

大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2025 年 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|---|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 1.2 目录 | 3 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 5 |
| 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人 | 6 |
| 2.5 信息披露方式 | 6 |
| 2.6 其他相关资料 | 6 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| §4 管理人报告 | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 9 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 11 |
| 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遵规守信情况声明 | 13 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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 | 14 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 14 |
| 6.1 资产负债表 | 14 |
| 6.2 利润表 | 15 |
| 6.3 净资产变动表 | 16 |
| 6.4 报表附注 | 18 |
| §7 投资组合报告 | 40 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 40 |
| 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 | 41 |
| 7.3 期末按行业分类的权益投资组合 | 41 |
| 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 | 42 |

| | |
|--|------------|
| 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动..... | 95 |
| 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 | 97 |
| 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 | 97 |
| 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..... | 97 |
| 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..... | 97 |
| 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 | 97 |
| 7.11 投资组合报告附注 | 97 |
| §8 基金份额持有人信息 | 98 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 98 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 98 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 | 99 |
| §9 开放式基金份额变动 | 99 |
| §10 重大事件揭示..... | 100 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 100 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 | 100 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 100 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 100 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 100 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 100 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 100 |
| 10.8 其他重大事件 | 101 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 104 |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 | 104 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 104 |
| §12 备查文件目录..... | 104 |
| 12.1 备查文件目录 | 104 |
| 12.2 存放地点 | 104 |
| 12.3 查阅方式 | 104 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|-------------------------|-------------------------|
| 基金名称 | 大成标普 500 等权重指数证券投资基金 | |
| 基金简称 | 大成标普 500 等权重指数 (QDII) | |
| 基金主代码 | 096001 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2011 年 3 月 23 日 | |
| 基金管理人 | 大成基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 387,715,650.53 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 大成标普 500 等权重指数 (QDII) A | 大成标普 500 等权重指数 (QDII) C |
| 下属分级基金的交易代码 | 096001 | 008401 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 319,716,646.34 份 | 67,999,004.19 份 |

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

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

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

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

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

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

2.5 信息披露方式

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

2.6 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2025 年 1 月 1 日 - 2025 年 6 月 30 日) | |
|---------------|---------------------------------------|-----------------------|
| | 大成标普 500 等权重指数(QDII)A | 大成标普 500 等权重指数(QDII)C |
| 本期已实现收益 | 8,617,781.54 | 1,991,891.36 |
| 本期利润 | 18,292,069.20 | 2,125,100.40 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0555 | 0.0278 |

| | | |
|---------------|------------------|----------------|
| 本期加权平均净值利润率 | 2.21% | 1.12% |
| 本期基金份额净值增长率 | 3.24% | 3.12% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2025年6月30日) | |
| 期末可供分配利润 | 222,499,483.71 | 46,516,769.98 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.6959 | 0.6841 |
| 期末基金资产净值 | 830,119,234.15 | 176,100,760.53 |
| 期末基金份额净值 | 2.5964 | 2.5898 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2025年6月30日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | 256.80% | 19.14% |

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成标普 500 等权重指数(QDII)A

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | 2.80% | 0.62% | 3.43% | 0.65% | -0.63% | -0.03% |
| 过去三个月 | 5.01% | 1.66% | 5.46% | 1.80% | -0.45% | -0.14% |
| 过去六个月 | 3.24% | 1.30% | 4.82% | 1.41% | -1.58% | -0.11% |
| 过去一年 | 10.61% | 1.05% | 12.73% | 1.13% | -2.12% | -0.08% |

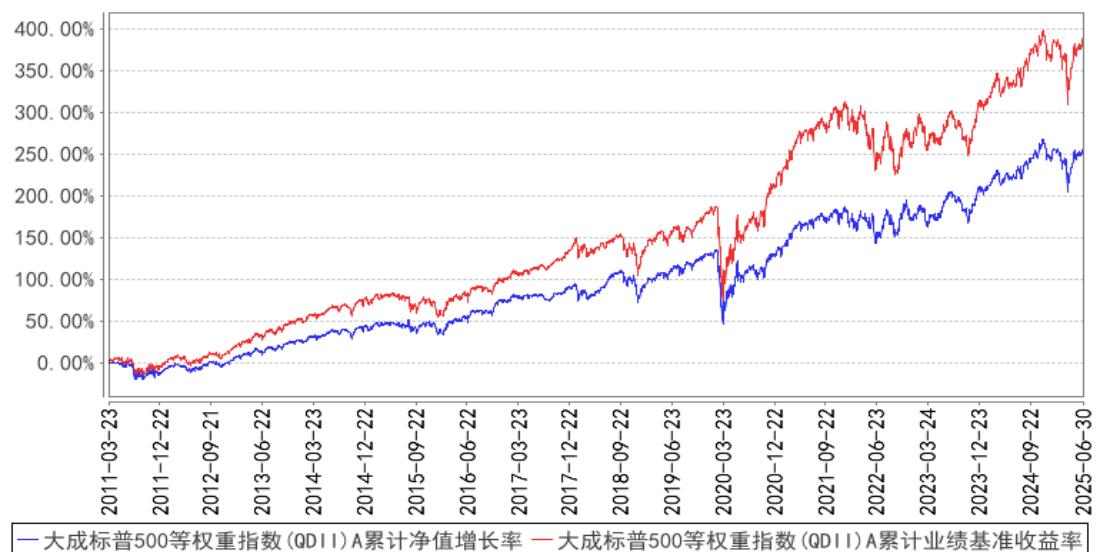
| | | | | | | |
|------------|---------|-------|---------|-------|----------|--------|
| 过去三年 | 42.47% | 0.98% | 43.37% | 1.04% | -0.90% | -0.06% |
| 自基金合同生效起至今 | 256.80% | 1.10% | 389.45% | 1.16% | -132.65% | -0.06% |

大成标普 500 等权重指数 (QDII) C

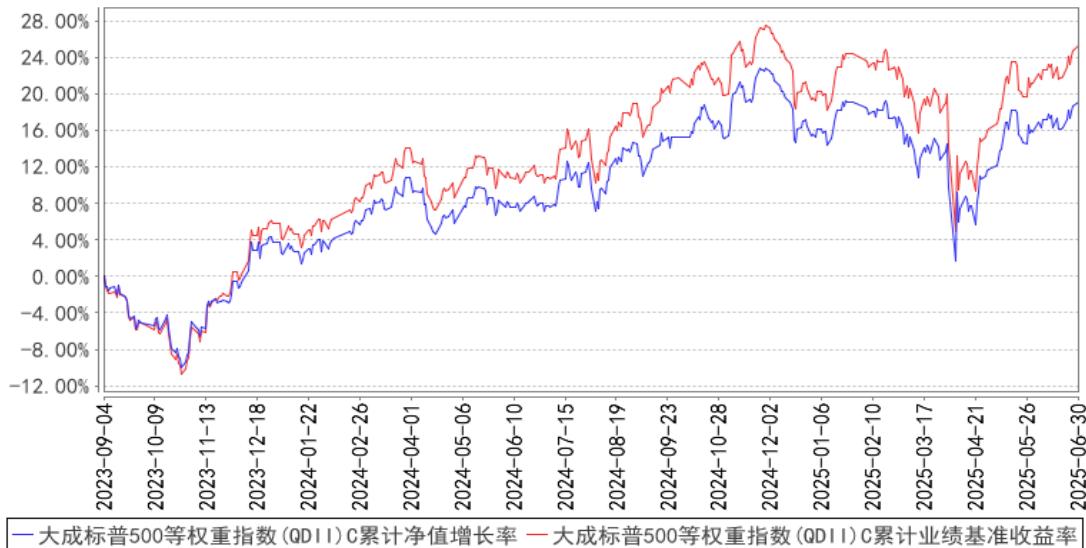
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | 2.78% | 0.62% | 3.43% | 0.65% | -0.65% | -0.03% |
| 过去三个月 | 4.92% | 1.67% | 5.46% | 1.80% | -0.54% | -0.13% |
| 过去六个月 | 3.12% | 1.30% | 4.82% | 1.41% | -1.70% | -0.11% |
| 过去一年 | 10.30% | 1.05% | 12.73% | 1.13% | -2.43% | -0.08% |
| 自基金合同生效起至今 | 19.14% | 0.91% | 25.31% | 0.98% | -6.17% | -0.07% |

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

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



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



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

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

3、同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司成立于 1999 年 4 月 12 日，注册资本人民币 2 亿元，是中国首批获准成立的“老十家”基金管理公司之一。公司总部位于深圳，同时设置了北方、华东和南方营销总部，在北京、上海等地开设有 5 家分公司。2009 年，公司在香港设立大成国际资产管理有限公司；2013 年，设立大成创新资本管理有限公司。

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

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

合实力不断提升，各项业务迅猛发展，管理资产种类位居同业前列。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理 (助理) 期限 | | 证券从 业年限 | 说明 |
|-----|-------------|----------------------|------|------------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 冉凌浩 | 本基金基 金经理 | 2011 年 8 月 26 日 | - | 22 年 | 英国曼彻斯特大学商学院金融学硕士。2003 年 4 月至 2004 年 6 月就职于国信证券研究部，任研究员。2004 年 6 月至 2005 年 9 月就职于华西证券研究部，任高级研究员。2005 年 9 月加入大成基金管理有限公司，曾担任金融工程师、境外市场研究员及基金经理助理，现任国际业务部基金经理。2011 年 8 月 26 日起任大成标普 500 等权重指数型证券投资基金基金经理。2014 年 11 月 13 日起任大成纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (QDII)(转型前为大成纳斯达克 100 指数证券投资基金) 基金经理。2016 年 12 月 2 日至 2023 年 3 月 14 日任大成恒生综合中小型股指数基金 (QDII-LOF) 基金经理。2016 年 12 月 29 日至 2020 年 7 月 7 日任大成海外中国机会混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理。2017 年 8 月 10 日起任大成恒生指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。2019 年 3 月 20 日起任大成中华沪深港 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。2021 年 5 月 18 日起任大成恒生科技交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 基金经理。2021 年 9 月 9 日起任大成恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。2023 年 7 月 12 日起任大成纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 基金经理。2024 年 5 月 29 日起任大成全球美元债债券型证券投资基金 (QDII) 基金经理。2024 年 6 月 18 日起任大成恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 基金经理。2025 年 6 月 24 日起担任大成恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII) 基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国 |

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从

业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。公司旗下投资组合间存在证券同日反向交易，但不存在参与交易所公开竞价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 5%的情形。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

7 月份以来的经济数据显示，美国宏观经济有边际走弱的趋势，因此市场对于美联储降息的预期也有所提升。

美股指数涨跌的核心因素是上市公司盈利的变动。当前彭博一致预期数据显示 2025 年美股上市公司盈利仍然有较好的增长，但从估值角度来看，当前主要美股指数的市盈率已经高于历史平均水平。

本基金的投资目标是要复制基准指数的收益率，因此本基金将坚持被动化的投资理念，持续

实施高效的组合管理策略、交易策略及风险控制方法，以期更好地跟踪指数，力争将跟踪误差控制在较低的水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成标普 500 等权重指数(QDII)A 的基金份额净值为 2.5964 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.24%，同期业绩比较基准收益率为 4.82%；截至本报告期末大成标普 500 等权重指数(QDII)C 的基金份额净值为 2.5898 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.12%，同期业绩比较基准收益率为 4.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025 年上半年，全球经济形势经历了显著波动，美国主要股指呈现剧烈震荡态势。这一时期的金融市场表现主要受到以下几方面因素的影响：

