券交易所	美国	7,427	13,671,143.88	1.10
15	Advanced Micro Devices Inc	AMD 公司	AMD UR	纳斯达克证券交易所	美国	24,454	12,550,300.42	1.01
16	Coca-Cola Co/The	可口可乐	KO UN	纽约证券交易所	美国	27,129	11,454,248.33	0.92
17	McKesson Corp	McKesson 公司	MCK UN	纽约证券交易所	美国	4,958	10,854,677.29	0.87

		司		所				
18	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM UW	纳斯达克证券交易所	美国	12,572	10,778,154.57	0.87
19	Berkshire Hathaway Inc	伯克希尔哈撒韦公司	BRK/B UN	纽约证券交易所	美国	5,421	9,933,149.99	0.80
20	UnitedHealth Group Inc	联合健康集团	UNH UN	纽约证券交易所	美国	2,853	9,834,794.22	0.79
21	Oracle Corp	甲骨文	ORCL UN	纽约证券交易所	美国	17,012	7,977,360.91	0.64
22	CVS Health Corp	CVS 保健公司	CVS UN	纽约证券交易所	美国	12,013	7,470,624.31	0.60
23	Lowe's Cos Inc	劳氏	LOW UN	纽约证券交易所	美国	6,234	7,307,995.00	0.59
24	Exxon Mobil Corp	埃克森美孚石油	XOM UN	纽约证券交易所	美国	11,247	6,464,374.04	0.52
25	PepsiCo Inc	百事可乐	PEP UW	纳斯达克证券交易所	美国	5,347	5,980,736.73	0.48
26	Chevron Corp	雪佛龙	CVX UN	纽约证券交易所	美国	6,031	5,860,180.92	0.47
27	Cheniere Energy Inc	Cheniere 能源公司	LNG UA	纽约证券交易所	美国	6,523	5,823,848.83	0.47
28	American Express Co	美国运通	AXP UN	纽约证券交易所	美国	6,246	5,810,867.84	0.47
29	Adobe Inc	奥多比	ADBE UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,295	5,638,298.82	0.45
30	Pfizer Inc	辉瑞制药	PFE UN	纽约证券交易所	美国	15,060	5,299,293.25	0.43
31	NIKE Inc	耐克公司	NKE UN	纽约证券交易所	美国	7,703	5,283,526.83	0.43
32	Blackston	黑石集	BX UN	纽约证	美国	8,442	5,168,876.39	0.42

	e Inc	团股份 有限公司		券交易 所				
33	Merck & Co Inc	默克	MRK UN	纽约证 券交易 所	美国	8,325	5,093,887.16	0.41
34	KLA Corp	KLA 公 司	KLAC UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,140	4,582,753.32	0.37
35	Applied Materials Inc	应用材 料	AMAT UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	7,473	4,563,037.50	0.37
36	Devon Energy Corp	戴文能 源	DVN UN	纽约证 券交易 所	美国	12,047	4,455,766.71	0.36
37	Antero Resources Corp	Antero 资源公 司	AR UN	纽约证 券交易 所	美国	21,417	4,405,571.35	0.35
38	Ameripris e Financial Inc	阿默普 莱斯金 融公司	AMP UN	纽约证 券交易 所	美国	2,644	4,217,617.72	0.34
39	Albertson s Cos Inc	艾伯森 股份有 限公司	ACI UN	纽约证 券交易 所	美国	23,505	4,215,118.93	0.34
40	Ovintiv Inc	Ovinti v 股份 有限公司	OVV UN	纽约证 券交易 所	美国	14,020	4,158,006.26	0.33
41	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	3,374	4,133,483.88	0.33
42	Union Pacific Corp	联合太 平洋	UNP UN	纽约证 券交易 所	美国	2,885	4,129,610.33	0.33
43	Cadence Design Systems Inc	Cadenc e 设计 系统股 份有限 公司	CDNS UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,057	4,085,039.31	0.33
44	Mosaic Co/The	Mosaic 公司	MOS UN	纽约证 券交易 所	美国	12,749	4,041,170.65	0.33

45	American International Group Inc	美国国际集团	AIG UN	纽约证券交易所	美国	11,764	4,036,862.27	0.33
46	Matador Resources Co	Matador 资源公司	MTDR UN	纽约证券交易所	美国	12,738	3,982,970.40	0.32
47	ON Semiconductor Corp	安森美半导体公司	ON UW	纳斯达克证券交易所	美国	11,472	3,873,526.93	0.31
48	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	8,438	3,700,822.34	0.30
49	Lockheed Martin Corp	洛克希德马丁	LMT UN	纽约证券交易所	美国	1,268	3,658,983.33	0.29
50	Lam Research Corp	泛林集团	LRCX UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,256	3,592,239.27	0.29
51	Texas Instruments Inc	德州仪器	TXN UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,481	3,589,630.21	0.29
52	Pioneer Natural Resources Co	Pioneer 自然资源公司	PXD UN	纽约证券交易所	美国	2,343	3,507,890.66	0.28
53	Deere & Co	迪尔	DE UN	纽约证券交易所	美国	1,705	3,426,816.34	0.28
54	Booking Holdings Inc	Booking 控股股份有限公司	BKNG UW	纳斯达克证券交易所	美国	281	3,298,426.19	0.27
55	Archer-Daniels-Midland Co	Archer-Daniels-Midland 公司	ADM UN	纽约证券交易所	美国	6,305	3,283,673.26	0.26
56	HP Inc	惠普	HPQ UN	纽约证券交易所	美国	14,853	3,267,655.43	0.26

57	EOG Resources Inc	EOG 资源	EOG UN	纽约证券交易所	美国	4,335	3,213,132.41	0.26
58	ASML Holding NV	阿斯麦控股公司	ASML UW	纳斯达克证券交易所	美国	982	3,136,332.25	0.25
59	APA Corp	APA	APA UW	纳斯达克证券交易所	美国	12,456	2,917,542.22	0.24
60	Synopsys Inc	新思科技公司	SNPS UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,421	2,896,356.35	0.23
61	AutoZone Inc	AutoZone 股份有限公司	AZO UN	纽约证券交易所	美国	194	2,798,179.17	0.23
62	Tyson Foods Inc	泰森食品公司	TSN UN	纽约证券交易所	美国	4,748	2,742,364.48	0.22
63	General Dynamics Corp	通用动力	GD UN	纽约证券交易所	美国	1,844	2,738,150.53	0.22
64	Activision Blizzard Inc	动视暴雪股份有限公司	ATVI UW	纳斯达克证券交易所	美国	5,038	2,632,604.90	0.21
65	Bunge Ltd	邦吉有限公司	BG UN	纽约证券交易所	美国	4,275	2,602,008.10	0.21
66	Altria Group Inc	高特利	MO UN	纽约证券交易所	美国	9,266	2,597,585.76	0.21
67	Marathon Petroleum Corp	马拉松石油公司	MPC UN	纽约证券交易所	美国	4,677	2,580,507.60	0.21
68	Caterpillar Inc	卡特彼勒	CAT UN	纽约证券交易所	美国	2,124	2,548,226.23	0.21
69	Nucor Corp	纽柯公司	NUE UN	纽约证券交易所	美国	3,593	2,517,749.03	0.20
70	Hess Corp	赫斯公司	HES UN	纽约证券交易所	美国	3,524	2,505,584.14	0.20

71	Unum Group	尤纳姆集团	UNM UN	纽约证券交易所	美国	10,875	2,482,999.88	0.20
72	Bank of America Corp	美国银行公司	BAC UN	纽约证券交易所	美国	11,442	2,390,529.94	0.19
73	O'Reilly Automotive Inc	O'Reilly 汽车股份有限公司	ORLY UW	纳斯达克证券交易所	美国	543	2,302,316.78	0.19
74	Monolithic Power Systems Inc	芯源系统有限公司	MPWR UW	纳斯达克证券交易所	美国	881	2,270,729.98	0.18
75	Exelon Corp	Exelon 公司	EXC UN	纳斯达克证券交易所	美国	7,456	2,265,569.98	0.18
76	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	11,521	2,262,442.87	0.18
77	Fortinet Inc	Fortinet 股份有限公司	FTNT UW	纳斯达克证券交易所	美国	5,925	2,249,906.25	0.18
78	Magnolia Oil & Gas Corp	Magnolia Oil & Gas Corp	MGY UN	纽约证券交易所	美国	15,856	2,233,670.97	0.18
79	H&R Block Inc	H&R Block 公司	HRB UN	纽约证券交易所	美国	9,086	2,153,805.84	0.17
80	Juniper Networks Inc	瞻博网络股份有限公司	JNPR UN	纽约证券交易所	美国	11,117	2,126,403.06	0.17
81	Nexstar Media Group Inc	Nexstar 媒体集团股份有限公司	NXST UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,925	2,104,319.20	0.17
82	McDonald's Corp	麦当劳	MCD UN	纽约证券交易所	美国	1,260	2,087,707.14	0.17

83	Macy's Inc	梅西百货	M UN	纽约证券交易所	美国	16,833	2,069,665.29	0.17
84	Regeneron Pharmaceuticals Inc	再生元制药股份有限公司	REGN UW	纳斯达克证券交易所	美国	521	2,066,968.45	0.17
85	Thermo Fisher Scientific Inc	Thermo Fisher Scientific 公司	TMO UN	纽约证券交易所	美国	559	2,038,208.69	0.16
86	Chesapeake Energy Corp	切萨皮克能源公司	CHK UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,726	2,028,041.46	0.16
87	Sysco Corp	Sysco 公司	SYU UN	纽约证券交易所	美国	3,477	1,976,753.41	0.16
88	Raymond James Financial Inc	Raymond James 金融股份有限公司	RJF UN	纽约证券交易所	美国	3,186	1,911,811.15	0.15
89	Procter & Gamble Co/The	宝洁	PG UN	纽约证券交易所	美国	1,968	1,899,183.38	0.15
90	Kroger Co/The	克罗格公司	KR UN	纽约证券交易所	美国	5,912	1,877,950.12	0.15
91	Simon Property Group Inc	西蒙房地产集团公司	SPG UN	纽约证券交易所	美国	2,933	1,868,456.18	0.15
92	Waters Corp	沃特世公司	WAT UN	纽约证券交易所	美国	840	1,865,924.90	0.15
93	Accenture PLC	埃森哲公司	ACN UN	纽约证券交易所	美国	990	1,844,786.01	0.15
94	Discover Financial Services	Discover 金融服务公司	DFS UN	纽约证券交易所	美国	2,903	1,842,720.51	0.15
95	Avnet Inc	安富利股份有	AVT UW	纳斯达克证	美国	6,397	1,840,959.57	0.15

		限公司		交易所				
96	MongoDB Inc	MongoDB 股份有限公司	MDB UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,053	1,833,913.54	0.15
97	Marvell Technology Inc	美满电子科技公司	MRVL UW	纳斯达克证券交易所	美国	6,192	1,808,975.72	0.15
98	Intuit Inc	Intuit 公司	INTU UW	纳斯达克证券交易所	美国	699	1,808,202.57	0.15
99	Goldman Sachs Group Inc/The	高盛	GS UN	纽约证券交易所	美国	878	1,750,222.78	0.14
100	Herc Holdings Inc	Herc 控股公司	HRI UN	纽约证券交易所	美国	2,769	1,675,335.57	0.13
101	Capital One Financial Corp	第一资本金融	COF UN	纽约证券交易所	美国	2,389	1,670,533.97	0.13
102	Marriott International Inc/MD	万豪国际	MAR UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,823	1,664,066.33	0.13
103	Johnson & Johnson	强生	JNJ UN	纽约证券交易所	美国	1,388	1,653,580.77	0.13
104	Olin Corp	奥林公司	OLN UN	纽约证券交易所	美国	5,213	1,619,176.53	0.13
105	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	1,150	1,617,715.86	0.13
106	Analog Devices Inc	亚德诺半导体	ADI UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,638	1,606,007.28	0.13
107	Sherwin-Williams Co/The	宣伟	SHW UN	纽约证券交易所	美国	1,067	1,603,433.80	0.13
108	CF	CF 工业	CF UN	纽约证	美国	2,773	1,595,496.36	0.13

8	Industrie s Holdings Inc	控股股 份有限 公司		券交易 所				
10 9	Salesforc e Inc	Salesf orce 股 份有限 公司	CRM UN	纽约证 券交易 所	美国	1,433	1,587,261.67	0.13
11 0	General Mills Inc	通用磨 坊	GIS UN	纽约证 券交易 所	美国	3,127	1,583,435.03	0.13
11 1	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	4,117	1,577,444.30	0.13
11 2	Abbott Laborator ies	雅培制 药	ABT UN	纽约证 券交易 所	美国	2,154	1,570,683.04	0.13
11 3	West Pharmaceu tical Services Inc	西氏医 药服务 公司	WST UN	纽约证 券交易 所	美国	771	1,564,610.36	0.13
11 4	FactSet Research Systems Inc	FactSe t 研究 系统股 份有限 公司	FDS UN	纽约证 券交易 所	美国	605	1,561,506.87	0.13
11 5	Chord Energy Corp	绿洲石 油公司	OAS UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,909	1,558,587.42	0.13
11 6	Chipotle Mexican Grill Inc	Chipot le Mexica n Grill 股份有 限公司	CMG UN	纽约证 券交易 所	美国	177	1,552,917.42	0.13
11 7	Waste Managemen t Inc	废品管 理	WM UN	纽约证 券交易 所	美国	1,496	1,535,958.12	0.12
11 8	Quanta Services Inc	Quanta 服务股 份有限 公司	PWR UN	纽约证 券交易 所	美国	1,823	1,533,520.13	0.12
11	Atkore	Atkore	ATKR UN	纽约证	美国	2,735	1,523,704.91	0.12

9	Inc	股份有 限公司		券交易 所				
12 0	Crowdstrike Holdings Inc	CrowdStrike 控股股 份有限 公司	CRWD UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,342	1,518,169.15	0.12
12 1	United Rentals Inc	联合租 赁公司	URI UN	纽约证 券交易 所	美国	929	1,514,517.28	0.12
12 2	CDW Corp/DE	特拉华 CDW 公 司	CDW UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,432	1,514,265.80	0.12
12 3	Mettler-T oledo Internati onal Inc	梅特勒 -托利 多国际 股份有 限公司	MTD UN	纽约证 券交易 所	美国	195	1,503,421.72	0.12
12 4	PNC Financial Services Group Inc/The	PNC 财 务服务	PNC UN	纽约证 券交易 所	美国	1,416	1,499,342.33	0.12
12 5	Moderna Inc	莫德纳 公司	MRNA UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,532	1,468,764.39	0.12
12 6	Dillard's Inc	Dillard's 公司	DDS UN	纽约证 券交易 所	美国	989	1,464,049.83	0.12
12 7	eBay Inc	eBay 公 司	EBAY UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	5,227	1,461,803.93	0.12
12 8	Lincoln National Corp	林肯国 民	LNC UN	纽约证 券交易 所	美国	4,655	1,461,168.09	0.12
12 9	HCA Healthcar e Inc	HCA 医 疗保健 有限公 司	HCA UN	纽约证 券交易 所	美国	1,289	1,453,886.15	0.12
13 0	Constella tion Energy Corp	美国联 合能源 公司	CEG UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,690	1,418,047.68	0.11
13	Stifel	斯迪富	SF UN	纽约证	美国	3,760	1,413,657.08	0.11

1	Financial Corp	融资公司		券交易所				
132	Veritiv Corp	Veritiv 有限公司	VRTV UN	纽约证券交易所	美国	1,940	1,413,333.59	0.11
133	Palo Alto Networks Inc	Palo Alto Networks 股份有限公司	PANW UN	纳斯达克证券交易所	美国	422	1,398,857.24	0.11
134	Gartner Inc	Gartner 公司	IT UN	纽约证券交易所	美国	860	1,395,795.36	0.11
135	TJX Cos Inc/The	TJX 公司	TJX UN	纽约证券交易所	美国	3,705	1,388,751.41	0.11
136	Option Care Health Inc	Option 护理健康股份有限公司	OPCH UW	纳斯达克证券交易所	美国	7,439	1,387,446.45	0.11
137	WEX Inc	WEX 股份有限公司	WEX UN	纽约证券交易所	美国	1,326	1,384,377.66	0.11
138	Kohl's Corp	Kohl's 公司	KSS UN	纽约证券交易所	美国	5,772	1,382,566.39	0.11
139	Hub Group Inc	中心集团	HUBG UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,876	1,369,282.92	0.11
140	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	台积电	TSM UN	纽约证券交易所	美国	2,495	1,368,899.09	0.11
141	Aon PLC	怡安集团	AON UN	纽约证券交易所	美国	756	1,368,307.35	0.11
142	SVB Financial Group	硅谷银行金融集团	SIVB UW	纳斯达克证券交易所	美国	509	1,349,326.37	0.11
14	S&P	标普全	SPGI UN	纽约证	美国	588	1,330,140.96	0.11

3	Global Inc	球		券交易所				
144	Coca-Cola Consolidated Inc	可口可乐装瓶有限公司	COKE UN	纳斯达克证券交易所	美国	351	1,328,380.02	0.11
145	Dow Inc	陶氏公司	DOW UN	纽约证券交易所	美国	3,813	1,320,729.22	0.11
146	Extra Space Storage Inc	额外空间仓储公司	EXR UN	纽约证券交易所	美国	1,152	1,315,288.36	0.11
147	Zoetis Inc	硕腾股份有限公司	ZTS UN	纽约证券交易所	美国	1,134	1,308,207.97	0.11
148	Tapestry Inc	TPR-DR S-RS	TPR UN	纽约证券交易所	美国	6,319	1,294,332.95	0.10
149	Public Storage	公共存储公司	PSA UN	纽约证券交易所	美国	616	1,292,647.32	0.10
150	Nordstrom Inc	诺德斯特龙公司	JWN UN	纽约证券交易所	美国	9,049	1,283,255.72	0.10
151	Pure Storage Inc	Pure 储存股份有限公司	PSTG UN	纽约证券交易所	美国	7,379	1,273,247.14	0.10
152	KBR Inc	KBR 股份有限公司	KBR UN	纽约证券交易所	美国	3,846	1,249,044.83	0.10
153	VMware Inc	VMware 公司	VMW UN	纽约证券交易所	美国	1,631	1,247,658.52	0.10
154	MSCI Inc	MSCI 明晟	MSCI UN	纽约证券交易所	美国	449	1,241,980.48	0.10
155	Morgan Stanley	摩根士丹利	MS UN	纽约证券交易所	美国	2,421	1,235,845.65	0.10
156	Honeywell International Inc	霍尼韦尔	HON UN	纳斯达克证券交易所	美国	1,059	1,235,829.95	0.10

157	Occidental Petroleum Corp	西方石油	OXY UN	纽约证券交易所	美国	3,114	1,230,550.76	0.10
158	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	2,400	1,214,011.72	0.10
159	Steel Dynamics Inc	Steel Dynamics 股份有限公司	STLD UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,702	1,199,577.52	0.10
160	FedEx Corp	联邦快递	FDX UN	纽约证券交易所	美国	783	1,191,366.99	0.10
161	NortonLifeLock Inc	诺顿LifeLock 股份有限公司	NLOK UW	纳斯达克证券交易所	美国	8,042	1,185,248.81	0.10
162	Agilent Technologies Inc	安捷伦	A UN	纽约证券交易所	美国	1,468	1,170,161.85	0.09
163	Paychex Inc	Paychex 公司	PAYX UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,530	1,169,267.49	0.09
164	Entegris Inc	Entegris 股份有限公司	ENTG UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,884	1,164,917.30	0.09
165	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	4,694	1,157,431.67	0.09
166	Microchip Technology Inc	微芯科技股份有限公司	MCHP UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,927	1,140,939.07	0.09
167	Ulta Beauty Inc	Ulta 美容产品公司	ULTA UW	纳斯达克证券交易所	美国	428	1,107,283.28	0.09
168	Perficient Inc	Perficient 股	PRFT UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,798	1,106,432.14	0.09

		份有限公司		交易所				
169	Credit Acceptance Corp	Credit Acceptance 公司	CACC UN	纳斯达克证券交易所	美国	346	1,099,326.38	0.09
170	Coterra Energy Inc	Coterra 能源股份有限公司	CTRA UN	纽约证券交易所	美国	6,308	1,091,832.83	0.09
171	Diamondback Energy Inc	Diamondback 能源股份有限公司	FANG UN	纳斯达克证券交易所	美国	1,340	1,089,535.39	0.09
172	Live Nation Entertainment Inc	Live Nation 娱乐公司	LYV UN	纽约证券交易所	美国	1,960	1,086,285.73	0.09
173	NXP Semiconductors NV	恩智浦半导体公司	NXPI UN	纳斯达克证券交易所	美国	1,092	1,084,889.49	0.09
174	Onto Innovation Inc	Onto 创新股份有限公司	ONTO UN	纽约证券交易所	美国	2,299	1,076,053.93	0.09
175	Tenet Healthcare Corp	Tenet 医疗保健公司	THC UN	纽约证券交易所	美国	3,025	1,067,072.33	0.09
176	KKR & Co Inc	KKR & Co Inc	KKR UN	纽约证券交易所	美国	3,432	1,066,221.86	0.09
177	PayPal Holdings Inc	Paypal 控股股份有限公司	PYPL UN	纳斯达克证券交易所	美国	2,274	1,065,878.78	0.09
178	Principal Financial Group Inc	信安金融	PFG UN	纳斯达克证券交易所	美国	2,364	1,059,673.42	0.09
179	Arch Capital Group Ltd	阿契资本集团	ACGL UN	纳斯达克证券交易所	美国	3,466	1,058,175.30	0.09
180	Carlisle Cos Inc	卡莱股份有限公司	CSL UN	纽约证券交易所	美国	657	1,052,124.50	0.08

		公司		所				
181	PDC Energy Inc	PDC 能源股份有限公司	PDCE UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,539	1,049,849.47	0.08
182	Charles Schwab Corp/The	嘉信理财	SCHW UN	纽约证券交易所	美国	2,469	1,046,920.82	0.08
183	Old Dominion Freight Line Inc	Old Dominion Freight Line 股份有限公司	ODFL UW	纳斯达克证券交易所	美国	607	1,044,038.54	0.08
184	Amgen Inc	AMGEN-T	AMGN UW	纳斯达克证券交易所	美国	638	1,041,779.75	0.08
185	AutoNation Inc	AutoNation 股份有限公司	AN UN	纽约证券交易所	美国	1,370	1,027,590.51	0.08
186	Enphase Energy Inc	Enphase 能源股份有限公司	ENPH UQ	纳斯达克证券交易所	美国	783	1,025,991.32	0.08
187	Ryder System Inc	莱德系统股份有限公司	R UN	纽约证券交易所	美国	2,145	1,022,976.42	0.08
188	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	3,690	1,015,863.01	0.08
189	Applied Industrial Technologies Inc	应用工业技术公司	AIT UN	纽约证券交易所	美国	1,569	1,012,688.05	0.08
190	Tractor Supply Co	拖拉机供应公司	TSCO UW	纳斯达克证券交易所	美国	775	1,008,278.79	0.08
191	Jones Lang	仲量联行	JLL UN	纽约证券交易所	美国	859	1,008,084.09	0.08