今年 2 月以来，美国政府主动缩减财政支出，对经济形成短期抑制效应。这一政策调整导致 2 月下旬起多项宏观经济指标呈现疲软态势，美国主要股指随之出现显著回调。4 月 2 日，特朗普政府正式推出“对等关税政策”，进一步加剧了宏观经济前景的不确定性。

5 月后，随着特朗普政府关税政策的实施细则逐渐明朗，市场不确定性显著降低，美国宏观经济逐步回归正常运转。5 月及 6 月的数据显示，经济活动已重新回到稳健增长轨道，主要体现在就业市场持续强劲，在此支撑下，居民消费继续保持稳步扩张态势。

二季度，特朗普政府关税政策引发的通胀预期分歧曾导致金融市场显著波动。然而，5-6 月实际通胀数据持续温和，有效缓解了市场对关税可能引发通胀抬头的担忧。由于担心关税政策对通胀影响的不确定性，美联储在今年上半年暂停了降息进程，但实际通胀数据的稳定性为美联储在下半年重启宽松周期创造了条件。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

各投研部门、风险管理部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；交易管理部负责关注相关投资品种的流动性状况，协助反馈其市场

交易信息；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管人沟通估值调整事项；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内，大成标普 500 等权重指数 (QDII) A 已分配利润 22,537,754.13 元，每十份基金份额分红 0.7451 元；大成标普 500 等权重指数 (QDII) C 已分配利润 3,673,861.39 元，每十份基金份额分红 0.7360 元；符合基金合同规定的分红比例。

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

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

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

份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本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：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2025 年 6 月 30 日 | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 货币资金 | 6. 4. 7. 1 | 65, 593, 260. 87 | 61, 453, 622. 90 |
| 结算备付金 | | — | — |
| 存出保证金 | | — | — |
| 交易性金融资产 | 6. 4. 7. 2 | 950, 510, 212. 98 | 770, 025, 843. 25 |
| 其中：股票投资 | | 950, 510, 212. 98 | 770, 025, 843. 25 |
| 基金投资 | | — | — |
| 债券投资 | | — | — |
| 资产支持证券投资 | | — | — |
| 贵金属投资 | | — | — |
| 其他投资 | | — | — |
| 衍生金融资产 | 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 | | 4, 589, 018. 45 | — |
| 应收股利 | | 904, 336. 18 | 789, 805. 31 |
| 应收申购款 | | 1, 551, 876. 20 | 8, 850, 413. 32 |
| 递延所得税资产 | | — | — |
| 其他资产 | 6. 4. 7. 8 | 149, 223. 24 | — |
| 资产总计 | | 1, 023, 297, 927. 92 | 841, 119, 684. 78 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 | 上年度末 |

| | | 2025 年 6 月 30 日 | 2024 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------|------------------|------------------|
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | — | — |
| 交易性金融负债 | | — | — |
| 衍生金融负债 | 6. 4. 7. 3 | — | — |
| 卖出回购金融资产款 | | — | — |
| 应付清算款 | | — | — |
| 应付赎回款 | | 15,904,874.28 | 6,852,047.19 |
| 应付管理人报酬 | | 827,804.33 | 705,755.73 |
| 应付托管费 | | 165,560.86 | 176,438.93 |
| 应付销售服务费 | | 45,158.22 | 21,863.15 |
| 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 | 134,535.55 | 195,614.93 |
| 负债合计 | | 17,077,933.24 | 7,951,719.93 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6. 4. 7. 10 | 387,715,650.53 | 321,984,645.37 |
| 未分配利润 | 6. 4. 7. 12 | 618,504,344.15 | 511,183,319.48 |
| 净资产合计 | | 1,006,219,994.68 | 833,167,964.85 |
| 负债和净资产总计 | | 1,023,297,927.92 | 841,119,684.78 |

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 387,715,650.53 份。其中大成标普 500 等权重指数 (QDII) A 类基金份额总额为 319,716,646.34 份，基金份额净值 2.5964 元；大成标普 500 等权重指数 (QDII) C 类基金份额总额为 67,999,004.19 份，基金份额净值 2.5898 元。

6.2 利润表

会计主体：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|----------------|-------------|--|---|
| 一、营业总收入 | | 26,955,722.76 | 31,408,854.81 |
| 1. 利息收入 | | 136,883.86 | 65,137.95 |
| 其中：存款利息收入 | 6. 4. 7. 13 | 136,883.86 | 65,137.95 |
| 债券利息收入 | | — | — |
| 资产支持证券利息 收入 | | — | — |
| 买入返售金融资产 收入 | | — | — |
| 其他利息收入 | | — | — |

| | | | |
|----------------------------|------------|---------------|---------------|
| 2. 投资收益（损失以“-”号填列） | | 20,750,580.90 | 22,687,879.61 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | 12,542,374.85 | 17,499,839.51 |
| 基金投资收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.16 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.17 | - | - |
| 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 | 8,208,206.05 | 5,188,040.10 |
| 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 | 9,807,496.70 | 10,165,405.33 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | -4,055,495.84 | -1,602,562.57 |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.22 | 316,257.14 | 92,994.49 |
| 减：二、营业总支出 | | 6,538,553.16 | 4,259,797.33 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 5,026,639.58 | 3,199,730.93 |
| 其中：暂估管理人报酬 | | - | - |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 1,081,108.10 | 799,932.72 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 280,400.88 | 55,860.34 |
| 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 | | - | - |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.24 | 150,404.60 | 204,273.34 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 20,417,169.60 | 27,149,057.48 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 20,417,169.60 | 27,149,057.48 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 20,417,169.60 | 27,149,057.48 |

6.3 净资产变动表

会计主体：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

| | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | | | |
|--|--|--------|-----------------|------------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 321,984,645.37 | - | 511,183,319.48 | 833,167,964.85 |
| 二、本期期初净资产 | 321,984,645.37 | - | 511,183,319.48 | 833,167,964.85 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | 65,731,005.16 | - | 107,321,024.67 | 173,052,029.83 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 20,417,169.60 | 20,417,169.60 |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列) | 65,731,005.16 | - | 113,115,470.59 | 178,846,475.75 |
| 其中：1. 基金申购款 | 286,179,574.93 | - | 440,401,217.62 | 726,580,792.55 |
| 2. 基金赎回款 | -220,448,569.77 | - | -327,285,747.03 | -547,734,316.80 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | - | - | -26,211,615.52 | -26,211,615.52 |
| 四、本期期末净资产 | 387,715,650.53 | - | 618,504,344.15 | 1,006,219,994.68 |
| 项目 | 上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 190,869,817.52 | - | 265,062,341.72 | 455,932,159.24 |
| 二、本期期初净资产 | 190,869,817.52 | - | 265,062,341.72 | 455,932,159.24 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | 86,586,685.86 | - | 127,726,876.58 | 214,313,562.44 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 27,149,057.48 | 27,149,057.48 |
| (二)、本期基金份额交易产生的 | 86,586,685.86 | - | 118,425,143.79 | 205,011,829.65 |

| | | | | |
|--|----------------|---|----------------|-----------------|
| 净资产变动数 (净资产减少以 “-”号填列) | | | | |
| 其中：1. 基金申 购款 | 142,709,415.53 | - | 196,215,958.18 | 338,925,373.71 |
| 2. 基金赎 回款 | -56,122,729.67 | - | -77,790,814.39 | -133,913,544.06 |
| (三)、本期向基 金份额持有人分 配利润产生的净 资产变动(净资 产减少以“-”号 填列) | - | - | -17,847,324.69 | -17,847,324.69 |
| 四、本期期末净 资产 | 277,456,503.38 | - | 392,789,218.30 | 670,245,721.68 |

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：

谭晓冈

范瑛

梁靖

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

根据本基金的基金管理人大成基金管理有限公司于 2021 年 9 月 4 日发布的《关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金增设基金份额并修订基金合同、托管协议的公告》以及更新的《大

成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同》，自 2021 年 9 月 7 日起，本基金增加美元基金份额，现有的基金份额变更为人民币基金份额。其中，以人民币计价并进行申购、赎回的份额类别，称为人民币基金份额；以美元计价并进行申购、赎回的份额类别，称为美元基金份额。各类基金份额分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。

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

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

本财务报表由本基金的基金管理人大成基金管理有限公司于 2025 年 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

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[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2025 年 6 月 30 日 |
|-----------------|------------------------|
| 活期存款 | 65,593,260.87 |
| 等于： 本金 | 65,588,679.96 |
| 加： 应计利息 | 4,580.91 |
| 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 | 65,593,260.87 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2025 年 6 月 30 日 | | | |
|-------------------|------------------------|------|----------------|----------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 828,207,789.78 | — | 950,510,212.98 | 122,302,423.20 |
| 贵金属投资-金交所 黄金合约 | — | — | — | — |
| 债券 | 交易所市场 | — | — | — |
| | 银行间市场 | — | — | — |
| | 合计 | — | — | — |
| 资产支持证券 | — | — | — | — |
| 基金 | — | — | — | — |
| 其他 | — | — | — | — |
| 合计 | 828,207,789.78 | — | 950,510,212.98 | 122,302,423.20 |

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

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2025年6月30日 |
|-------|-------------------|
| 应收利息 | - |
| 其他应收款 | 149,223.24 |

| | |
|------|--------------|
| 待摊费用 | - |
| 合计 | 149, 223. 24 |

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2025年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 27, 353. 40 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | - |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 其他 | 3, 920. 77 |
| 预提费用 | 103, 261. 38 |
| 合计 | 134, 535. 55 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

大成标普 500 等权重指数 (QDII) A

| 项目 | 本期 2025年1月1日至2025年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|--------------------|
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 285, 403, 996. 15 | 285, 403, 996. 15 |
| 本期申购 | 186, 195, 452. 69 | 186, 195, 452. 69 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -151, 882, 802. 50 | -151, 882, 802. 50 |
| 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 | 319, 716, 646. 34 | 319, 716, 646. 34 |

大成标普 500 等权重指数 (QDII) C

| 项目 | 本期 2025年1月1日至2025年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|-------------------|
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 36, 580, 649. 22 | 36, 580, 649. 22 |
| 本期申购 | 99, 984, 122. 24 | 99, 984, 122. 24 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -68, 565, 767. 27 | -68, 565, 767. 27 |
| 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 | 67, 999, 004. 19 | 67, 999, 004. 19 |

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

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

大成标普 500 等权重指数(QDII)A

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 上年度末 | 212,635,159.50 | 240,612,305.90 | 453,247,465.40 |
| 本期期初 | 212,635,159.50 | 240,612,305.90 | 453,247,465.40 |
| 本期利润 | 8,617,781.54 | 9,674,287.66 | 18,292,069.20 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 23,784,296.80 | 37,616,510.54 | 61,400,807.34 |
| 其中：基金申购款 | 130,628,916.01 | 156,239,242.93 | 286,868,158.94 |
| 基金赎回款 | -106,844,619.21 | -118,622,732.39 | -225,467,351.60 |
| 本期已分配利润 | -22,537,754.13 | - | -22,537,754.13 |
| 本期末 | 222,499,483.71 | 287,903,104.10 | 510,402,587.81 |