	LaSalle Inc			所				
19 2	Arista Networks Inc	Arista 网络股份有限公司	ANET UN	纽约证券交易所	美国	1,594	1,002,827.86	0.08
19 3	MGM Resorts International	美高梅国际酒店集团	MGM UN	纽约证券交易所	美国	5,126	995,956.32	0.08
19 4	WESCO International Inc	西科国际有限公司	WCC UN	纽约证券交易所	美国	1,375	988,337.54	0.08
19 5	Victoria's Secret & Co	Victoria's Secret & Co	VSCO UN	纽约证券交易所	美国	5,259	987,208.22	0.08
19 6	Zions Bancorp NA	锡安银行	ZION UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,885	985,545.60	0.08
19 7	Intuitive Surgical Inc	直觉外科手术公司	ISRG UW	纳斯达克证券交易所	美国	727	979,301.78	0.08
19 8	BrightSphere Investment Group Inc	BrightSphere 投资集团有限公司	BSIG UN	纽约证券交易所	美国	7,980	964,561.07	0.08
19 9	Amphenol Corp	安费诺公司	APH UN	纽约证券交易所	美国	2,224	960,945.77	0.08
20 0	Ally Financial Inc	Ally 金融公司	ALLY UN	纽约证券交易所	美国	4,269	960,093.89	0.08
20 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	937,951.71	0.08
20 2	Hancock Whitney Corp	Hancock Whitney 公司	HWC UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,126	930,036.15	0.07
20 3	Comerica Inc	Comerica 公司	CMA UN	纽约证券交易所	美国	1,858	915,032.54	0.07

204	Regency Centers Corp	Regency Centers 公司	REG UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,268	902,784.51	0.07
205	FMC Corp	FMC 公司	FMC UN	纽约证券交易所	美国	1,252	899,170.02	0.07
206	ConocoPhillips	康菲石油	COP UN	纽约证券交易所	美国	1,489	897,495.99	0.07
207	Halliburton Co	哈利伯顿	HAL UN	纽约证券交易所	美国	4,260	896,600.09	0.07
208	Univar Solutions Inc	尤尼威尔解决方案股份有限公司	UNVR UN	纽约证券交易所	美国	5,330	889,643.72	0.07
209	Robert Half International Inc	罗致恒富国际公司	RHI UN	纽约证券交易所	美国	1,763	886,113.32	0.07
210	Trane Technologies PLC	特灵科技公共有限公司	TT UN	纽约证券交易所	美国	1,000	871,609.52	0.07
211	Mattel Inc	美泰	MAT UW	纳斯达克证券交易所	美国	5,811	870,868.78	0.07
212	Phillips 66	Phillips 66	PSX UN	纽约证券交易所	美国	1,579	868,872.68	0.07
213	Dell Technologies Inc	戴尔科技公司	DELL UN	纽约证券交易所	美国	2,799	868,064.49	0.07
214	Apollo Global Management Inc	阿波罗全球管理股份有限公司	APO UN	纽约证券交易所	美国	2,662	866,131.40	0.07
215	Lattice Semiconductor Corp	莱迪斯半导体公司	LSCC UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,622	853,468.60	0.07
21	Vertex	福泰制	VRTX UW	纳斯达克	美国	450	851,042.43	0.07

6	Pharmaceuticals Inc	药		克证券交易所				
217	Catalent Inc	康泰伦特股份有限公司	CTLT UN	纽约证券交易所	美国	1,181	850,398.07	0.07
218	Huntsman Corp	亨斯迈公司	HUN UN	纽约证券交易所	美国	4,452	847,073.98	0.07
219	Novanta Inc	Novanta 股份有限公司	NOVT UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,040	846,447.14	0.07
220	Horizon Therapeutics Plc	Horizon Therapeutic 公共有限公司	HZNP UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,561	835,605.27	0.07
221	MetLife Inc	大都会集团	MET UN	纽约证券交易所	美国	1,979	833,968.03	0.07
222	Netflix Inc	奈飞公司	NFLX UW	纳斯达克证券交易所	美国	693	813,320.40	0.07
223	Spirit Airlines Inc	Spirit 航空股份有限公司	SAVE UN	纽约证券交易所	美国	5,081	812,958.86	0.07
224	Northrop Grumman Corp	诺斯洛普格鲁门公司	NOC UN	纽约证券交易所	美国	252	809,392.42	0.07
225	LPL Financial Holdings Inc	LPL 金融控股公司	LPLA UW	纳斯达克证券交易所	美国	650	804,777.40	0.06
226	Automatic Data Processing Inc	ADP 公司	ADP UW	纳斯达克证券交易所	美国	558	786,591.65	0.06
227	GLOBALFOUNDRIES Inc	格罗方德半导体股份有限公司	GFS UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,889	782,161.72	0.06

		司						
22 8	Expedia Group Inc	亿客行 集团股 份有限 公司	EXPE UN	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,218	775,186.43	0.06
22 9	Targa Resources Corp	Targa 资源公 司	TRGP UN	纽约证 券交易 所	美国	1,917	767,699.53	0.06
23 0	SeaWorld Entertain ment Inc	海洋世 界娱乐 股份有 限公司	SEAS UN	纽约证 券交易 所	美国	2,571	762,326.32	0.06
23 1	Capri Holdings Ltd	Capri 控股有 限公司	CPRI UN	纽约证 券交易 所	美国	2,728	750,839.75	0.06
23 2	Citizens Financial Group Inc	公民金 融集团	CFG UN	纽约证 券交易 所	美国	3,098	742,063.52	0.06
23 3	Jack Henry & Associates Inc	Jack Henry & Associates 公司	JKHY UN	纳斯达 克证券 交易所	美国	611	738,201.79	0.06
23 4	Synovus Financial Corp	Synovus 金融	SNV UN	纽约证 券交易 所	美国	3,037	734,789.91	0.06
23 5	Seagate Technology Holdings PLC	Seagate Techno logy 控 股公共 有限公司	STX UN	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,532	734,536.42	0.06
23 6	Hershey Co/The	好时公 司	HSY UN	纽约证 券交易 所	美国	504	727,788.51	0.06
23 7	Celanese Corp	塞拉尼 斯公司	CE UN	纽约证 券交易 所	美国	922	727,760.19	0.06
23 8	Teradyne Inc	泰瑞达	TER UN	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,206	724,813.08	0.06
23 9	Las Vegas Sands	拉斯维 加斯金	LVS UN	纽约证 券交易	美国	3,179	716,660.81	0.06

	Corp	沙集团		所				
24 0	Micron Technology Inc	美光科 技股份 有限公 司	MU UN	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,929	715,670.94	0.06
24 1	ServiceNow Inc	ServiceNow 公司	NOW UN	纽约证 券交易 所	美国	224	714,874.70	0.06
24 2	Invesco Ltd	景顺有 限公司	IVZ UN	纽约证 券交易 所	美国	6,580	712,317.12	0.06
24 3	Franklin Resources Inc	富兰克 林资源	BEN UN	纽约证 券交易 所	美国	4,550	711,814.44	0.06
24 4	Walt Disney Co/The	华特迪 士尼公 司	DIS UN	纽约证 券交易 所	美国	1,113	705,148.01	0.06
24 5	Cintas Corp	CINTAS 公司	CTAS UN	纳斯达 克证券 交易所	美国	281	704,441.50	0.06
24 6	Keysight Technologies Inc	是德科 技公司	KEYS UN	纽约证 券交易 所	美国	754	697,575.53	0.06
24 7	Murphy Oil Corp	墨菲石 油公司	MUR UN	纽约证 券交易 所	美国	3,401	689,100.98	0.06
24 8	ONEOK Inc	Oneok 股份有 限公司	OKE UN	纽约证 券交易 所	美国	1,845	687,230.58	0.06
24 9	Vistra Corp	Vistra 公司	VST UN	纽约证 券交易 所	美国	4,461	684,118.84	0.06
25 0	Raytheon Technologies Corp	雷神技 术公司	RTX UN	纽约证 券交易 所	美国	1,059	683,089.58	0.06
25 1	AT&T Inc	美国电 话电报 公司	T UN	纽约证 券交易 所	美国	4,850	682,254.08	0.05
25 2	Molina Healthcare Inc	Molina Health care 股 份有限 公司	MOH UN	纽约证 券交易 所	美国	359	673,690.26	0.05
25	MaxLinear	美国	MXL UN	纳斯达	美国	2,942	669,748.32	0.05

3	Inc	MaxLinear 股份有限公司		克证券交易所				
254	Wells Fargo & Co	富国银行	WFC UN	纽约证券交易所	美国	2,542	668,255.04	0.05
255	Cisco Systems Inc	思科系统股份有限公司	CSCO UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,325	665,354.77	0.05
256	Albemarle Corp	雅保公司	ALB UN	纽约证券交易所	美国	474	664,807.93	0.05
257	Ford Motor Co	福特汽车	F UN	纽约证券交易所	美国	8,880	663,317.19	0.05
258	SM Energy Co	SM 能源公司	SM UN	纽约证券交易所	美国	2,886	662,229.54	0.05
259	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	1,787	641,160.31	0.05
260	AAR Corp	AAR 公司	AIR UN	纽约证券交易所	美国	2,280	640,235.35	0.05
261	Humana Inc	Humana 公司	HUM UN	纽约证券交易所	美国	202	634,563.81	0.05
262	Baidu Inc	百度	BIDU UW	纳斯达克证券交易所	美国	632	630,853.88	0.05
263	LyondellBasell Industries NV	利安德巴塞尔工业公司	LYB UN	纽约证券交易所	美国	1,072	629,241.54	0.05
264	Marathon Oil Corp	Marathon 石油公司	MRO UN	纽约证券交易所	美国	4,154	626,723.42	0.05
265	Allegheny Technologies Inc	冶联科技	ATI UN	纽约证券交易所	美国	4,109	626,276.91	0.05
26	Zoom	Zoom 视	ZM UW	纳斯达克	美国	863	625,355.57	0.05

6	Video Communications Inc	频通信股份有限公司		克证券交易所				
267	Iron Mountain Inc	美国铁山公司	IRM UN	纽约证券交易所	美国	1,908	623,492.55	0.05
268	Fair Isaac Corp	费埃哲公司	FICO UN	纽约证券交易所	美国	230	618,838.06	0.05
269	Altice USA Inc	美国 Altice 公司	ATUS UN	纽约证券交易所	美国	9,919	615,775.98	0.05
270	Bill.com Holdings Inc	Bill.com 控股股份有限公司	BILL UN	纽约证券交易所	美国	826	609,465.19	0.05
271	Donnelley Financial Solutions Inc	当纳利金融解决方案股份有限公司	DFIN UN	纽约证券交易所	美国	3,097	608,798.68	0.05
272	A O Smith Corp	AO 史密斯公司	AOS UN	纽约证券交易所	美国	1,647	604,414.99	0.05
273	Cenovus Energy Inc	Cenovus 能源公司	CVE UN	纽约证券交易所	美国	4,737	604,364.05	0.05
274	Envista Holdings Corp	Envista Holdings Corp	NVST UN	纽约证券交易所	美国	2,327	601,895.67	0.05
275	ResMed Inc	瑞思迈股份有限公司	RMD UN	纽约证券交易所	美国	426	599,343.99	0.05
276	Tetra Tech Inc	Tetra 科技股份有限公司	TTEK UW	纳斯达克证券交易所	美国	650	595,687.09	0.05
277	Westlake Corp	Westlake 公司	WLK UN	纽约证券交易所	美国	897	590,092.73	0.05
278	Eaton Corp PLC	伊顿	ETN UN	纽约证券交易所	美国	696	588,516.22	0.05

279	Newmont Corp	纽蒙黄金公司	NEM UN	纽约证券交易所	美国	1,457	583,483.68	0.05
280	Carlyle Group Inc/The	凯雷投资集团	CG UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,744	583,053.14	0.05
281	Halozyme Therapeutics Inc	Halozyme Therapeutics 股份有限公司	HALO UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,973	582,630.06	0.05
282	Wintrust Financial Corp	Wintrust 金融公司	WTFC UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,081	581,490.13	0.05
283	Commercial Metals Co	美国商业金属公司	CMC UN	纽约证券交易所	美国	2,617	581,359.59	0.05
284	Datadog Inc	Datadog 股份有限公司	DDOG UW	纳斯达克证券交易所	美国	908	580,387.91	0.05
285	Airbnb Inc	爱彼迎股份有限公司	ABNB UW	纳斯达克证券交易所	美国	969	579,318.12	0.05
286	Prologis Inc	安博	PLD UN	纽约证券交易所	美国	716	565,350.89	0.05
287	ServisFirst Bancshares Inc	ServisFirst Bancshares 股份有限公司	SFBS UN	纽约证券交易所	美国	1,060	561,443.51	0.05
288	Elevance Health Inc	Elevance 健康股份有限公司	ELV UN	纽约证券交易所	美国	173	560,310.22	0.05
289	Alcoa Corp	美国铝业公司	AA UN	纽约证券交易所	美国	1,827	558,889.55	0.05
290	Fifth Third Bancorp	五三银行	FITB UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,471	557,218.01	0.04

29 1	Colgate-P almolive Co	高露洁 棕榄	CL UN	纽约证 券交易 所	美国	1,026	551,835.74	0.04
29 2	Citigroup Inc	花旗集 团	C UN	纽约证 券交易 所	美国	1,767	545,397.42	0.04
29 3	Affiliate d Managers Group Inc	Affili ated Manage rs 集团 股份有 限公司	AMG UN	纽约证 券交易 所	美国	696	544,654.27	0.04
29 4	HealthEqu ity Inc	Health equity 有限公 司	HQY UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,316	542,208.91	0.04
29 5	Southern Copper Corp	南方铜 业公司	SCCO UN	纽约证 券交易 所	美国	1,611	538,548.98	0.04
29 6	Crown Holdings Inc	Crown 控股股 份有限 公司	CCK UN	纽约证 券交易 所	美国	870	538,173.07	0.04
29 7	Rambus Inc	Rambus 股份有 限公司	RMBS UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,723	536,960.79	0.04
29 8	Atlas Air Worldwide Holdings Inc	阿特拉 斯航空 全球控 股有限 公司	AAWW UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,284	531,782.07	0.04
29 9	CDK Global Inc	CDK Global 股份有 限公司	CDK UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,446	531,525.56	0.04
30 0	AECOM	AECOM 公司	ACM UN	纽约证 券交易 所	美国	1,206	527,887.31	0.04
30 1	NetApp Inc	美国网 域存储 技术有 限公司	NTAP UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,205	527,611.34	0.04
30 2	Terreno Realty Corp	Terren o 房地 产公司	TRNO UN	纽约证 券交易 所	美国	1,389	519,522.56	0.04

303	Littelfuse Inc	Littelfuse 股份有限公司	LFUS UN	纳斯达克证券交易所	美国	302	514,899.14	0.04
304	STAG Industrial Inc	STAG 实业公司	STAG UN	纽约证券交易所	美国	2,455	508,793.92	0.04
305	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	502,417.55	0.04
306	MP Materials Corp	MP Materials Corp	MP UN	纽约证券交易所	美国	2,299	494,978.64	0.04
307	Meta Financial Group Inc	梅塔金融集团	CASH UN	纳斯达克证券交易所	美国	1,895	491,809.04	0.04
308	Paylocity Holding Corp	Paylocity 控股公司	PCTY UN	纳斯达克证券交易所	美国	418	489,311.80	0.04
309	Cleveland-Cliffs Inc	Cleveland-Cliffs 股份有限公司	CLF UN	纽约证券交易所	美国	4,741	489,054.15	0.04
310	Textron Inc	德事隆	TXT UN	纽约证券交易所	美国	1,172	480,362.01	0.04
311	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	475,040.48	0.04
312	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	1,909	474,174.44	0.04
313	General Motors Co	通用汽车公司	GM UN	纽约证券交易所	美国	2,205	470,004.71	0.04
314	Helmerich & Payne Inc	Helmerich & Payne Inc	HP UN	纽约证券交易所	美国	1,624	469,324.44	0.04

315	EMCOR Group Inc	埃姆科集团公司	EME UN	纽约证券交易所	美国	670	462,973.85	0.04
316	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	458,808.55	0.04
317	PulteGroup Inc	Pulte 集团公司	PHM UN	纽约证券交易所	美国	1,714	455,877.35	0.04
318	American Tower Corp	美国发射塔公司	AMT UN	纽约证券交易所	美国	263	451,141.45	0.04
319	Builders FirstSource Inc	Builders FirstSource 股份有限公司	BLDR UN	纽约证券交易所	美国	1,251	450,863.13	0.04
320	Jabil Inc	捷普集团	JBL UN	纽约证券交易所	美国	1,303	447,829.10	0.04
321	Darden Restaurants Inc	达登饭店	DRI UN	纽约证券交易所	美国	586	444,887.43	0.04
322	Atlassian Corp PLC	Atlassian 公共有限公司	TEAM UW	纳斯达克证券交易所	美国	349	438,943.01	0.04
323	WR Berkley Corp	WR Berkley 公司	WRB UN	纽约证券交易所	美国	958	438,879.12	0.04
324	Lennar Corp	Lennar 公司	LEN UN	纽约证券交易所	美国	919	435,259.99	0.04
325	Ingredion Inc	宜瑞安公司	INGR UN	纽约证券交易所	美国	715	423,049.07	0.03
326	Dynatrace Inc	Dynatrace 股份有限公司	DT UN	纽约证券交易所	美国	1,598	422,986.79	0.03
32	Howmet	Howmet	HWM UN	纽约证	美国	1,980	417,925.59	0.03

7	Aerospace Inc	航空航天股份有限公司		券交易所				
328	Walmart Inc	沃尔玛股份有限公司	WMT UN	纽约证券交易所	美国	503	410,433.92	0.03
329	Western Alliance Bancorp	Western Alliance Bancorp	WAL UN	纽约证券交易所	美国	859	407,015.54	0.03
330	Republic Services Inc	公共服务公司	RSG UN	纽约证券交易所	美国	461	404,905.94	0.03
331	Starbucks Corp	星巴克	SBUX UW	纳斯达克证券交易所	美国	780	399,893.40	0.03
332	Virtus Investment Partners Inc	维德思投资合伙人股份有限公司	VRTS UW	纳斯达克证券交易所	美国	347	398,280.92	0.03
333	Lincoln Electric Holdings Inc	林肯电气股份有限公司	LECO UW	纳斯达克证券交易所	美国	478	395,744.95	0.03
334	Clorox Co/The	高乐氏公司	CLX UN	纽约证券交易所	美国	416	393,608.04	0.03
335	AmerisourceBergen Corp	美源伯根	ABC UN	纽约证券交易所	美国	413	392,155.42	0.03
336	Tradeweb Markets Inc	Tradeweb Markets 股份有限公司	TW UW	纳斯达克证券交易所	美国	855	391,635.36	0.03
337	Toro Co/The	托罗公司	TTC UN	纽约证券交易所	美国	767	390,139.92	0.03
338	TopBuild Corp	TopBuild 公司	BLD UN	纽约证券交易所	美国	346	388,169.66	0.03

				所				
33 9	Dollar General Corp	达乐公 司	DG UN	纽约证 券交易 所	美国	234	385,455.57	0.03
34 0	CSX Corp	CSX 公 司	CSX UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,974	384,995.70	0.03
34 1	Artisan Partners Asset Managem ent 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	379,571.95	0.03
34 2	Kimco Realty Corp	Kimco 房地产 公司	KIM UN	纽约证 券交易 所	美国	2,831	375,629.47	0.03
34 3	Nuvei Corp	Nuvei Corp	NVEI UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,545	375,050.82	0.03
34 4	Axon Enterpris e Inc	Axon Enterp rise 股 份有限 公司	AXON UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	599	374,555.38	0.03
34 5	Pool Corp	Pool 公 司	POOL UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	157	370,087.47	0.03
34 6	New Fortress Energy Inc	New Fortre ss Energy Inc	NFE UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,388	368,611.30	0.03
34 7	Zscaler Inc	Zscale r 股份 有限公 司	ZS UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	367	368,255.66	0.03
34 8	Charter Communica tions Inc	查特通 信公司	CHTR UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	117	367,905.59	0.03
34 9	Morningst ar Inc	晨星公 司	MORN UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	225	365,179.02	0.03
35 0	Ares Managemen	阿瑞斯 管理有	ARES UN	纽约证 券交易	美国	949	362,148.08	0.03

	t Corp	有限合伙企业		所				
351	United Bankshares Inc/WV	United Bankshares 股份有限公司 /WV	UBSI UN	纳斯达克证券交易所	美国	1,538	361,997.21	0.03
352	Matson Inc	美森公司	MATX UN	纽约证券交易所	美国	740	361,953.86	0.03
353	Amcro PLC	安姆科公司	AMCR UN	纽约证券交易所	美国	4,261	355,464.13	0.03
354	Bio-Technologie Corp	Bio-technologie 公司	TECH UN	纳斯达克证券交易所	美国	152	353,618.83	0.03
355	Valero Energy Corp	Valero 能源	VLO UN	纽约证券交易所	美国	487	347,371.06	0.03
356	Block Inc	Block 股份有限公司	SQ UN	纽约证券交易所	美国	840	346,485.42	0.03
357	International Business Machines Corp	国际商业机器	IBM UN	纽约证券交易所	美国	359	340,182.14	0.03
358	Huntington Ingalls Industries Inc	Huntington Ingalls 工业公司	HII UN	纽约证券交易所	美国	230	336,231.74	0.03
359	Intel Corp	英特尔	INTC UN	纳斯达克证券交易所	美国	1,319	331,165.91	0.03
360	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	330,223.43	0.03
361	Avery Dennison Corp	艾利丹尼森	AVY UN	纽约证券交易所	美国	296	321,566.80	0.03