大成标普 500 等权重指数(QDII)C

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|----------------|----------------|-----------------|
| 上年度末 | 26,923,050.16 | 31,012,803.92 | 57,935,854.08 |
| 本期期初 | 26,923,050.16 | 31,012,803.92 | 57,935,854.08 |
| 本期利润 | 1,991,891.36 | 133,209.04 | 2,125,100.40 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 21,275,689.85 | 30,438,973.40 | 51,714,663.25 |
| 其中：基金申购款 | 66,811,579.51 | 86,721,479.17 | 153,533,058.68 |
| 基金赎回款 | -45,535,889.66 | -56,282,505.77 | -101,818,395.43 |
| 本期已分配利润 | -3,673,861.39 | - | -3,673,861.39 |
| 本期末 | 46,516,769.98 | 61,584,986.36 | 108,101,756.34 |

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|---------------------------------|
| | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
| 活期存款利息收入 | 117,103.30 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | - |
| 其他 | 19,780.56 |
| 合计 | 136,883.86 |

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------------|----------------------|
| | 2025年1月1日至2025年6月30日 |
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 12,542,374.85 |
| 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 | 12,542,374.85 |

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------|----------------------|
| | 2025年1月1日至2025年6月30日 |
| 卖出股票成交总额 | 168,701,888.47 |
| 减：卖出股票成本总额 | 155,980,452.51 |
| 减：交易费用 | 179,061.11 |
| 买卖股票差价收入 | 12,542,374.85 |

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

无。

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 贵金属投资收益**6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成**

无。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.19 衍生工具收益**6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025年1月1日至2025年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 8,208,206.05 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | — |
| 基金投资产生的股利收益 | — |
| 合计 | 8,208,206.05 |

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2025年1月1日至2025年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 9,807,496.70 |
| 股票投资 | 9,807,496.70 |
| 债券投资 | — |
| 资产支持证券投资 | — |

| | |
|------------------------|--------------|
| 基金投资 | - |
| 贵金属投资 | - |
| 其他 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| 权证投资 | - |
| 3. 其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - |
| 合计 | 9,807,496.70 |

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|---------------------------------|
| | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
| 基金赎回费收入 | 311,210.51 |
| 其他 | 5,046.63 |
| 合计 | 316,257.14 |

6.4.7.23 信用减值损失

无。

6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|---------------------------------|
| | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
| 审计费用 | 27,273.08 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 指数使用费 | 46,292.57 |
| 银行划款手续费 | 17,331.58 |
| 合计 | 150,404.60 |

6.4.7.25 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或者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 |
|----------------------|---------------------|
| 大成基金管理有限公司（“大成基金”） | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国银行股份有限公司（“中国银行”） | 基金托管人、基金销售机构 |
| 中国银行（香港）有限公司（“中银香港”） | 境外资产托管人 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|------------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 5,026,639.58 | 3,199,730.93 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 1,642,737.41 | 900,940.45 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 3,383,902.17 | 2,298,790.48 |

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025年1月1日至2025年6 月30日 | 上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 6月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,081,108.10 | 799,932.72 |

注：自 2024 年 1 月 1 日至 2025 年 2 月 27 日止，支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

根据基金管理人大成基金于 2025 年 2 月 27 日发布的《大成基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同和托管协议的公告》，自 2025 年 2 月 28 日起，支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联 方名称 | 本期 2025年1月1日至2025年6月30日 | | |
|--------------------|---------------------------------|-----------------------------|----------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 大成标普 500 等权重 指数 (QDII) A | 大成标普 500 等权重 指数 (QDII) C | 合计 |
| 大成基金 | - | 7,692.62 | 7,692.62 |
| 合计 | - | 7,692.62 | 7,692.62 |
| 获得销售服务费的各关联 方名称 | 上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 大成标普 500 等权重 指数 (QDII) A | 大成标普 500 等权重 指数 (QDII) C | 合计 |
| 大成基金 | - | 1,160.39 | 1,160.39 |
| 合计 | - | 1,160.39 | 1,160.39 |

注：C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.3%。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{该类基金份额销售服务费年费率} \div \text{当年天数}$$

H 为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为该类基金份额前一日基金资产净值

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

份额单位：份

| 项目 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---------------------------------|---|---|
| | 大成标普 500 等权重指数 (QDII)A | 大成标普 500 等权重指数 (QDII)C |
| 基金合同生效日（2011 年 3 月 23 日）持有的基金份额 | — | — |
| 报告期初持有的基金份额 | — | 4,340.28 |
| 报告期内申购/买入总份额 | — | — |
| 报告期内因拆分变动份额 | — | — |
| 减：报告期内赎回/卖出总份额 | — | 4,340.28 |
| 报告期末持有的基金份额 | — | — |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | — | — |
| 项目 | 上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
| | 大成标普 500 等权重指数 (QDII)A | 大成标普 500 等权重指数 (QDII)C |
| 基金合同生效日（2011 年 3 月 23 日）持有的基金份额 | — | — |
| 报告期初持有的基金份额 | — | 4,340.28 |

| | | |
|---------------------|---|----------|
| 报告期间申购/买入总份额 | - | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | - | 4,340.28 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | - | 0.00% |

注：基金管理人大成基金投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2025年1月1日至2025年6月30日 | | 上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日 | |
|-------|----------------------------|------------|---------------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国银行 | 60,070,230.67 | 117,103.30 | 35,271,367.46 | 65,137.95 |
| 中银香港 | 5,523,030.20 | - | 13,945,168.56 | - |

注：本基金的银行存款由基金托管人和境外资产托管人保管，按银行约定利率计息。

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

单位：人民币元

| 大成标普 500 等权重指数 (QDII) A | | | | | | | |
|-------------------------|--------------------|-----|--------------------|-----------------------|----------------------|-------------------|-------------------|
| 序号 | 权益登记日 | 除息日 | | 每 10 份基 金份额分 红数 | 现金形 式 发放总 额 | 再投资形 式 发放总额 | 本期利 润分配 合计 |
| | | 场内 | 场外 | | | | |
| 1 | 2025 年 1 月 20 日 | - | 2025 年 1 月 17 日 | 0.7451 | 8,780,753 .20 | 13,757,000 .93 | 22,537,75 4.13 |
| 合计 | - | - | - | 0.7451 | 8,780,753 .20 | 13,757,000 .93 | 22,537,75 4.13 |

| 大成标普 500 等权重指数 (QDII) C | | | | | | | |
|-------------------------|-------|-----|----|-----------------------|----------------------|-------------------|------------------|
| 序号 | 权益登记日 | 除息日 | | 每 10 份基 金份额分 红数 | 现金形 式 发放总 额 | 再投资形 式 发放总额 | 本期利 润分配 合计 |
| | | 场内 | 场外 | | | | |

| | | | | | 额 | | | |
|----|-----------------|---|-----------------|--------|------------------|------------|------------------|---|
| 1 | 2025 年 1 月 20 日 | - | 2025 年 1 月 17 日 | 0.7360 | 2,769,764 .06 | 904,097.33 | 3,673,861 .39 | - |
| 合计 | - | - | - | 0.7360 | 2,769,764 .06 | 904,097.33 | 3,673,861 .39 | - |

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去

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

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。

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

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

本期末，本基金无债券投资（上年度末：同）。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过 15%。

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

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2025 年 6 月 30 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|------------------------|---------------|-------|-------|----------------|------------------|
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 60,070,230.67 | - | - | 5,523,030.20 | 65,593,260.87 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 950,510,212.98 | 950,510,212.98 |
| 应收股利 | - | - | - | 904,336.18 | 904,336.18 |
| 应收申购款 | 38,800.31 | - | - | 1,513,075.89 | 1,551,876.20 |
| 应收清算款 | - | - | - | 4,589,018.45 | 4,589,018.45 |
| 其他资产 | - | - | - | 149,223.24 | 149,223.24 |
| 资产总计 | 60,109,030.98 | - | - | 963,188,896.94 | 1,023,297,927.92 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 15,904,874.28 | 15,904,874.28 |

| | | | | | |
|--------------------------|---------------|-------|-------|-----------------|------------------|
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 827,804.33 | 827,804.33 |
| 应付托管费 | - | - | - | 165,560.86 | 165,560.86 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 45,158.22 | 45,158.22 |
| 其他负债 | - | - | - | 134,535.55 | 134,535.55 |
| 负债总计 | - | - | - | 17,077,933.24 | 17,077,933.24 |
| 利率敏感度缺口 | 60,109,030.98 | - | - | -946,110,963.70 | 1,006,219,994.68 |
| 上年度末 2024 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 47,770,589.76 | - | - | 13,683,033.14 | 61,453,622.90 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 770,025,843.25 | 770,025,843.25 |
| 应收股利 | - | - | - | 789,805.31 | 789,805.31 |
| 应收申购款 | 125,381.69 | - | - | 8,725,031.63 | 8,850,413.32 |
| 资产总计 | 47,895,971.45 | - | - | 793,223,713.33 | 841,119,684.78 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 6,852,047.19 | 6,852,047.19 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 705,755.73 | 705,755.73 |
| 应付托管费 | - | - | - | 176,438.93 | 176,438.93 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 21,863.15 | 21,863.15 |
| 其他负债 | - | - | - | 195,614.93 | 195,614.93 |
| 负债总计 | - | - | - | 7,951,719.93 | 7,951,719.93 |
| 利率敏感度缺口 | 47,895,971.45 | - | - | -785,271,993.40 | 833,167,964.85 |

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

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

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2025 年 6 月 30 日 | | | |
|--------|------------------------|--------------|----------------|----|
| | 美元 折合人民 币元 | 港币 折合人民币元 | 其他币种 折合人民币元 | 合计 |
| 以外币计价的 | | | | |

| 资产 | | | | |
|---------------|---------------------|--------------|----------------|----------------|
| 货币资金 | 19,128,639.81 | - | - | 19,128,639.81 |
| 交易性金融资产 | 950,510,212.98 | - | - | 950,510,212.98 |
| 应收股利 | 904,336.18 | - | - | 904,336.18 |
| 应收清算款 | 4,589,018.45 | - | - | 4,589,018.45 |
| 其他资产 | 149,223.24 | - | - | 149,223.24 |
| 资产合计 | 975,281,430.66 | - | - | 975,281,430.66 |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 其他负债 | 13,913.96 | - | - | 13,913.96 |
| 负债合计 | 13,913.96 | - | - | 13,913.96 |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | 975,267,516.70 | - | - | 975,267,516.70 |
| 项目 | 上年度末 2024年12月31日 | | | |
| | 美元 折合人民币元 | 港币 折合人民币元 | 其他币种 折合人民币元 | 合计 |
| 以外币计价的资产 | | | | |
| 货币资金 | 13,684,938.78 | - | - | 13,684,938.78 |
| 交易性金融资产 | 770,025,843.25 | - | - | 770,025,843.25 |
| 应收股利 | 789,805.31 | - | - | 789,805.31 |
| 资产合计 | 784,500,587.34 | - | - | 784,500,587.34 |

| | | | | |
|---------------|----------------|---|---|----------------|
| | 87.34 | | | |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 其他负债 | 3,937.09 | - | - | 3,937.09 |
| 负债合计 | 3,937.09 | - | - | 3,937.09 |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | 784,496,650.25 | - | - | 784,496,650.25 |

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设 | 除汇率以外的其他市场变量保持不变 | | |
|----|------------------|-------------------------------|-------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元) | |
| | | 本期末 (2025 年 6 月 30 日) | 上年度末 (2024 年 12 月 31 日) |
| | 所有外币相对人民币升值 5% | 48,763,375.84 | 39,224,832.45 |
| | 所有外币相对人民币贬值 5% | -48,763,375.84 | -39,224,832.45 |

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

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

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

基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2025年6月30日 | | 上年度末 2024年12月31日 | |
|---------------|-------------------|-------------------|---------------------|-------------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值 比例 (%) | 公允价值 | 占基金资产净值 比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 950,510,212.98 | 94.46 | 770,025,843.25 | 92.42 |
| 交易性金融资产—基金投资 | — | — | — | — |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | — | — | — | — |
| 衍生金融资产—权证投资 | — | — | — | — |
| 其他 | — | — | — | — |
| 合计 | 950,510,212.98 | 94.46 | 770,025,843.25 | 92.42 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变 | | |
|----|----------------------|-----------------------------------|----------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变 动 | 对资产负债表日基金资产净值的 影响金额 (单位: 人民币元) | |
| | | 本期末 (2025 年 6 月 30 日) | 上年度末 (2024 年 12 月 31 日) |
| | 业绩比较基准上升 5% | 37,428,322.49 | 38,501,754.10 |
| | 业绩比较基准下降 5% | -37,428,322.49 | -38,501,754.10 |

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2025 年 6 月 30 日 | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次 | 950,510,212.98 | 770,025,843.25 |
| 第二层次 | — | — |
| 第三层次 | — | — |
| 合计 | 950,510,212.98 | 770,025,843.25 |

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证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；对于定期开放的基金投资，本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关投资的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具（上年度末：同）。

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货币资金、应收款项和其他金融负债等，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例（%） |
|----|--------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 950,510,212.98 | 92.89 |
| | 其中：普通股 | 950,510,212.98 | 92.89 |

| | | | |
|---|-------------------|------------------|--------|
| | 存托凭证 | - | - |
| | 优先股 | - | - |
| | 房地产信托凭证 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| | 其中：远期 | - | - |
| | 期货 | - | - |
| | 期权 | - | - |
| | 权证 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 货币市场工具 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 65,593,260.87 | 6.41 |
| 8 | 其他各项资产 | 7,194,454.07 | 0.70 |
| 9 | 合计 | 1,023,297,927.92 | 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 | 950,510,212.98 | 94.46 |
| 合计 | 950,510,212.98 | 94.46 |

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

| 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|--------|----------------|--------------|
| 通讯 | 50,034,730.80 | 4.97 |
| 非必需消费品 | 95,598,831.83 | 9.50 |
| 必需消费品 | 67,533,303.52 | 6.71 |
| 能源 | 43,088,198.61 | 4.28 |
| 金融 | 150,739,860.07 | 14.98 |
| 房地产 | 54,592,965.27 | 5.43 |
| 医疗保健 | 105,132,479.42 | 10.45 |
| 工业 | 143,724,704.41 | 14.28 |
| 材料 | 47,482,489.55 | 4.72 |
| 科技 | 133,810,712.23 | 13.30 |
| 公用事业 | 58,384,897.90 | 5.80 |
| 政府 | - | - |
| 合计 | 950,123,173.61 | 94.42 |

注：以上分类采用彭博行业分类标准。

7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

| 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|--------|------------|--------------|
| 通讯 | — | — |
| 非必需消费品 | — | — |
| 必需消费品 | — | — |
| 能源 | — | — |
| 金融 | — | — |
| 房地产 | — | — |
| 医疗保健 | — | — |
| 工业 | 387,039.37 | 0.04 |
| 材料 | — | — |
| 科技 | — | — |
| 公用事业 | — | — |
| 政府 | — | — |
| 合计 | 387,039.37 | 0.04 |

注：以上分类采用彭博行业分类标准。

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

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称(英文) | 公司名称(中文) | 证券代码 | 所在证券市场 | 所属国家(地区) | 数量(股) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|----------------------------|---------------------|--------|-----------|----------|-------|--------------|--------------|
| 1 | Capital One Financial Corp | 第一资本金融 | COF US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 3,132 | 4,770,235.62 | 0.47 |
| 2 | GE Vernova Inc. | 通用电气 Vernova 股份有限公司 | GEV US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 828 | 3,136,441.80 | 0.31 |
| 3 | Nrg Energy Inc. | NRG 能源股份有限公司 | NRG US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 2,674 | 3,073,837.84 | 0.31 |
| 4 | Seagate Technology | Seagate Technology | STX US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 2,851 | 2,945,655.30 | 0.29 |

| | | | | | | | | |
|----|--|-------------------------------|------------|--------------------|----|-------|--------------|------|
| | Holdings Public Limited Company | 控股公 共有限 公司 | | | | | | |
| 5 | Palantir Technologies Inc. | Palantir 科 技股份 有限公 司 | PLTR US | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 2,956 | 2,884,643.20 | 0.29 |
| 6 | Jabil Inc. | 捷普集 团 | JBL US | 美国 纽 约证券 交易所 | 美国 | 1,844 | 2,879,019.98 | 0.29 |
| 7 | Dollar Tree Inc. | 美元树 公司 | DLTR US | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 3,994 | 2,831,697.05 | 0.28 |
| 8 | Vistra Corp. | Vistra 公司 | VST US | 美国 纽 约证券 交易所 | 美国 | 2,028 | 2,813,663.96 | 0.28 |
| 9 | Amphe nol Corporatio n | 安费诺 公司 | APH US | 美国 纽 约证券 交易所 | 美国 | 3,936 | 2,782,404.65 | 0.28 |
| 10 | Dollar General Corporatio n | 达乐公 司 | DG US | 美国 纽 约证券 交易所 | 美国 | 3,304 | 2,705,317.41 | 0.27 |
| 11 | Quant a Services Inc. | Quanta 服务股 份有限 公司 | PWR US | 美国 纽 约证券 交易所 | 美国 | 992 | 2,684,871.30 | 0.27 |
| 12 | Royal Caribbean Cruises | 皇家加 勒比国 际游轮 有限公 司 | RCL US | 美国 纽 约证券 交易所 | 美国 | 1,192 | 2,672,039.65 | 0.27 |

| | Ltd. | | | | | | | |
|----|----------------------------------|------------------------|---------|-----------|----|--------|--------------|------|
| 13 | Constellation Energy Corporation | 美国联合能源公司 | CEG US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,148 | 2,652,465.18 | 0.26 |
| 14 | Western Digital Corp. | 西部数据公司 | WDC US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 5,757 | 2,637,159.73 | 0.26 |
| 15 | Axon Enterprise, Inc. | Axon Enterprise 股份有限公司 | AXON US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 443 | 2,625,612.84 | 0.26 |
| 16 | Mosaic Co. | Mosaic 公司 | MOS US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 10,017 | 2,615,896.76 | 0.26 |
| 17 | CrowdStrike Holdings, Inc. | CrowdStrike 控股股份有限公司 | CRWD US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 713 | 2,599,559.90 | 0.26 |
| 18 | Howmet Aerospace Inc. | Howmet 航空航天股份有限公司 | HWM US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 1,933 | 2,575,587.61 | 0.26 |
| 19 | Netflix Inc. | 奈飞公司 | NFLX US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 268 | 2,569,127.33 | 0.26 |
| 20 | Oracle Corp. | 甲骨文 | ORCL US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 1,639 | 2,565,173.85 | 0.25 |
| 21 | Carnival Corporation | 嘉年华公司 | CCL US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 12,683 | 2,553,085.77 | 0.25 |
| 22 | Ulta | Ulta | ULTA | 纳斯达 | 美国 | 751 | 2,515,051.13 | 0.25 |

| | | | | | | | | |
|----|-----------------------------|------------------|---------|-------------------------|----|--------|--------------|------|
| | Beauty, Inc. | 美容产品公司 | US | 克 证 券 交 易 所 | | | | |
| 23 | Broadcom Inc. | 博通股份有限公司 | AVGO US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美国 | 1,273 | 2,511,970.28 | 0.25 |
| 24 | Intuit Inc. | Intuit 股份有限公司 | INTU US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美国 | 442 | 2,492,141.03 | 0.25 |
| 25 | Advanced Micro Devices Inc. | AMD 公司 | AMD US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美国 | 2,453 | 2,491,770.50 | 0.25 |
| 26 | KLA Corporation | KLA 公司 | KLAC US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美国 | 384 | 2,462,301.84 | 0.24 |
| 27 | Booking Holdings Inc. | Booking 控股股份有限公司 | BKNG US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美国 | 59 | 2,445,128.35 | 0.24 |
| 28 | Northern Trust Corp. | 北美信托 | NTRS US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美国 | 2,664 | 2,417,950.01 | 0.24 |
| 29 | NVIDIA Corp. | 英伟达 | NVDA US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美国 | 2,136 | 2,415,788.69 | 0.24 |
| 30 | Microchip Technology Inc. | 美光科技股份有限公司 | MU US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美国 | 2,736 | 2,413,965.82 | 0.24 |
| 31 | Microchip Technology Inc. | 微芯科技股份有限公司 | MCHP US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美国 | 4,765 | 2,400,372.00 | 0.24 |
| 32 | Hewlett Packard | 慧与公司 | HPE US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 16,390 | 2,399,387.33 | 0.24 |

| | Enter prise Compa ny | | | | | | | |
|----|---|----------------------------|------------|--------------------|----|-------|--------------|------|
| 33 | Johns on Contr ols Inter natio nal plc | 江森自 控国际 有限公 司 | JCI US | 美国 纽 约证券 交易所 | 美国 | 3,143 | 2,376,395.06 | 0.24 |
| 34 | Newmo nt Corpo ratio n | 纽蒙黄 金公司 | NEM US | 美国 纽 约证券 交易所 | 美国 | 5,668 | 2,363,896.28 | 0.23 |
| 35 | Citig roup Inc. | 花旗集 团 | C US | 美国 纽 约证券 交易所 | 美国 | 3,851 | 2,346,568.46 | 0.23 |
| 36 | Cardi nal Healt h Inc. | 嘉德诺 健康集 团 | CAH US | 美国 纽 约证券 交易所 | 美国 | 1,950 | 2,345,157.36 | 0.23 |
| 37 | Gener al Elect ric Compa ny | 通用电 气航空 航天 | GE US | 美国 纽 约证券 交易所 | 美国 | 1,268 | 2,336,356.00 | 0.23 |
| 38 | The Goldm an Sachs Group , Inc. | 高盛 | GS US | 美国 纽 约证券 交易所 | 美国 | 461 | 2,335,656.11 | 0.23 |
| 39 | Boein g Co. | 波音 | BA US | 美国 纽 约证券 交易所 | 美国 | 1,557 | 2,335,408.85 | 0.23 |
| 40 | DoorDash, Inc. | DoorDa sh股 份有限 公司 | DASH US | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 1,317 | 2,324,065.76 | 0.23 |
| 41 | Uber Techn | 优步技 术股份 | UBER US | 美国 纽 约证券 | 美国 | 3,473 | 2,319,607.60 | 0.23 |