36 2	UFP Industrie s Inc	UFP Indust ries 股 份有限 公司	UFPI UN	纳斯达 克证券 交易所	美国	700	320,120.36	0.03
36 3	Landstar System Inc	Landst ar 系 统股份 有限公 司	LSTR UN	纳斯达 克证券 交易所	美国	328	320,118.75	0.03
36 4	Toll Brothers Inc	托尔兄 弟公司	TOL UN	纽约证 券交易 所	美国	1,068	319,682.77	0.03
36 5	Texas Pacific Land Corp	德克萨 斯州太 平洋土 地公司	TPL UN	纽约证 券交易 所	美国	32	319,574.32	0.03
36 6	UDR Inc	UDR 公 司	UDR UN	纽约证 券交易 所	美国	1,030	318,262.64	0.03
36 7	Omnicom Group Inc	Omnico m 集团	OMC UN	纽约证 券交易 所	美国	741	316,341.91	0.03
36 8	Popular Inc	Popula r 股份 有限公 司	BPOP UN	纳斯达 克证券 交易所	美国	602	310,817.42	0.03
36 9	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	308,142.39	0.02
37 0	Camden Property Trust	Camden 房地产 信托公 司	CPT UN	纽约证 券交易 所	美国	338	305,061.59	0.02
37 1	Linde PLC	林德公 共有限 公司	LIN UN	纽约证 券交易 所	美国	158	304,897.16	0.02
37 2	Johnson Controls Internati onal plc	江森自 控国际 有限公 司	JCI UN	纽约证 券交易 所	美国	942	302,704.01	0.02
37 3	T Rowe Price	普徠仕	TROW UN	纳斯达 克证券	美国	394	300,417.97	0.02

	Group Inc			交易所				
374	Lithia Motors Inc	利西亚车行	LAD UN	纽约证券交易所	美国	161	296,941.93	0.02
375	Illumina Inc	Illumina 公司	ILMN UW	纳斯达克证券交易所	美国	238	294,480.66	0.02
376	Prudential Financial Inc	保德信金融集团	PRU UN	纽约证券交易所	美国	458	294,103.21	0.02
377	ExlService Holdings Inc	ExlService 控股公司	EXLS UW	纳斯达克证券交易所	美国	294	290,704.43	0.02
378	Edwards Lifesciences Corp	爱德华生命科学公司	EW UN	纽约证券交易所	美国	454	289,736.91	0.02
379	DXC Technology Co	DXC 技术公司	DXC UN	纽约证券交易所	美国	1,423	289,470.27	0.02
380	FNB Corp/PA	FNB/宾州	FNB UN	纽约证券交易所	美国	3,914	285,275.04	0.02
381	FirstEnergy Corp	第一能源	FE UN	纽约证券交易所	美国	1,106	284,961.61	0.02
382	Advanced Drainage Systems Inc	先进排水系统公司	WMS UN	纽约证券交易所	美国	465	281,090.55	0.02
383	Range Resources Corp	Range 资源公司	RRC UN	纽约证券交易所	美国	1,690	280,721.08	0.02
384	Encompass Health Corp	南方保健公司	EHC UN	纽约证券交易所	美国	743	279,497.26	0.02
385	Franklin Electric Co Inc	Franklin 电气有限公司	FELE UW	纳斯达克证券交易所	美国	566	278,289.27	0.02
386	3M Co	3M 公司	MMM UN	纽约证券交易所	美国	317	275,321.56	0.02

387	Alaska Air Group Inc	阿拉斯加航空集团公司	ALK UN	纽约证券交易所	美国	1,016	273,092.24	0.02
388	Truist Financial Corp	Truist 金融公司	TFC UN	纽约证券交易所	美国	854	271,846.73	0.02
389	Marriott Vacations Worldwide Corp	万豪环球度假	VAC UN	纽约证券交易所	美国	348	271,392.91	0.02
390	M&T Bank Corp	M&T 银行	MTB UN	纽约证券交易所	美国	253	270,641.70	0.02
391	National Fuel Gas Co	国家燃气公司	NFG UN	纽约证券交易所	美国	605	268,189.22	0.02
392	Clearfield Inc	Clearfield 股份有限公司	CLFD UQ	纳斯达克证券交易所	美国	631	262,351.65	0.02
393	Pinnacle Financial Partners Inc	Pinnacle 财务合伙人股份有限公司	PNFP UW	纳斯达克证券交易所	美国	526	255,268.50	0.02
394	Skyline Champion Corp	Skyline Champion 公司	SKY UN	纽约证券交易所	美国	791	251,739.38	0.02
395	Alleghany Corp	Alleghany 公司	Y UN	纽约证券交易所	美国	45	251,607.03	0.02
396	Ross Stores Inc	Ross 商店有限公司	ROST UW	纳斯达克证券交易所	美国	525	247,454.35	0.02
397	Target Corp	塔吉特公司	TGT UN	纽约证券交易所	美国	261	247,389.12	0.02
398	Parker-Hannifin Corp	派克汉尼汾	PH UN	纽约证券交易所	美国	147	242,746.98	0.02
399	NVR Inc	NVR 股份有限	NVR UN	纽约证券交易所	美国	9	241,860.47	0.02

		公司		所				
400	Caesars Entertainment Inc	凯撒娱乐集团	CZR UW	纳斯达克证券交易所	美国	932	239,567.45	0.02
401	Unity Software Inc	Unity 软件股份有限公司	U UN	纽约证券交易所	美国	960	237,229.20	0.02
402	Home BancShares Inc/AR	阿肯色 Home BancShares 公司	HOMB UN	纽约证券交易所	美国	1,692	235,857.66	0.02
403	Middleby Corp/The	美得彼公司	MIDD UW	纳斯达克证券交易所	美国	278	233,892.83	0.02
404	Dover Corp	都福	DOV UN	纽约证券交易所	美国	287	233,683.16	0.02
405	Valley National Bancorp	Valley National Bancorp	VLY UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,330	232,652.69	0.02
406	Sony Group Corp	索尼集团公司	SONY UN	纽约证券交易所	美国	416	228,297.13	0.02
407	Alteryx Inc	Alteryx 股份有限公司	AYX UN	纽约证券交易所	美国	700	227,476.19	0.02
408	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	225,594.18	0.02
409	RH	RH	RH UN	纽约证券交易所	美国	158	225,080.76	0.02
410	Crane Holdings Co	Crane Holdings Co	CR UN	纽约证券交易所	美国	383	225,070.02	0.02
411	Laboratory Corp of	美国实验控股	LH UN	纽约证券交易所	美国	143	224,922.37	0.02

	America Holdings			所				
41 2	Philip Morris International Inc	菲利普莫里斯国际集团公司	PM UN	纽约证券交易所	美国	335	221,999.02	0.02
41 3	Evercore Inc	Evercore 股份有限公司	EVR UN	纽约证券交易所	美国	351	220,517.21	0.02
41 4	Cincinnati Financial Corp	辛辛那提金融	CINF UW	纳斯达克证券交易所	美国	274	218,795.13	0.02
41 5	Amkor Technology Inc	安靠技术公司	AMKR UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,922	218,643.32	0.02
41 6	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	108	216,898.49	0.02
41 7	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	MACOM 技术解决方案控股股份有限公司	MTSI UW	纳斯达克证券交易所	美国	691	213,792.32	0.02
41 8	Sanmina Corp	Sanmina 公司	SANM UW	纳斯达克证券交易所	美国	778	212,670.44	0.02
41 9	JB Hunt Transport Services Inc	JB Hunt 运输服务股份有限公司	JBHT UW	纳斯达克证券交易所	美国	201	212,425.68	0.02
42 0	Cooper Cos Inc/The	库柏股份有限公司	COO UN	纽约证券交易所	美国	99	208,045.88	0.02
42 1	Saia Inc	Saia 股份有限公司	SAIA UW	纳斯达克证券交易所	美国	164	206,925.88	0.02
42 2	Cboe Global	Cboe 环球市场	CBOE UF	芝加哥期权交	美国	272	206,628.44	0.02

	Markets Inc	公司		易所				
423	XPO Logistics Inc	XPO 物流公司	XPO UN	纽约证券交易所	美国	637	205,891.79	0.02
424	Regions Financial Corp	地区金融公司	RF UN	纽约证券交易所	美国	1,635	205,746.36	0.02
425	Synchrony Financial	同步金融公司	SYF UN	纽约证券交易所	美国	1,107	205,203.34	0.02
426	Korn Ferry	光辉国际	KFY UN	纽约证券交易所	美国	523	203,653.81	0.02
427	Cathay General Bancorp	国泰万通金控	CATY UW	纳斯达克证券交易所	美国	774	203,369.51	0.02
428	Synaptics Inc	Synaptics 股份有限公司	SYNA UW	纳斯达克证券交易所	美国	256	202,823.88	0.02
429	Splunk Inc	Splunk 公司	SPLK UW	纳斯达克证券交易所	美国	336	199,479.99	0.02
430	Altair Engineering Inc	Altair Engineering 股份有限公司	ALTR UW	纳斯达克证券交易所	美国	565	199,076.90	0.02
431	Houlihan Lokey Inc	华利安股份有限公司	HLI UN	纽约证券交易所	美国	374	198,119.32	0.02
432	MKS Instruments Inc	MKS Instruments 股份有限公司	MKSI UW	纳斯达克证券交易所	美国	287	197,683.01	0.02
433	Xponential Fitness Inc	Xponential Fitness Inc	XPOF UN	纽约证券交易所	美国	2,333	196,660.66	0.02
434	AMERCO	Amerco	UHAL UW	纳斯达克证券交易所	美国	61	195,785.16	0.02

435	Summit Materials Inc	Summit 材料股份有限公司	SUM UN	纽约证券交易所	美国	1,236	193,197.31	0.02
436	Bath & Body Works Inc	Bath & Body Works 股份有限公司	BBWI UN	纽约证券交易所	美国	1,066	192,595.17	0.02
437	DR Horton Inc	霍顿房屋公司	DHI UN	纽约证券交易所	美国	430	191,017.85	0.02
438	Red Rock Resorts Inc	红岩赌场度假村股份有限公司	RRR UW	纳斯达克证券交易所	美国	853	190,980.14	0.02
439	Webster Financial Corp	韦伯斯特金融公司	WBS UN	纽约证券交易所	美国	675	190,947.72	0.02
440	Stryker Corp	史赛克	SYK UN	纽约证券交易所	美国	143	190,919.13	0.02
441	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	189,794.23	0.02
442	Henry Schein Inc	亨利香恩公司	HSIC UW	纳斯达克证券交易所	美国	367	189,017.05	0.02
443	CBRE Group Inc	世邦魏理仕	CBRE UN	纽约证券交易所	美国	382	188,717.99	0.02
444	IQVIA Holdings Inc	IQVIA 控股股份有限公司	IQV UN	纽约证券交易所	美国	129	187,863.56	0.02
445	Otis Worldwide Corp	奥的斯电梯公司	OTIS UN	纽约证券交易所	美国	393	186,397.79	0.02
446	United States Steel Corp	美国钢铁	X UN	纽约证券交易所	美国	1,549	186,191.62	0.01