| | | | | | | | | |
|----|---|-----------------------------------|------------|--------------------|----|-------|--------------|------|
| | ologi es, in c. | 有限公 司 | | 交易所 | | | | |
| 42 | IDEXX Labor atori es, Inc. | 爱德士 股份有 限公司 | IDXX US | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 599 | 2,299,826.67 | 0.23 |
| 43 | Micro soft Corpo ratio n | 微软 | MSFT US | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 645 | 2,296,689.70 | 0.23 |
| 44 | Dell Techn ologi es Inc. | 戴尔科 技公司 | DELL US | 美国 纽 约证券 交易所 | 美国 | 2,615 | 2,295,040.00 | 0.23 |
| 45 | Ameri can Expre ss Co. | 美国运 通 | AXP US | 美国 纽 约证券 交易所 | 美国 | 1,003 | 2,290,300.58 | 0.23 |
| 46 | Trane Techn ologi es plc | 特灵科 技公共 有限公 司 | TT US | 美国 纽 约证券 交易所 | 美国 | 728 | 2,279,545.07 | 0.23 |
| 47 | Caden ce Desig n Syste ms, In c. | Cadenc e设计 系统股 份有限 公司 | CDNS US | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 1,033 | 2,278,718.04 | 0.23 |
| 48 | Tesla , Inc. | 特斯拉 公司 | TSLA US | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 996 | 2,264,904.87 | 0.23 |
| 49 | Arist a Netwo rks, I nc. | Arista 网络股 份有限 公司 | ANET US | 美国 纽 约证券 交易所 | 美国 | 3,081 | 2,256,513.20 | 0.22 |
| 50 | Emers on Elect ric | 艾默生 电气 | EMR US | 美国 纽 约证券 交易所 | 美国 | 2,361 | 2,253,470.94 | 0.22 |

| | Co. | | | | | | | |
|----|-------------------------------------|-------------------------|---------|------------|----|-------|--------------|------|
| 51 | JPMorgan Chase & Co. | 摩根大通 | JPM US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,085 | 2,251,754.45 | 0.22 |
| 52 | Lam Research Corp. | 泛林集团 | LRCX US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 3,229 | 2,250,025.72 | 0.22 |
| 53 | Rockwell Automation Inc. | 罗克韦尔自动化 | ROK US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 944 | 2,244,711.32 | 0.22 |
| 54 | Insulet Corporation | Insulet 股份有限公司 | PODD US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 995 | 2,237,843.50 | 0.22 |
| 55 | Corteva, Inc. | 科迪华公司 | CTVA US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 4,192 | 2,236,559.68 | 0.22 |
| 56 | Huntington Ingalls Industries, Inc. | Huntington Ingalls 工业公司 | HII US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,289 | 2,228,056.55 | 0.22 |
| 57 | The Walt Disney Company | 华特迪士尼公司 | DIS US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 2,504 | 2,222,895.92 | 0.22 |
| 58 | Monolithic Power Systems, Inc. | 芯源系统有限公司 | MPWR US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 424 | 2,219,918.51 | 0.22 |
| 59 | Texas Instruments | 德州仪器 | TXN US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,489 | 2,213,053.84 | 0.22 |

| | Incorporated | | | | | | | |
|----|--------------------------------|----------------|---------|------------|----|--------|--------------|------|
| 60 | Synchrony Financial | 同步金融公司 | SYF US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 4,613 | 2,203,929.78 | 0.22 |
| 61 | Franklin Resources Inc. | 富兰克林资源 | BEN US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 12,875 | 2,198,182.35 | 0.22 |
| 62 | Electronic Arts Inc. | 电子艺界 | EA US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,922 | 2,197,285.02 | 0.22 |
| 63 | State Street Corp. | 道富集团 | STT US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 2,883 | 2,194,670.85 | 0.22 |
| 64 | Morgan Stanley | 摩根士丹利 | MS US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 2,169 | 2,187,133.70 | 0.22 |
| 65 | TKO Group Holdings, Inc. | TKO 集团控股股份有限公司 | TKO US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,679 | 2,186,909.71 | 0.22 |
| 66 | United Rentals, Inc. | 联合租赁公司 | URI US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 405 | 2,184,282.14 | 0.22 |
| 67 | DexCom, Inc. | Dexcom 股份有限公司 | DXCM US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 3,495 | 2,183,935.31 | 0.22 |
| 68 | Hilton Worldwide Holdings Inc. | 希尔顿全球控股股份有限公司 | HLT US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,145 | 2,183,081.64 | 0.22 |
| 69 | Live | Live | LYV US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 2,012 | 2,178,901.45 | 0.22 |

| | | | | | | | | |
|----|--|----------------------------|--------------|----------------------------|-----|-------|--------------|------|
| | Natio n Enter tainm ent, Inc. | Nation 娱乐公 司 | | 约证 券 交易 所 | | | | |
| 70 | KKR & Co. Inc. | KKR & Co 股 份有限 公司 | KKR US | 美国 纽 约证 券 交易 所 | 美国 | 2,288 | 2,178,881.98 | 0.22 |
| 71 | Char les Schwa b Corp. | 嘉信理 财 | SCHW US | 美国 纽 约证 券 交易 所 | 美国 | 3,332 | 2,176,298.01 | 0.22 |
| 72 | Autod esk Inc. | 欧特克 | ADSK US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美国 | 982 | 2,176,198.22 | 0.22 |
| 73 | Appli ed Mater ials, Inc. | 应用材 料 | AMAT US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美国 | 1,659 | 2,174,160.81 | 0.22 |
| 74 | Nasda q, Inc . | 纳斯达 克股份 有限公 司 | NASDAQ US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美国 | 3,389 | 2,169,373.50 | 0.22 |
| 75 | Veris ign Inc. | 威瑞信 股份有 限公司 | VRSN US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美国 | 1,049 | 2,168,706.46 | 0.22 |
| 76 | Tapes try, Inc. | TPR-DR S-RS 公司 | TPR US | 美国 纽 约证 券 交易 所 | 美国 | 3,449 | 2,168,029.90 | 0.22 |
| 77 | HCA Healt hcare , Inc. | HCA 医 疗保健 有限公 司 | HCA US | 美国 纽 约证 券 交易 所 | 美国 | 790 | 2,166,543.13 | 0.22 |
| 78 | ON Semic onduc tor Corpo ratio n | 安森美 半导体 公司 | ON US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美国 | 5,772 | 2,165,551.81 | 0.22 |
| 79 | Eaton | 伊顿公 | ETN US | 美 国 纽 | 美 国 | 846 | 2,161,994.13 | 0.21 |

| | | | | | | | | |
|----|--|---------------------------------------|------------|-------------------------|----|-------|--------------|------|
| | Corpo ratio n Plc | 共有限 公司 | | 约 证 券 交 易 所 | | | | |
| 80 | Hubbe 11 Inc. | 哈贝尔 公司 | HUBB US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 738 | 2,157,649.14 | 0.21 |
| 81 | Servi cenow , Inc. | Servic eNow 公司 | NOW US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 293 | 2,156,366.75 | 0.21 |
| 82 | First Solar Inc. | 福思第 一太能 能公司 | FSLR US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美国 | 1,818 | 2,154,392.98 | 0.21 |
| 83 | Ralph Laure n Corpo ratio n | 拉夫劳 伦 | RL US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 1,097 | 2,153,916.51 | 0.21 |
| 84 | The Estee Laude r Compa nies Inc. | 雅诗兰 黛 | EL US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 3,722 | 2,152,860.18 | 0.21 |
| 85 | Cisco Syste ms, In c. | 思科 | CSCO US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美国 | 4,329 | 2,150,057.02 | 0.21 |
| 86 | Marat hon Petro leum Corpo ratio n | 马拉松 石油公 司 | MPC US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 1,803 | 2,143,974.43 | 0.21 |
| 87 | RTX Corpo ratio n | RTX 公 司 | RTX US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 2,045 | 2,137,635.99 | 0.21 |
| 88 | Palo Alto Netwo rks Inc. | Palo Alto Netwo rks 股 份有限 | PANW US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美国 | 1,458 | 2,135,876.55 | 0.21 |

| | | 公司 | | | | | | |
|----|--|------------------------------|--------|------------|----|-------|--------------|------|
| 89 | Philip Morris International Inc. | 菲利普莫里斯国际集团公司 | PM US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,634 | 2,130,402.37 | 0.21 |
| 90 | Parke-r-Hannifin Corp. | 派克汉尼汾公司 | PH US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 426 | 2,130,028.69 | 0.21 |
| 91 | Pentair plc | Pentair 公共有限公司 | PNR US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 2,891 | 2,124,601.32 | 0.21 |
| 92 | L3Harris Technologies, Inc. | L3Harris Technologies 股份有限公司 | LHX US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,183 | 2,124,269.59 | 0.21 |
| 93 | Moody's Corp. | 穆迪 | MCO US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 591 | 2,122,093.16 | 0.21 |
| 94 | Fidelity National Information Services, Inc. | 繁德信息技术有限公司 | FIS US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 3,630 | 2,115,497.30 | 0.21 |
| 95 | Honeywell International Inc. | 霍尼韦尔 | HON US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,268 | 2,113,876.17 | 0.21 |
| 96 | W.R. Berkley | WR Berkley 公司 | WRB US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 4,018 | 2,113,236.33 | 0.21 |

| | Corpo ratio n | | | | | | | |
|-----|--|---------------------------|------------|-------------------------|-----|-------|--------------|------|
| 97 | Trimb le Inc. | 天宝股 份有限 公司 | TRMB US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美 国 | 3,885 | 2,113,092.01 | 0.21 |
| 98 | Hasbr o Inc. | 孩之宝 | HAS US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美 国 | 3,998 | 2,112,734.51 | 0.21 |
| 99 | EQT Corp. | EQT 公 司 | EQT US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美 国 | 5,052 | 2,109,157.22 | 0.21 |
| 100 | Meta Platf orms, Inc. | Meta 平台股 份有限 公司 | META US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美 国 | 399 | 2,108,192.74 | 0.21 |
| 101 | Westi nghou se Air Brake Techn ologi es Corpo ratio n | 西屋制 动公司 | WAB US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美 国 | 1,405 | 2,105,607.34 | 0.21 |
| 102 | Iron Mount ain Inc. | 美国铁 山公司 | IRM US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美 国 | 2,860 | 2,099,976.74 | 0.21 |
| 103 | Bank of Ameri ca Corp. | 美国银 行公司 | BAC US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美 国 | 6,197 | 2,099,202.47 | 0.21 |
| 104 | Marri ott Inter natio nal Inc. | 万豪国 际 | MAR US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美 国 | 1,073 | 2,098,574.59 | 0.21 |
| 105 | Cf Indus tries Holdi | CF 工 业控股 股份有 限公司 | CF US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美 国 | 3,182 | 2,095,637.20 | 0.21 |