447	PVH Corp	PVH 公司	PVH UN	纽约证券交易所	美国	487	185,974.91	0.01
448	Avient Corp	Avient 公司	AVNT UN	纽约证券交易所	美国	690	185,605.11	0.01
449	Terex Corp	特雷克斯公司	TEX UN	纽约证券交易所	美国	1,006	184,793.16	0.01
450	PerkinElmer Inc	珀金埃尔默	PKI UN	纽约证券交易所	美国	193	184,217.59	0.01
451	Boise Cascade Co	Boise Cascade 公司	BCC UN	纽约证券交易所	美国	461	184,059.41	0.01
452	Insteel Industries Inc	Insteel 工业股份有限公司	IIIN UN	纽约证券交易所	美国	798	180,326.32	0.01
453	Change Healthcare Inc	Change Healthcare Inc	CHNG UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,158	179,217.74	0.01
454	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	178,990.42	0.01
455	Zebra Technologies Corp	斑马技术公司	ZBRA UW	纳斯达克证券交易所	美国	90	177,553.44	0.01
456	Aspen Technology Inc	艾斯本技术有限公司	AZPN UW	纳斯达克证券交易所	美国	141	173,817.74	0.01
457	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	168,796.27	0.01
458	Generac Holdings Inc	Generac 控股公司	GNRC UN	纽约证券交易所	美国	119	168,181.11	0.01
459	Element Solutions	Element 解决	ESI UN	纽约证券交易所	美国	1,404	167,725.94	0.01

	Inc	方案股份有限公司		所				
460	PacWest Bancorp	西太平洋银行	PACW UN	纳斯达克证券交易所	美国	933	166,937.89	0.01
461	Magna International Inc	麦格纳国际公司	MGA UN	纽约证券交易所	美国	446	164,331.31	0.01
462	Regal Rexnord Corp	Regal Rexnord 公司	RRX UN	纽约证券交易所	美国	208	158,470.65	0.01
463	Equifax Inc	Equifax 股份有限公司	EFX UN	纽约证券交易所	美国	129	158,245.55	0.01
464	Southwest Airlines Co	西南航空	LUV UN	纽约证券交易所	美国	645	156,358.17	0.01
465	State Street Corp	道富集团	STT UN	纽约证券交易所	美国	377	155,986.69	0.01
466	Cadence Bank	Cadence 银行	CADE UN	纽约证券交易所	美国	987	155,535.08	0.01
467	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	BJ's 批发俱乐部控股有限公司	BJ UN	纽约证券交易所	美国	371	155,172.40	0.01
468	CarMax Inc	CarMax 股份有限公司	KMX UN	纽约证券交易所	美国	254	154,240.86	0.01
469	API Group Corp	API Group Corp	APG UN	纽约证券交易所	美国	1,508	151,508.24	0.01
470	Simmons First National Corp	西蒙斯第一国民公司	SFNC UN	纳斯达克证券交易所	美国	1,034	147,535.63	0.01
471	Vail Resorts Inc	范尔度假村管理公司	MTN UN	纽约证券交易所	美国	99	144,878.66	0.01

47 2	Pacific Premier Bancorp Inc	太平洋 第一合 众银行	PPBI UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	713	139,920.07	0.01
47 3	Vulcan Materials Co	Vulcan 材料	VMC UN	纽约证 券交易 所	美国	146	139,238.73	0.01
47 4	SLM Corp	SLM 公 司	SLM UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,280	136,934.04	0.01
47 5	VICI Propertie s Inc	VICI Proper ties 股 份有限 公司	VICI UN	纽约证 券交易 所	美国	681	136,154.10	0.01
47 6	Vertiv Holdings Co	Vertiv Holdin gs Co	VRT UN	纽约证 券交易 所	美国	2,461	135,767.73	0.01
47 7	First Horizon Corp	第一线 国民银 行	FHN UN	纽约证 券交易 所	美国	925	135,707.86	0.01
47 8	Annaly Capital Managem ent 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	135,414.17	0.01
47 9	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	135,168.87	0.01
48 0	Allegiant Travel Co	忠实旅 游公司	ALGT UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	178	135,100.62	0.01
48 1	Veeva Systems Inc	Veeva System s 股份 有限公 司	VEEV UN	纽约证 券交易 所	美国	101	134,241.69	0.01
48 2	Boeing Co/The	波音	BA UN	纽约证 券交易 所	美国	145	133,049.48	0.01
48 3	Comfort Systems USA Inc	美国舒 适系统 公司	FIX UN	纽约证 券交易 所	美国	231	128,910.22	0.01

484	Align Technology Inc	Align 科技股份有限公司	ALGN UN	纳斯达克证券交易所	美国	81	128,659.35	0.01
485	Emerson Electric Co	艾默生电气	EMR UN	纽约证券交易所	美国	240	128,117.94	0.01
486	ZoomInfo Technologies Inc	ZoomInfo 科技股份有限公司	ZI UN	纳斯达克证券交易所	美国	547	122,028.55	0.01
487	Twitter Inc	推特公司	TWTR UN	纽约证券交易所	美国	478	119,948.96	0.01
488	Penumbra Inc	Penumbra 股份有限公司	PEN UN	纽约证券交易所	美国	143	119,505.60	0.01
489	Hanesbrands Inc	汉佰有限公司	HBI UN	纽约证券交易所	美国	1,696	117,126.28	0.01
490	Light & Wonder Inc	Light & Wonder Inc	LNW UN	纳斯达克证券交易所	美国	371	117,001.78	0.01
491	Trade Desk Inc/The	Trade Desk 股份有限公司	TTD UN	纳斯达克证券交易所	美国	416	116,954.47	0.01
492	Darling Ingredients Inc	Darling Ingredients 公司	DAR UN	纽约证券交易所	美国	288	115,586.42	0.01
493	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	114,587.96	0.01
494	Quest Diagnostics Inc	Quest Diagnostics 股份有限公司	DGX UN	纽约证券交易所	美国	128	114,237.69	0.01
495	Corning Inc	康宁公司	GLW UN	纽约证券交易所	美国	540	114,197.16	0.01

				所				
49 6	UMB Financial Corp	UMB 金 融公司	UMBF UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	197	113,836.75	0.01
49 7	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	112,928.43	0.01
49 8	Best Buy Co Inc	百思买	BBY UN	纽约证 券交易 所	美国	257	112,441.65	0.01
49 9	Nasdaq Inc	纳斯达 克股份 有限公 司	NDAQ UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	106	108,518.24	0.01
50 0	CNA Financial Corp	CNA 金 融公司	CNA UN	纽约证 券交易 所	美国	360	108,483.07	0.01
50 1	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	108,357.23	0.01
50 2	LKQ Corp	LKQ 公 司	LKQ UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	327	107,734.28	0.01
50 3	Graphic Packaging Holding Co	图像包 装控股 公司	GPK UN	纽约证 券交易 所	美国	781	107,452.87	0.01
50 4	Williams- Sonoma Inc	威廉斯 -索纳 玛公司	WSM UN	纽约证 券交易 所	美国	143	106,482.07	0.01
50 5	Mid-Ameri ca Apartment Communiti es Inc	Mid-Am erica Apartm ent Commun ities 股份有 限公司	MAA UN	纽约证 券交易 所	美国	90	105,505.22	0.01
50 6	Seaboard Corp	Seaboar d 公司	SEB UA	纽约证 券交易 所	美国	4	104,230.19	0.01
50 7	Boyd Gaming	波伊德 博彩公	BYD UN	纽约证 券交易	美国	311	103,840.46	0.01

	Corp	司		所				
508	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	103,551.00	0.01
509	New Relic Inc	New Relic 股份有限公司	NEWR UN	纽约证券交易所	美国	302	101,443.48	0.01
510	IDEXX Laboratories Inc	爱德士股份有限公司	IDXX UW	纳斯达克证券交易所	美国	43	101,217.24	0.01
511	Chart Industries Inc	查特工业公司	GTLS UN	纽约证券交易所	美国	89	99,978.52	0.01
512	Planet Fitness Inc	Planet 健身股份有限公司	PLNT UN	纽约证券交易所	美国	219	99,960.87	0.01
513	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	99,341.07	0.01
514	Illinois Tool Works Inc	伊利诺伊工具	ITW UN	纽约证券交易所	美国	81	99,075.36	0.01
515	CubeSmart	CubeSmart	CUBE UN	纽约证券交易所	美国	345	98,915.30	0.01
516	Ambarella Inc	安霸股份有限公司	AMBA UW	纳斯达克证券交易所	美国	225	98,848.85	0.01
517	Gilead Sciences Inc	吉利德科学	GILD UW	纳斯达克证券交易所	美国	238	98,729.93	0.01
518	Equity Residential	公寓物业权益信托	EQR UN	纽约证券交易所	美国	202	97,908.86	0.01
519	Beacon Roofing Supply Inc	Beacon Roofing Supply	BECN UW	纳斯达克证券交易所	美国	283	97,549.39	0.01

		股份有 限公司						
52 0	AvalonBay Communiti es Inc	Avalon Bay 社 区股份 有限公司	AVB UN	纽约证 券交易 所	美国	74	96,473.02	0.01
52 1	Umpqua Holdings Corp	Umpqua 控股公 司	UMPQ UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	855	96,230.40	0.01
52 2	Bank OZK	欧扎克 银行	OZK UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	368	92,691.41	0.01
52 3	HEICO Corp	海科航 空公司	HEI/A UN	纽约证 券交易 所	美国	131	92,649.40	0.01
52 4	Lumen Technolog ies Inc	Lumen 科技股 份有限 公司	LUMN UN	纽约证 券交易 所	美国	1,259	92,185.71	0.01
52 5	F5 Inc	F5 股份 有限公司	FFIV UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	89	91,413.03	0.01
52 6	Foot Locker Inc	富乐客 公司	FL UN	纽约证 券交易 所	美国	536	90,832.09	0.01
52 7	Ciena Corp	讯远通 信	CIEN UN	纽约证 券交易 所	美国	295	90,479.74	0.01
52 8	Interpubl ic Group of Cos Inc/The	Interp ublic 集团	IPG UN	纽约证 券交易 所	美国	479	88,502.36	0.01
52 9	KeyCorp	KeyCor p 公司	KEY UN	纽约证 券交易 所	美国	755	87,306.25	0.01
53 0	BOK Financial Corp	BOK 金 融公司	BOKF UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	169	85,724.85	0.01
53 1	East West Bancorp Inc	华美银 行集团 公司	EWBC UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	197	85,675.05	0.01
53 2	Brink's Co/The	Brink's 公司	BCO UN	纽约证 券交易	美国	208	84,749.41	0.01

				所				
53 3	JPMorgan Chase & Co	摩根大 通	JPM UN	纽约证 券交易 所	美国	112	84,646.32	0.01
53 4	SBA Communica tions Corp	SBA 通 信公司	SBAC UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	39	83,771.36	0.01
53 5	Jefferies Financial Group Inc	杰富瑞 金融集 团	JEF UN	纽约证 券交易 所	美国	451	83,601.36	0.01
53 6	Metropoli tan Bank Holding Corp	Metrop olitan Bank Holdin g Corp	MCB UN	纽约证 券交易 所	美国	177	82,465.25	0.01
53 7	Northern Trust Corp	北美信 托	NTRS UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	125	80,939.48	0.01
53 8	HubSpot Inc	HubSpo t 公司	HUBS UN	纽约证 券交易 所	美国	40	80,711.30	0.01
53 9	Armstrong World Industrie s 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	80,493.85	0.01
54 0	Hillenbra nd Inc	Hillen brand 公司	HI UN	纽约证 券交易 所	美国	292	80,270.49	0.01
54 1	AMN Healthcar e 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	79,521.23	0.01
54 2	Transcat Inc	Transc at 股份 有限公 司	TRNS UQ	纳斯达 克证券 交易所	美国	208	79,305.12	0.01
54 3	Global Industria l Co	Global Indust rial 公 司	GIC UN	纽约证 券交易 所	美国	337	76,379.02	0.01
54 4	Garmin Ltd	佳明有 限公司	GRMN UN	纽约证 券交易	美国	114	75,171.04	0.01