| | | | | | | | | |
|-----|---|--------------------------|---------|-----------|----|-------|--------------|------|
| | ngs Inc. | | | | | | | |
| 106 | Synopsys, Inc. | 新思科技公司 | SNPS US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 571 | 2,095,610.57 | 0.21 |
| 107 | Cboe Global Markets, Inc. | Cboe 环球市场公司 | CBOE US | 巴兹全球市场 | 美国 | 1,255 | 2,095,168.67 | 0.21 |
| 108 | Take-Two Interactive Software, Inc. | Take-Two 互动软件股份有限公司 | TTWO US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,204 | 2,093,113.08 | 0.21 |
| 109 | Martin Marietta Materials, Inc. | Martin Marietta 材料股份有限公司 | MLM US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 532 | 2,090,645.65 | 0.21 |
| 110 | Leidos Holdings, Inc. | Leidos 控股公司 | LDOS US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 1,851 | 2,090,409.70 | 0.21 |
| 111 | Williams Companies, Inc. | 威廉姆斯公司 | WMB US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 4,648 | 2,089,887.98 | 0.21 |
| 112 | International Business Machines Corporation | 国际商业机器公司 | IBM US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 990 | 2,089,109.99 | 0.21 |

| | n | | | | | | | |
|-----|------------------------------|--------------------|---------|------------|----|-------|--------------|------|
| 113 | Cencora, Inc. | Cencora 股份有限公司 | COR US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 973 | 2,088,550.54 | 0.21 |
| 114 | Freeport-McMoRan Inc. | 自由港迈克墨伦股份有限公司 | FCX US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 6,724 | 2,086,627.38 | 0.21 |
| 115 | TE Connectivity plc | TE Connectivity 公司 | TEL US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,727 | 2,085,250.71 | 0.21 |
| 116 | Norfolk Southern Corp. | 诺福克南方 | NSC US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,133 | 2,076,094.29 | 0.21 |
| 117 | ResMed Inc. | 瑞思迈股份有限公司 | RMD US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,123 | 2,074,089.81 | 0.21 |
| 118 | Fastenal Co | 法思诺公司 | FAST US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 6,888 | 2,070,954.35 | 0.21 |
| 119 | Charter Communications, Inc. | Charter 通信公司 | CHTR US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 707 | 2,069,040.64 | 0.21 |
| 120 | CSX Corp. | CSX 公司 | CSX US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 8,857 | 2,068,863.39 | 0.21 |
| 121 | S&P Global Inc. | 标普全球 | SPGI US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 547 | 2,064,738.03 | 0.21 |
| 122 | Gen Digital Inc. | Gen Digital 股份有限公司 | GEN US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 9,802 | 2,062,956.76 | 0.21 |
| 123 | Netapp Inc. | 美国网域存储 | NTAP US | 纳斯达克证券 | 美国 | 2,703 | 2,061,710.09 | 0.20 |

| | | | | | | | | |
|-----|-----------------------------|-----------------------------|---------|------------|----|--------|--------------|------|
| | | 技术有限公司 | | 交易所 | | | | |
| 124 | Allegion Plc | 安朗杰公共有限公司 | ALLE US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,995 | 2,058,236.38 | 0.20 |
| 125 | Wells Fargo & Co. | 富国银行 | WFC US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 3,588 | 2,057,886.75 | 0.20 |
| 126 | Expanded Energy Corporation | Expand能源公司 | EXE US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 2,453 | 2,053,471.76 | 0.20 |
| 127 | Cintas Corp | Cintas公司 | CTAS US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,286 | 2,051,732.22 | 0.20 |
| 128 | Corning Inc. | 康宁公司 | GLW US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 5,447 | 2,050,636.31 | 0.20 |
| 129 | Keysight Technologies Inc. | 是德科技公司 | KEYS US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,745 | 2,046,899.30 | 0.20 |
| 130 | Super Micro Computer, Inc. | Super Micro Computer 股份有限公司 | SMCI US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 5,823 | 2,042,958.71 | 0.20 |
| 131 | Analogue Devices Inc. | 亚德诺半导体 | ADI US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,197 | 2,039,556.30 | 0.20 |
| 132 | Huntington Bancshares Inc. | 俄亥俄州亨廷顿银行控股公司 | HBAN US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 16,998 | 2,039,388.36 | 0.20 |
| 133 | Monster Beverage | 怪兽饮料公司 | MNST US | 纳斯达克证券 | 美国 | 4,546 | 2,038,493.24 | 0.20 |

| | Beverage Corporation | | | 交易所 | | | | |
|-----|----------------------------|---------------|---------|-----------|----|-------|--------------|------|
| 134 | Align Technology, Inc. | Align科技股份有限公司 | ALGN US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,502 | 2,035,717.28 | 0.20 |
| 135 | Black Rock, Inc. | 贝莱德股份有限公司 | BLK US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 271 | 2,035,524.64 | 0.20 |
| 136 | Digital Realty Trust, Inc. | 数字房地产信托有限公司 | DLR US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 1,630 | 2,034,172.74 | 0.20 |
| 137 | US Bancorp | 美国合众银行 | USB US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 6,279 | 2,033,935.44 | 0.20 |
| 138 | Darden Restaurants Inc. | 达登餐饮公司 | DRI US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 1,302 | 2,031,588.77 | 0.20 |
| 139 | Caterpillar Inc. | 卡特彼勒 | CAT US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 731 | 2,031,478.32 | 0.20 |
| 140 | Vulcan Materials Co. | Vulcan 材料 | VMC US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 1,088 | 2,031,411.38 | 0.20 |
| 141 | Walmar Inc. | 沃尔玛股份有限公司 | WMT US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 2,902 | 2,031,306.87 | 0.20 |
| 142 | McKesson Corp. | McKesson 公司 | MCK US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 386 | 2,024,832.06 | 0.20 |
| 143 | Verisk Analytics, Inc. | Verisk 分析公司 | VRSK US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 908 | 2,024,752.74 | 0.20 |

| | | | | | | | | |
|-----|---|-----------------|---------|------------|----|--------|--------------|------|
| 144 | Trans Digm Group Incorporated | TransDigm 集团公司 | TDG US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 186 | 2,024,731.55 | 0.20 |
| 145 | EBay Inc. | eBay 股份有限公司 | EBAY US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 3,797 | 2,023,912.46 | 0.20 |
| 146 | Edwards Lifesciences Corp. | 爱德华生命科学公司 | EW US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 3,610 | 2,021,145.52 | 0.20 |
| 147 | CME Group Inc. | 芝加哥商业交易所 | CME US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,019 | 2,010,541.35 | 0.20 |
| 148 | Eversource Energy | Eversource 能源公司 | ES US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 4,402 | 2,004,803.44 | 0.20 |
| 149 | Ford Motor Co | 福特汽车 | F US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 25,790 | 2,003,130.19 | 0.20 |
| 150 | Republic Services Inc. | 公共服务公司 | RSG US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,134 | 2,001,943.58 | 0.20 |
| 151 | Hologic Inc. | 豪洛捷公司 | HOLX US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 4,283 | 1,997,824.09 | 0.20 |
| 152 | The Bank Of New York Mellon Corporation | 纽约梅隆银行 | BK US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 3,062 | 1,997,097.78 | 0.20 |
| 153 | M&T Bank Corp | M&T 银行 | MTB US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,437 | 1,995,557.32 | 0.20 |

| | ratio n | | | | | | | |
|-----|--|--|------------|------------------------|----|--------|--------------|------|
| 154 | KeyCor rp | KeyCor p 公司 | KEY US | 美国 纽 约证 券交 易所 | 美国 | 15,977 | 1,992,376.83 | 0.20 |
| 155 | AT&T Inc. | 美国电 话电报 公司 | T US | 美国 纽 约证 券交 易所 | 美国 | 9,616 | 1,992,145.60 | 0.20 |
| 156 | Chipo tle Mexica n Grill Inc. | Chipo tle Mexica n Grill 股份有 限公司 | CMG US | 美国 纽 约证 券交 易所 | 美国 | 4,941 | 1,986,061.58 | 0.20 |
| 157 | Gener al Dynam ics Corp | 通用动 力 | GD US | 美国 纽 约证 券交 易所 | 美国 | 951 | 1,985,571.29 | 0.20 |
| 158 | Junip er Netwo rks Inc. | 瞻博网 络股份 有限公 司 | JNPR US | 美国 纽 约证 券交 易所 | 美国 | 6,945 | 1,985,178.93 | 0.20 |
| 159 | Arche r-dan iel-s- midla nd Co | Archer -Danie ls-Mid land 公司 | ADM US | 美国 纽 约证 券交 易所 | 美国 | 5,253 | 1,984,745.76 | 0.20 |
| 160 | Payco m Softw are, I nc. | Paycom 软件股 份有限 公司 | PAYC US | 美国 纽 约证 券交 易所 | 美国 | 1,197 | 1,982,830.55 | 0.20 |
| 161 | Veral to Corpo ratio n | Veralt o 公司 | VLTO US | 美国 纽 约证 券交 易所 | 美国 | 2,742 | 1,981,535.56 | 0.20 |
| 162 | Carri er Globa l Corp | 开利全 球公司 | CARR US | 美国 纽 约证 券交 易所 | 美国 | 3,780 | 1,980,485.39 | 0.20 |
| 163 | Regio | Region | RF US | 美国 纽 | 美国 | 11,744 | 1,977,340.47 | 0.20 |

| | ns Financial Corp | s 金融公司 | | 约 证 券 交 易 所 | | | | |
|-----|---------------------------------|----------------------------|---------|-------------------|----|--------|--------------|------|
| 164 | Rollins, Inc. | Rollins 公司 | ROL US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 4,891 | 1,975,417.24 | 0.20 |
| 165 | Paramount Global | 派拉蒙 全球 | PARA US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美国 | 21,358 | 1,972,324.59 | 0.20 |
| 166 | Boston Scientific Corp. | 波士顿 科学 | BSX US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 2,565 | 1,972,241.90 | 0.20 |
| 167 | MGM Resorts International | 美高梅 国际酒店集团 | MGM US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 7,980 | 1,964,550.35 | 0.20 |
| 168 | Ameriprise Financial Inc. | 阿默普 莱斯金 融公司 | AMP US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 514 | 1,963,870.42 | 0.20 |
| 169 | Kindermorgan, Inc. | 特拉华 州金德 摩根公 司 | KMI US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 9,326 | 1,962,776.45 | 0.20 |
| 170 | Automatic Data Processing, Inc. | Automatic Data Proces s 公司 | ADP US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美国 | 889 | 1,962,656.18 | 0.20 |
| 171 | Labcorp Holdings Inc. | Labcor p 控股 股份有 限公司 | LH US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 1,044 | 1,961,889.07 | 0.19 |
| 172 | ANSYS, INC. | ANSYS 股份有 | ANSS US | 纳 斯 达 克 证 券 | 美国 | 779 | 1,958,595.68 | 0.19 |