				所				
54 5	Manhattan Associates Inc	曼哈顿 联合软件 公司	MANH UN	纳斯达克 证券交易 所	美国	96	73,836.14	0.01
54 6	Tyler Technologies Inc	Tyler 科技公司	TYL UN	纽约证 券交易 所	美国	33	73,636.41	0.01
54 7	Century Communities Inc	世纪社 区有限 公司	CCS UN	纽约证 券交易 所	美国	238	71,831.17	0.01
54 8	Westrock Co	WestRock 公司	WRK UN	纽约证 券交易 所	美国	268	71,658.42	0.01
54 9	Uber Technologies Inc	优步技 术股份 有限公 司	UBER UN	纽约证 券交易 所	美国	520	71,403.93	0.01
55 0	Sensata Technologies Holding PLC	Sensata Technologies Holding PLC	ST UN	纽约证 券交易 所	美国	256	70,975.47	0.01
55 1	Upwork Inc	Upwork Inc	UPWK UN	纳斯 达克证 券交易 所	美国	506	70,228.63	0.01
55 2	MasTec Inc	MasTec 股份有 限公司	MTZ UN	纽约证 券交易 所	美国	146	70,217.08	0.01
55 3	Intercontinental Exchange Inc	洲际交 易所 (ICE)	ICE UN	纽约证 券交易 所	美国	111	70,056.55	0.01
55 4	PTC Inc	PTC 公 司	PTC UN	纳斯 达克证 券交易 所	美国	97	69,227.96	0.01
55 5	Plexus Corp	Plexus 有限公 司	PLXS UN	纳斯 达克证 券交易 所	美国	128	67,436.15	0.01
55 6	Lazard Ltd	Lazard 有限公 司	LAZ UN	纽约证 券交易 所	美国	303	65,907.49	0.01
55 7	Warner Bros	华纳兄 弟探索	WBD UN	纳斯 达克证 券	美国	716	64,487.96	0.01

	Discovery Inc	公司		交易所				
558	Wolfspeed Inc	Wolfspeed 股份有限公司	WOLF UN	纽约证券交易所	美国	151	64,301.59	0.01
559	Norfolk Southern Corp	诺福克南方	NSC UN	纽约证券交易所	美国	41	62,542.80	0.01
560	Five9 Inc	Five9 公司	FIVN UQ	纳斯达克证券交易所	美国	102	62,391.05	0.01
561	Valmont Industries Inc	维蒙特工业公司	VMI UN	纽约证券交易所	美国	41	61,810.85	0.00
562	Vishay Intertechnology Inc	威世公司	VSH UN	纽约证券交易所	美国	499	59,678.98	0.00
563	Snap-on Inc	实耐宝	SNA UN	纽约证券交易所	美国	45	59,505.62	0.00
564	General Electric Co	通用电气	GE UN	纽约证券交易所	美国	139	59,396.76	0.00
565	Cloudflare Inc	Cloudflare 股份有限公司	NET UN	纽约证券交易所	美国	201	59,018.37	0.00
566	Primerica Inc	Primerica 股份有限公司	PRI UN	纽约证券交易所	美国	73	58,639.99	0.00
567	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	58,584.48	0.00
568	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	138	58,311.86	0.00
569	Smartsheet Inc	Smartsheet Inc	SMAR UN	纽约证券交易所	美国	276	58,219.25	0.00

570	OneMain Holdings Inc	OneMain 控股股份有限公司	OMF UN	纽约证券交易所	美国	229	57,449.72	0.00
571	ROBLOX Corp	Roblox 公司	RBLX UN	纽约证券交易所	美国	256	56,457.37	0.00
572	AES Corp/The	爱伊斯公司	AES UN	纽约证券交易所	美国	400	56,402.61	0.00
573	BankUnited Inc	BankUnited 公司	BKU UN	纽约证券交易所	美国	231	55,145.36	0.00
574	DocuSign Inc	DocuSign 股份有限公司	DOCU UW	纳斯达克证券交易所	美国	142	54,684.22	0.00
575	Dexcom Inc	Dexcom 股份有限公司	DXCM UW	纳斯达克证券交易所	美国	108	54,021.67	0.00
576	Manulife Financial Corp	宏利金融	MFC UN	纽约证券交易所	美国	457	53,153.01	0.00
577	Paycom Software Inc	Paycom 软件股份有限公司	PAYC UN	纽约证券交易所	美国	28	52,639.93	0.00
578	Plug Power Inc	普拉格动力公司	PLUG UR	纳斯达克证券交易所	美国	471	52,378.92	0.00
579	Adient PLC	安道拓	ADNT UN	纽约证券交易所	美国	252	50,112.41	0.00
580	GMS Inc	GMS 股份有限公司	GMS UN	纽约证券交易所	美国	167	49,875.77	0.00
581	Expeditors International of Washington Inc	华盛顿康捷国际物流公司	EXPD UW	纳斯达克证券交易所	美国	73	47,748.79	0.00
582	Asbury Automotive	阿斯伯里汽车	ABG UN	纽约证券交易所	美国	42	47,733.36	0.00

	e Group Inc	集团股份有限公司		所				
583	Sonos Inc	搜诺思	SONO UW	纳斯达克证券交易所	美国	386	46,734.43	0.00
584	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	46,680.47	0.00
585	Arcosa Inc	Arcosa Inc	ACA UN	纽约证券交易所	美国	146	45,495.10	0.00
586	Biogen Inc	百健	BIIB UW	纳斯达克证券交易所	美国	32	43,799.13	0.00
587	ABM Industries Inc	ABM Industries 公司	ABM UN	纽约证券交易所	美国	147	42,837.12	0.00
588	Altra Industrial Motion Corp	Altra Industrial Motion 公司	AIMC UW	纳斯达克证券交易所	美国	181	42,820.41	0.00
589	Skechers USA Inc	斯凯奇美国公司	SKX UN	纽约证券交易所	美国	174	41,549.74	0.00
590	AMC Networks Inc	AMC 网络公司	AMCX UW	纳斯达克证券交易所	美国	210	41,041.55	0.00
591	DoorDash Inc	DoorDash 股份有限公司	DASH UN	纽约证券交易所	美国	91	39,191.02	0.00
592	ANSYS Inc	ANSYS 股份有限公司	ANSS UW	纳斯达克证券交易所	美国	24	38,543.30	0.00
593	MercadoLibre Inc	MercadoLibre 股份有限公司	MELI UW	纳斯达克证券交易所	美国	9	38,468.60	0.00
594	Covetrus Inc	Covetrus Inc	CVET UW	纳斯达克证券交易所	美国	272	37,879.14	0.00

				交易所				
59 5	PagerDuty Inc	PagerDuty Inc	PD UN	纽约证 券交易 所	美国	225	37,419.41	0.00
59 6	UniFirst Corp/MA	UniFirst 公司 /马萨 诸塞州	UNF UN	纽约证 券交易 所	美国	32	36,978.20	0.00
59 7	Unisys Corp	优利系 统	UIS UN	纽约证 券交易 所	美国	446	36,009.21	0.00
59 8	Chemed Corp	Chemed 公司	CHE UN	纽约证 券交易 所	美国	11	34,652.90	0.00
59 9	Paramount Global	派拉蒙 全球	PARA UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	207	34,286.93	0.00
60 0	Carnival Corp	嘉年华 公司	CCL UN	纽约证 券交易 所	美国	569	33,032.50	0.00
60 1	Cinemark Holdings Inc	喜满客 控股公 司	CNK UN	纽约证 券交易 所	美国	304	30,644.79	0.00
60 2	AstraZene ca PLC	阿斯利 康公共 有限公司	AZN UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	66	29,265.87	0.00
60 3	CommScope Holding Co Inc	康普控 股股份 有限公司	COMM UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	712	29,244.52	0.00
60 4	TripAdvis or Inc	猫途鹰 股份有 限公司	TRIP UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	242	28,910.03	0.00
60 5	LendingCl ub Corp	Lendin gClub 公司	LC UN	纽约证 券交易 所	美国	350	27,459.69	0.00
60 6	Citi Trends Inc	Citi Trends 股份有 限公司	CTRN UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	167	26,507.01	0.00
60 7	Big Lots Inc	Big Lots 公司	BIG UN	纽约证 券交易 所	美国	185	26,036.54	0.00

608	Take-Two Interactive Software Inc	Take-Two 互动软件股份有限公司	TTWO UW	纳斯达克证券交易所	美国	31	25,492.78	0.00
609	SiteOne Landscape Supply Inc	SiteOne Landscape Supply 股份有限公司	SITE UN	纽约证券交易所	美国	30	23,933.52	0.00
610	ModivCare Inc	ModivCare 股份有限公司	MODV UW	纳斯达克证券交易所	美国	41	23,251.65	0.00
611	Masimo Corp	Masimo 公司	MASI UW	纳斯达克证券交易所	美国	26	22,801.44	0.00
612	Upstart Holdings Inc	Upstart Holdings Inc	UPST UW	纳斯达克证券交易所	美国	105	22,282.52	0.00
613	Snap Inc	Snap 股份有限公司	SNAP UN	纽约证券交易所	美国	250	22,030.17	0.00
614	Cardinal Health Inc	嘉德诺健康集团	CAH UN	纽约证券交易所	美国	58	20,346.68	0.00
615	QIAGEN NV	德国 QIAGEN 公共有限公司	QGEN UN	纽约证券交易所	美国	64	20,273.80	0.00
616	News Corp	新闻集团	NWS UW	纳斯达克证券交易所	美国	172	18,342.79	0.00
617	Yum China Holdings Inc	百胜中国	YUMC UN	纽约证券交易所	美国	56	18,228.16	0.00
618	Coinbase Global Inc	阿帕奇公司	COIN UW	纳斯达克证券交易所	美国	57	17,987.49	0.00
619	Twilio Inc	Twilio 股份有限公司	TWLO UN	纽约证券交易所	美国	31	17,436.96	0.00

620	Teleflex Inc	泰利福公司	TFX UN	纽约证券交易所	美国	10	16,499.98	0.00
621	Stanley Black & Decker Inc	史丹利百得公司	SWK UN	纽约证券交易所	美国	21	14,778.91	0.00
622	MicroStrategy Inc	微策略公司	MSTR UW	纳斯达克证券交易所	美国	13	14,334.88	0.00
623	Cerence Inc	Cerence Inc	CRNC UW	纳斯达克证券交易所	美国	81	13,715.62	0.00
624	Carvana Co	Carvana 公司	CVNA UN	纽约证券交易所	美国	90	13,638.91	0.00
625	Owens & Minor Inc	Owens & Minor 公司	OMI UN	纽约证券交易所	美国	63	13,297.63	0.00
626	Pinterest Inc	Pinterest 股份有限公司	PINS UN	纽约证券交易所	美国	106	12,919.18	0.00
627	SiTime Corp	SiTime Corp	SITM UQ	纳斯达克证券交易所	美国	11	12,035.75	0.00
628	ABIOMED Inc	Abiomed 股份有限公司	ABMD UW	纳斯达克证券交易所	美国	7	11,627.97	0.00
629	Moody's Corp	穆迪	MCO UN	纽约证券交易所	美国	6	10,951.80	0.00
630	Bruker Corp	布鲁克公司	BRKR UW	纳斯达克证券交易所	美国	24	10,108.98	0.00
631	SkyWest Inc	SkyWest 股份有限公司	SKYW UW	纳斯达克证券交易所	美国	63	8,984.89	0.00
632	Groupon Inc	Groupon 股份有限公司	GRPN UW	纳斯达克证券交易所	美国	118	8,948.98	0.00