| | | 限公司 | | 交易所 | | | | |
|-----|--------------------------------|----------------|---------|------------|----|--------|--------------|------|
| 173 | Citizens Financial Group, Inc. | 公民金融集团股份有限公司 | CFG US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 6,111 | 1,957,642.66 | 0.19 |
| 174 | F5, Inc. | F5 股份有限公司 | FFIV US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 929 | 1,957,327.89 | 0.19 |
| 175 | Textron Inc. | 德事隆 | TXT US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 3,401 | 1,954,772.34 | 0.19 |
| 176 | Kroger Co | 克罗格公司 | KR US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 3,805 | 1,953,815.67 | 0.19 |
| 177 | Zebra Technologies Corporation | 斑马技术公司 | ZBRA US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 885 | 1,953,571.92 | 0.19 |
| 178 | Amazon.com Inc. | 亚马逊公司 | AMZN US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,243 | 1,952,162.89 | 0.19 |
| 179 | Cbre Group, Inc. | 世邦魏理仕 | CBRE US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,943 | 1,948,951.47 | 0.19 |
| 180 | Warner Bros. Discovery, Inc. | 华纳兄弟探索股份有限公司 | WBD US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 23,736 | 1,947,243.43 | 0.19 |
| 181 | Sempra | Sempra 公司 | SRE US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 3,587 | 1,945,614.35 | 0.19 |
| 182 | United Airlines Holdings, Inc. | 美国联合航空控股股份有限公司 | UAL US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 3,413 | 1,945,544.19 | 0.19 |

| | | | | | | | | |
|-----|------------------------------------|-----------------------|---------|------------|----|-------|--------------|------|
| 183 | Skyworks Solutions, Inc. | 思佳讯解决方案公司 | SWKS US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 3,645 | 1,944,457.59 | 0.19 |
| 184 | Bunge Global SA | Bunge Global SA 公司 | BG US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 3,382 | 1,943,609.72 | 0.19 |
| 185 | PTC Inc. | PTC 公司 | PTC US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,575 | 1,943,098.17 | 0.19 |
| 186 | Steel Dynamics Inc. | Steel Dynamics 股份有限公司 | STLD US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 2,118 | 1,940,876.71 | 0.19 |
| 187 | The Hartford Insurance Group, Inc. | 哈特福德保险集团股份有限公司 | HIG US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 2,136 | 1,939,939.94 | 0.19 |
| 188 | Ball Corp. | 波尔 | BALL US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 4,824 | 1,936,960.82 | 0.19 |
| 189 | Wynn Resorts, Limited | 永利度假村有限公司 | WYNN US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 2,887 | 1,935,866.48 | 0.19 |
| 190 | GoDaddy Inc. | GoDaddy 股份有限公司 | GDDY US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,501 | 1,934,755.25 | 0.19 |
| 191 | Intuitive Surgical Inc. | 直觉外科手术公司 | ISRG US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 497 | 1,933,357.25 | 0.19 |
| 192 | Loews Corp | 罗斯公司 | L US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 2,944 | 1,931,727.02 | 0.19 |
| 193 | Genera | Genera | GNRC | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,884 | 1,931,444.97 | 0.19 |

| | | | | | | | | |
|-----|---|---------------------------|---------|-------------------|----|-------|--------------|------|
| | ac Holdl ings Inc. | c 控股 公司 | US | 约证 券交 易所 | | | | |
| 194 | Jacob s Solut ions Inc. | 嘉科解 决方案 股份有 限公司 | J US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 2,052 | 1,930,927.83 | 0.19 |
| 195 | The Pnc Finan cial Servi ces Group , Inc. | PNC 财 务服务 | PNC US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 1,446 | 1,929,695.98 | 0.19 |
| 196 | O'rei lly Autom otive Inc. | O'Reil ly汽 车股份 有限公 司 | ORLY US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美国 | 2,985 | 1,925,935.78 | 0.19 |
| 197 | Unive rsal Healt h Servi ces, I nc. | Univer sal保 健服务 股份有 限公司 | UHS US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 1,484 | 1,924,422.10 | 0.19 |
| 198 | Stryk er Corp | 史赛克 | SYK US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 679 | 1,923,034.55 | 0.19 |
| 199 | Raymo nd James Finan cial, Inc. | Raymon d James 金融股 份有限 公司 | RJF US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 1,751 | 1,922,448.26 | 0.19 |
| 200 | Delta Air Lines , Inc. | 达美航 空有限 公司 | DAL US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 5,459 | 1,921,895.26 | 0.19 |
| 201 | Inter conti nent a | 洲际交 易所 (ICE) | ICE US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 1,463 | 1,921,487.14 | 0.19 |

| | | | | | | | | |
|-----|--|--|------------|--------------------|----|--------|--------------|------|
| | 1 Excha nge, Inc. | | | | | | | |
| 202 | SBA Commu nicat ions Corpo ratio n | SBA 通 信公司 | SBAC US | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 1,142 | 1,919,845.46 | 0.19 |
| 203 | Equifax Inc. | Equifa x股份 有限公 司 | EFX US | 美国 纽 约证券 交易所 | 美国 | 1,033 | 1,917,998.04 | 0.19 |
| 204 | Intel Corpo ratio n | 英特尔 | INTC US | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 11,959 | 1,917,657.22 | 0.19 |
| 205 | PayPa l Holdi ngs Inc. | Paypal 控股股 份有限 公司 | PYPL US | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 3,604 | 1,917,425.86 | 0.19 |
| 206 | BXP, Inc. | 波士顿 地产公 司 | BXP US | 美国 纽 约证券 交易所 | 美国 | 3,960 | 1,912,643.34 | 0.19 |
| 207 | Forti net Inc. | Fortinet 股份有 限公司 | FTNT US | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 2,525 | 1,910,938.16 | 0.19 |
| 208 | Quest Diagn ostic s Inc. | Quest Diagn ostics 股份有 限公司 | DGX US | 美国 纽 约证券 交易所 | 美国 | 1,486 | 1,910,846.39 | 0.19 |
| 209 | Mark etAx es Hold ings, Inc. | Market Axess 控股公 司 | MKTX US | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 1,195 | 1,910,568.06 | 0.19 |
| 210 | Truis t Finan | Truist 金融公 司 | TFC US | 美国 纽 约证券 交易所 | 美国 | 6,208 | 1,910,500.91 | 0.19 |

| | | | | | | | | |
|-----|--------------------------------------|-------------------|---------|------------|----|-------|--------------|------|
| | cial Corp. | | | | | | | |
| 211 | Broadridge Financial Solutions, Inc. | 布罗德里奇金融解决方案股份有限公司 | BR US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,098 | 1,910,250.50 | 0.19 |
| 212 | Crown Castle Inc. | 冠城股份有限公司 | CCI US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 2,595 | 1,908,370.73 | 0.19 |
| 213 | Southwest Airlines Co. | 西南航空 | LUV US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 8,216 | 1,907,960.47 | 0.19 |
| 214 | Deere & Co. | 迪尔 | DE US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 524 | 1,907,400.09 | 0.19 |
| 215 | Valero Energy Corp. | Valero 能源 | VLO US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,975 | 1,900,461.55 | 0.19 |
| 216 | W.W. Grainger Inc. | 固安捷股份有限公司 | GWW US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 255 | 1,898,898.83 | 0.19 |
| 217 | CDW Corporation | 特拉华 CDW 公司 | CDW US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,484 | 1,897,226.29 | 0.19 |
| 218 | The Tjx Companies, Inc. | TJX 公司 | TJX US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 2,144 | 1,895,329.26 | 0.19 |
| 219 | Mastercard Inc. | 万事达股份有限公司 | MA US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 471 | 1,894,693.44 | 0.19 |
| 220 | Aptiv PLC | 安波福公共有限公司 | APTV US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 3,879 | 1,894,347.25 | 0.19 |
| 221 | STERI | 思泰瑞 | STE US | 美国 纽 | 美国 | 1,101 | 1,893,322.42 | 0.19 |

| | | | | | | | | |
|-----|-------------------------------------|------------|---------|-------------------------|----|---------|-----------------|-------|
| | S plc | 医疗公共有限公司 | | 约 证 券 交 易 所 | | | | |
| 222 | American Tower Corp. | 美国发射塔公司 | AMT US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 1, 196 | 1, 892, 303. 75 | 0. 19 |
| 223 | NXP Semiconductors N. V. | 恩智浦半导体公司 | NXPI US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美国 | 1, 209 | 1, 890, 975. 76 | 0. 19 |
| 224 | Fifth Third Banco rp | 五三银行 | FITB US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美国 | 6, 419 | 1, 889, 966. 83 | 0. 19 |
| 225 | Norwegian Cruise Line Holdings Ltd. | 挪威邮轮控股有限公司 | NCLH US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 13, 010 | 1, 888, 745. 07 | 0. 19 |
| 226 | Visa Inc. | 维萨公司 | V US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 743 | 1, 888, 454. 07 | 0. 19 |
| 227 | American International Group Inc. | 美国国际集团 | AIG US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 3, 077 | 1, 885, 291. 97 | 0. 19 |
| 228 | Costco Wholesale Corporation | 开市客 | COST US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美国 | 266 | 1, 885, 031. 47 | 0. 19 |
| 229 | Cincinnati Financial Corp. | 辛辛那提金融 | CINF US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美国 | 1, 767 | 1, 883, 725. 74 | 0. 19 |

| | | | | | | | | |
|-----|--|------------|---------|------------|----|-------|--------------|------|
| 230 | Black stone Inc. | 黑石集团股份有限公司 | BX US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,759 | 1,883,507.98 | 0.19 |
| 231 | CVS Health Corporation | CVS 健康公司 | CVS US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 3,814 | 1,883,354.07 | 0.19 |
| 232 | Centrpoint Energy Inc. | 中点能源 | CNP US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 7,158 | 1,882,603.85 | 0.19 |
| 233 | The Cigna Group | 信诺集团 | CI US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 795 | 1,881,359.54 | 0.19 |
| 234 | Lockheed Martin Corp. | 洛克希德马丁 | LMT US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 567 | 1,879,851.08 | 0.19 |
| 235 | Travelers Companies Inc. | 旅行家集团 | TRV US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 981 | 1,878,822.82 | 0.19 |
| 236 | Paychex Inc. | Paychex 公司 | PAYX US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,804 | 1,878,487.08 | 0.19 |
| 237 | Public Service Enterprise Group Incorporated | 公共服务企业集团 | PEG US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 3,108 | 1,872,914.83 | 0.19 |
| 238 | MSCI Inc. | MSCI 明晟 | MSCI US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 453 | 1,870,278.89 | 0.19 |
| 239 | Ecola | 艺康集 | ECL US | 美国 纽 | 美国 | 969 | 1,869,019.98 | 0.19 |

| | b Inc. | 团 | | 约 证 券 交 易 所 | | | | |
|-----|------------------------------------|------------------|---------|----------------|----|-------|--------------|------|
| 240 | Teledyne Technologies Incorporated | Teledyne科技股份有限公司 | TDY US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 509 | 1,866,717.98 | 0.19 |
| 241 | First Energy Corp | 第一能源 | FE US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 6,472 | 1,865,264.29 | 0.19 |
| 242 | Xylem Inc. | 赛莱默公司 | XYL US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 2,013 | 1,864,111.47 | 0.19 |
| 243 | Dominion Energy, Inc. | Dominion能源股份有限公司 | D US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 4,604 | 1,862,797.15 | 0.19 |
| 244 | Apollo Global Management, Inc. | 阿波罗全球管理股份有限公司 | APO US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,833 | 1,861,577.54 | 0.19 |
| 245 | Northrop Grumman Corp. | 诺斯洛普格鲁门公司 | NOC US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 520 | 1,861,161.55 | 0.18 |
| 246 | Atmos Energy Corporation | Atmos能源公司 | ATO US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,680 | 1,853,395.90 | 0.18 |
| 247 | Nordon Corporation | 诺信公司 | NDSN US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,207 | 1,852,249.02 | 0.18 |
| 248 | CoStar | CoStar | CSGP | 纳 斯 达 | 美国 | 3,217 | 1,851,548.98 | 0.18 |