633	Louisiana-Pacific Corp	路易斯安娜太平洋	LPX UN	纽约证券交易所	美国	25	8,793.61	0.00
634	AZEK Co Inc/The	AZEK Co Inc/The	AZEK UN	纽约证券交易所	美国	77	8,650.86	0.00
635	iHeartMedia Inc	iHeart Media 股份有限公司	IHRT UW	纳斯达克证券交易所	美国	156	8,260.66	0.00
636	Peloton Interactive Inc	Peloton Interactive Inc	PTON UW	纳斯达克证券交易所	美国	131	8,071.00	0.00
637	Magnite Inc	Magnite 股份有限公司	MGNI UW	纳斯达克证券交易所	美国	134	7,986.03	0.00
638	Repligen Corp	Repligen 公司	RGEN UW	纳斯达克证券交易所	美国	7	7,629.52	0.00
639	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	7,612.74	0.00
640	Universal Display Corp	美国通用显示器公司	OLED UW	纳斯达克证券交易所	美国	9	6,109.12	0.00
641	Eastman Chemical Co	伊士曼化工	EMN UN	纽约证券交易所	美国	10	6,024.82	0.00
642	Zillow Group Inc	Zillow 股份有限公司	Z UW	纳斯达克证券交易所	美国	27	5,753.35	0.00
643	Wayfair Inc	Wayfair 股份有限公司	W UN	纽约证券交易所	美国	19	5,554.62	0.00
644	Coupa Software Inc	Coupa 软件股份有限公司	COUP UW	纳斯达克证券交易所	美国	12	4,598.65	0.00
64	Yelp Inc	Yelp 公	YELP UN	纽约证	美国	22	4,100.26	0.00

5		司		券交易 所				
64 6	Silvergate Capital Corp	Silver gate Capita l Corp	SI UN	纽约证 券交易 所	美国	11	3,951.87	0.00
64 7	RingCentr al Inc	RingCe ntral 股份有 限公司	RNG UN	纽约证 券交易 所	美国	8	2,805.90	0.00
64 8	Churchill Downs Inc	丘吉尔 唐斯股 份有限 公司	CHDN UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2	2,570.87	0.00
64 9	Berry Global Group Inc	Berry 全球集 团股份 有限公 司	BERY UN	纽约证 券交易 所	美国	7	2,566.98	0.00
65 0	Chegg Inc	Chegg 股份有 限公司	CHGG UN	纽约证 券交易 所	美国	20	2,520.80	0.00
65 1	Brunswick Corp/DE	宾士域 集团	BC UN	纽约证 券交易 所	美国	3	1,316.37	0.00
65 2	PACCAR Inc	帕卡	PCAR UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1	552.62	0.00
65 3	Howard Hughes Corp/The	霍华德 休斯公 司	HHC UN	纽约证 券交易 所	美国	1	456.71	0.00

注：本表所使用的证券代码为彭博代码。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净 值比例（%）
1	Amazon.com Inc	AMZN UW	13,115,654.68	0.75
2	Tesla Inc	TSLA UW	9,542,577.34	0.54
3	Coca-Cola Co/The	KO UN	9,478,623.18	0.54
4	AbbVie Inc	ABBV UN	8,012,737.36	0.46
5	Apple Inc	AAPL UW	7,752,902.97	0.44
6	Advanced Micro	AMD UR	7,641,639.91	0.44

	Devices Inc			
7	Microsoft Corp	MSFT UW	7,638,744.60	0.44
8	American Express Co	AXP UN	6,670,690.68	0.38
9	Berkshire Hathaway Inc	BRK/B UN	6,401,333.15	0.37
10	Mastercard Inc	MA UN	4,271,190.29	0.24
11	Costco Wholesale Corp	COST UW	4,005,068.89	0.23
12	UnitedHealth Group Inc	UNH UN	3,784,636.64	0.22
13	Booking Holdings Inc	BKNG UW	3,563,910.84	0.20
14	Lockheed Martin Corp	LMT UN	3,518,494.17	0.20
15	PepsiCo Inc	PEP UW	3,480,606.24	0.20
16	Caterpillar Inc	CAT UN	3,480,163.14	0.20
17	Exxon Mobil Corp	XOM UN	3,380,257.30	0.19
18	Archer-Daniels-Midland Co	ADM UN	3,333,272.41	0.19
19	Mosaic Co/The	MOS UN	3,330,270.78	0.19
20	Ameriprise Financial Inc	AMP UN	3,307,243.54	0.19

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	Apple Inc	AAPL UW	28,929,817.11	1.65
2	Microsoft Corp	MSFT UW	20,468,829.44	1.17
3	Amazon.com Inc	AMZN UW	16,708,258.38	0.95
4	NVIDIA Corp	NVDA UW	15,859,460.80	0.90
5	Alphabet Inc	GOOGL UW	11,664,027.81	0.67
6	Meta Platforms Inc	FB UW	10,018,533.45	0.57
7	Accenture PLC	ACN UN	8,143,720.12	0.46
8	Netflix Inc	NFLX UW	7,977,115.34	0.45
9	Advanced Micro Devices Inc	AMD UR	7,733,834.85	0.44
10	Intuit Inc	INTU UW	6,200,245.20	0.35
11	Adobe Inc	ADBE UW	6,144,962.62	0.35
12	Home Depot Inc/The	HD UN	5,700,554.99	0.33
13	Intuitive Surgical Inc	ISRG UW	5,542,356.05	0.32
14	Tesla Inc	TSLA UW	5,416,046.67	0.31
15	Xilinx Inc	XLNX UW	4,958,610.56	0.28

16	Lowe's Cos Inc	LOW UN	4,812,364.27	0.27
17	Fortinet Inc	FTNT UW	4,636,016.52	0.26
18	Estee Lauder Cos Inc/The	EL UN	4,505,111.95	0.26
19	Deere & Co	DE UN	4,457,878.56	0.25
20	Palo Alto Networks Inc	PANW UN	4,073,802.05	0.23

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	329,641,892.21
卖出收入（成交）总额	457,494,620.33

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

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

无。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

无。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	SPDR Gold Shares	ETF	交易型开放	State Street Global Advisors Inc	2,394,615.98	0.19

			式			
2	ARK Innovation ETF	ETF	交易型开放式	ARK Investment Management LLC	935,438.96	0.08
3	iShares S&P GSCI Commodity Indexed Trust	ETF	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	864,620.94	0.07
4	ARK Next Generation Internet ETF	ETF	交易型开放式	ARK Investment Management LLC	720,710.94	0.06
5	iPath Series B S&P 500 VIX Short-Term Futures ETN	ETN	交易型开放式	Barclays Capital Inc	100,839.32	0.01
6	VanEck Gold Miners ETF/USA	ETF	交易型开放式	Van Eck Associates Corp	79,016.00	0.01
7	iShares 20+ Year Treasury Bond ETF	ETF	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	59,362.27	-
8	ARK Autonomous Technology & Robotics ETF	ETF	交易型开放式	ARK Investment Management LLC	44,030.01	-
9	ARK Fintech Innovation ETF	ETF	交易	ARK Investment Management LLC	21,103.80	-

		F	型 开 放 式			
--	--	---	------------------	--	--	--

注：报告期末，本基金仅持有上述 9 支基金。

7.11 投资组合报告附注

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

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

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	515,665.87
4	应收利息	-
5	应收申购款	7,670,514.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,186,180.64

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数	户均持有的基 金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
嘉实美国 成长股票 型证券投 资基金- 人民币	204,703	2,158.90	46,795,599.73	10.59	395,137,253.27	89.41
嘉实美国 成长股票 型证券投 资基金- 美元现汇	623	7,963.75	-	-	4,961,418.27	100.00
合计	205,252	2,177.30	46,795,599.73	10.47	400,098,671.54	89.53

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

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管 理人所有从业 人员持有本基 金	嘉实美国成长股票型证券投资 基金-人民币	74,431.30	0.02
	嘉实美国成长股票型证券投资 基金-美元现汇	-	-
	合计	74,431.30	0.02

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实美国成长股票型证券投资基 金-人民币	嘉实美国成长股票型证券投资基 金-美元现汇
基金合同生效日 (2013年6月14日) 基金份额总额	430,245,997.74	7,592,329.66
本报告期期初基金份 额总额	488,500,747.66	4,902,802.17
本报告期基金总申购 份额	170,878,328.17	833,913.40
减：本报告期基金总 赎回份额	217,446,222.83	775,297.30
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	441,932,853.00	4,961,418.27

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

2022年5月12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》，龚康先生因工作分工不再担任公司副总经理职务，转任嘉实资本管理有限公司总经理。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人收到中国证券监督管理委员会北京监管局对公司及相关人员采取行政监管措施。公司已及时按要求改正并报告。

报告期内，基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
野村证券 NOMURA	-	374,156,311.44	48.53	263,407.41	79.83	-
瑞士信贷 (香港)有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	324,577,837.52	42.10	46,725.65	14.16	-
麦格理银行有限公司 香港分行 Macquaire Bank Limited Hong Kong Branch.	-	72,286,353.39	9.37	19,832.48	6.01	-
Wolfe Research Securities	-	-	-	-	-	-

德意志银行德意志银行股份有限公司 Deutsche Bank	-	-	-	-	-	-
花旗环球金融亚洲有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited	-	-	-	-	-	-
金贝塔证券有限公司 iGoldenbeta Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-
麦格理资本证券股份有限公司 Macquarie Securities Group	-	-	-	-	-	-
瑞银集团 Union Bank of Switzerland	-	-	-	-	-	-
中信证券国际有限公司 CITIC Securities International Company Limited	-	-	-	-	-	-

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

商的佣金合计。

2. 交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范；
- (2) 财务状况良好；
- (3) 研究能力较强；

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
野村证券 NOMURA	-	-	-	-	-	-	2,139,931.77	63.48
瑞士信贷（香港）有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	1,231,316.52	36.52
麦格理银行有限公司香港分行 Macquaire Bank Limited Hong Kong Branch.	-	-	-	-	-	-	-	-
Wolfe Research Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
德意志银行股份有限公司 Deutsche Bank	-	-	-	-	-	-	-	-
花旗环球金融亚洲有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
金贝塔证券有限公司 iGoldenbeta Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
麦格理资本证券股份有限公司 Macquarie Securities	-	-	-	-	-	-	-	-

Group								
瑞银集团 Union Bank of Switzerland	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券国际有限公司 CITIC Securities International Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于嘉实美国成长股票（QDII）2022 年 1 月 17 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	2022 年 1 月 13 日
2	关于嘉实美国成长股票（QDII）2022 年 2 月 21 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	2022 年 2 月 17 日
3	关于嘉实美国成长股票（QDII）2022 年 4 月 15 日暂停申购、赎回及定投业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 4 月 13 日
4	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	2022 年 5 月 12 日
5	关于嘉实美国成长股票（QDII）2022 年 5 月 30 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	2022 年 5 月 26 日
6	关于嘉实美国成长股票（QDII）2022 年 6 月 20 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	2022 年 6 月 16 日
7	关于嘉实美国成长股票（QDII）2022 年 7 月 4 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	2022 年 6 月 30 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

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

11.2 存放地点

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

11.3 查阅方式

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

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

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

嘉实基金管理有限公司

2022 年 8 月 29 日