| | | | | | | | | |
|-----|--|--|------------|-------------------------|----|-------|--------------|------|
| | Group , Inc. | 集团股 份有限 公司 | US | 克 证 券 交 易 所 | | | | |
| 249 | Airbn b, Inc . | 爱彼迎 股份有 限公司 | ABNB US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美国 | 1,954 | 1,851,159.27 | 0.18 |
| 250 | Henry Schei n Inc. | 亨利香 恩公司 | HSIC US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美国 | 3,536 | 1,849,100.74 | 0.18 |
| 251 | Abbot t Labor atori es | 雅培制 药 | ABT US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 1,898 | 1,847,970.97 | 0.18 |
| 252 | Wellt ower Inc. | Wellto wer 股 份有限 公司 | WELL US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 1,678 | 1,846,624.87 | 0.18 |
| 253 | QUALC OMM Inc. | 高通公 司 | QCOM US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美国 | 1,618 | 1,844,647.23 | 0.18 |
| 254 | Tyler Techn ologi es, Inc. | Tyler 科技公 司 | TYL US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 434 | 1,841,854.52 | 0.18 |
| 255 | Jack Henry & Assoc iates , Inc. | Jack Henry & Associ ates 公司 | JKHY US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美国 | 1,428 | 1,841,784.37 | 0.18 |
| 256 | FactS et Resea rch Syste ms Inc. | FactSe t 研究 系统股 份有限 公司 | FDS US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 575 | 1,841,091.70 | 0.18 |
| 257 | Linde plc (Irel and) | Linde 公司 | LIN US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美国 | 548 | 1,840,552.23 | 0.18 |
| 258 | Everg y, | Evergy 股份有 | EVRG US | 纳 斯 达 克 证 券 | 美国 | 3,730 | 1,840,539.77 | 0.18 |

| | Inc. | 限公司 | | 交易所 | | | | |
|-----|-----------------------------|-----------------|---------|-----------|----|--------|--------------|------|
| 259 | Caesars Entertainment, Inc. | 凯撒娱乐集团 | CZR US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 9,053 | 1,839,865.22 | 0.18 |
| 260 | Dayforce, Inc. | Dayforce 股份有限公司 | DAY US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 4,637 | 1,838,639.38 | 0.18 |
| 261 | Mondelez International Inc. | 亿滋国际 | MDLZ US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 3,806 | 1,837,445.40 | 0.18 |
| 262 | Expedia Group, Inc. | 亿客行集团股份有限公司 | EXPE US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,521 | 1,836,626.74 | 0.18 |
| 263 | Teradyne Inc. | 泰瑞达 | TER US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 2,851 | 1,835,192.44 | 0.18 |
| 264 | AutoZone Inc. | AutoZone 股份有限公司 | AZO US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 69 | 1,833,631.51 | 0.18 |
| 265 | Southern Company | 南方公司 | SO US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 2,789 | 1,833,416.75 | 0.18 |
| 266 | Hormel Foods Corp. | 荷美尔食品有限公司 | HRL US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 8,464 | 1,832,859.31 | 0.18 |
| 267 | T. Rowe Price Group Inc. | 普徕仕 | TROW US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 2,651 | 1,831,323.79 | 0.18 |
| 268 | Invesco Ltd. | 景顺有限公司 | IVZ US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 16,218 | 1,830,868.22 | 0.18 |
| 269 | NiSou | NiSour | NI US | 美国纽 | 美国 | 6,335 | 1,829,408.15 | 0.18 |

| | rce Inc. | ce 公司 | | 约 证 券 交 易 所 | | | | |
|-----|--------------------------------|-------------------|---------|-------------------|----|--------|--------------|------|
| 270 | Sysco Corp. | Sysco 公司 | SYY US | 美国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 3,358 | 1,820,681.96 | 0.18 |
| 271 | Fair Isaac Corporation | 费埃哲 公司 | FICO US | 美国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 139 | 1,818,903.19 | 0.18 |
| 272 | General Motors Company | 通用汽 车 公 司 | GM US | 美国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 5,163 | 1,818,794.31 | 0.18 |
| 273 | Waste Management Inc. | 废品管 理 | WM US | 美国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 1,109 | 1,816,576.21 | 0.18 |
| 274 | Domin o's Pizza Inc. | 达美乐 披萨公 司 | DPZ US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美国 | 563 | 1,816,049.49 | 0.18 |
| 275 | Walgreens Boots Alliance, Inc. | 沃博联 股份有 限 公 司 | WBA US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美国 | 22,083 | 1,814,797.02 | 0.18 |
| 276 | PPG Industries Inc. | PPG 工 业 | PPG US | 美国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 2,228 | 1,814,239.79 | 0.18 |
| 277 | Solventum Corporation | Solventum 公 司 | SOLV US | 美国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 3,341 | 1,813,856.38 | 0.18 |
| 278 | Realty Income Corporation | Realty Income 公 司 | O US | 美国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 4,387 | 1,809,229.27 | 0.18 |

| | n | | | | | | | |
|-----|-----------------------------|------------------|---------|-----------|----|--------|--------------|------|
| 279 | Arch Capital Group Ltd. | 阿契资本集团 | ACGL US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 2,774 | 1,808,066.93 | 0.18 |
| 280 | Ingersoll Rand Inc. | 英格索兰股份有限公司 | IR US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 3,035 | 1,807,197.88 | 0.18 |
| 281 | AMETEK, Inc. | 阿美特克股份有限公司 | AME US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 1,395 | 1,807,111.26 | 0.18 |
| 282 | Chubb Limited | 邱博保险集团 | CB US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 870 | 1,804,370.95 | 0.18 |
| 283 | Exelon Corp. | Exelon 公司 | EXC US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 5,804 | 1,804,036.50 | 0.18 |
| 284 | Motorola Solutions, Inc. | 摩托罗拉解决方案股份有限公司 | MSI US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 599 | 1,802,933.07 | 0.18 |
| 285 | Pulte group, Inc. | Pulte 集团公司 | PHM US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 2,388 | 1,802,810.94 | 0.18 |
| 286 | Las Vegas Sands Corp. | 拉斯维加斯金沙公司 | LVS US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 5,780 | 1,800,300.57 | 0.18 |
| 287 | Host Hotels & Resorts Inc. | Host 酒店及度假股份有限公司 | HST US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 16,368 | 1,799,761.38 | 0.18 |
| 288 | Verizon Communications Inc. | Verizon 通信股份有限公司 | VZ US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 5,807 | 1,798,733.48 | 0.18 |
| 289 | VICI | VICI | VICI | 美国纽 | 美国 | 7,707 | 1,798,585.36 | 0.18 |

| | | | | | | | | |
|-----|----------------------------|--------------------|----------|------------|----|-------|--------------|------|
| | Properties Inc. | Proper ties 股份有限公司 | US | 约证券交易所 | | | | |
| 290 | Globe Life Inc. | Globe Life 股份有限公司 | GL US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 2,021 | 1,798,169.38 | 0.18 |
| 291 | MetLife Inc. | 大都会集团 | MET US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 3,123 | 1,797,894.27 | 0.18 |
| 292 | The Allstate Corporation | 好事达保险公司 | ALL US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,247 | 1,797,048.91 | 0.18 |
| 293 | Comcast Corp. | 康卡斯特公司 | CMCSA US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 7,028 | 1,795,586.77 | 0.18 |
| 294 | Altria Group Inc. | 高特利 | MO US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 4,278 | 1,795,513.90 | 0.18 |
| 295 | 3M Company | 3M 公司 | MMM US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,646 | 1,793,852.38 | 0.18 |
| 296 | Prudential Financial, Inc. | 保德信金融集团 | PRU US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 2,331 | 1,792,818.68 | 0.18 |
| 297 | Coca-Cola Co | 可口可乐 | KO US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 3,536 | 1,790,881.28 | 0.18 |
| 298 | Duke Energy Corp. | 杜克能源 | DUK US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 2,120 | 1,790,795.38 | 0.18 |
| 299 | Lamb Weston Holdings, Inc. | 蓝威斯顿控股股份有限公司 | LW US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 4,820 | 1,789,055.84 | 0.18 |

| | | | | | | | | |
|-----|----------------------------------|-----------------------|---------|------------|----|--------|--------------|------|
| 300 | Ross Stores Inc. | 罗斯百货股份有限公司 | ROST US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,954 | 1,784,576.84 | 0.18 |
| 301 | DTE Energy Co. | DTE 能源 | DTE US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,882 | 1,784,565.39 | 0.18 |
| 302 | Tractor Supply Company | 拖拉机供应公司 | TSCO US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 4,723 | 1,784,157.28 | 0.18 |
| 303 | American Electric Power Co. Inc. | 美国电力 | AEP US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 2,402 | 1,784,148.76 | 0.18 |
| 304 | Keurig Dr Pepper Inc. | Keurig Dr Pepper 有限公司 | KDP US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 7,538 | 1,783,968.08 | 0.18 |
| 305 | Dover Corp. | 都福 | DOV US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,360 | 1,783,871.58 | 0.18 |
| 306 | Aflac Inc. | 家庭人寿保险 | AFL US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 2,362 | 1,783,182.35 | 0.18 |
| 307 | Kimco Realty Corp. | Kimco Realty 公司 | KIM US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 11,850 | 1,783,114.20 | 0.18 |
| 308 | Lennox International, Inc. | 雷诺士国际有限公司 | LII US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 434 | 1,780,960.60 | 0.18 |
| 309 | Energy Corp. | Entergy 公司 | ETR US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 2,992 | 1,780,308.31 | 0.18 |
| 310 | Incyt | 因赛特 | INCY | 纳斯达 | 美国 | 3,651 | 1,779,864.91 | 0.18 |

| | e Corpo ratio n | 公司 | US | 克 证 券 交 易 所 | | | | |
|-----|--|-------------------------------|------------|-------------------------|----|-------|--------------|------|
| 311 | Home Depot Inc. | 家得宝 | HD US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 678 | 1,779,498.53 | 0.18 |
| 312 | Match Group , Inc. | Match 集团股 份有 限公 司 | MTCH US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美国 | 8,045 | 1,778,984.04 | 0.18 |
| 313 | D.R. Horto n Inc. | 霍顿房 屋公司 | DHI US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 1,922 | 1,773,788.26 | 0.18 |
| 314 | Akama i Techn ologi es Inc. | 阿卡迈 技术公 司 | AKAM US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美国 | 3,104 | 1,772,290.68 | 0.18 |
| 315 | Colga te-pa lholi ve Compa ny | 高露洁 棕榄 | CL US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 2,723 | 1,771,901.68 | 0.18 |
| 316 | Geniu ne Parts Co. | 原配部 件 | GPC US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 2,038 | 1,769,819.10 | 0.18 |
| 317 | Roper Techn ologi es, In c. | 儒博技 术公司 | ROP US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美国 | 436 | 1,769,192.44 | 0.18 |
| 318 | DaVit a Inc. | DaVita 股份有 限公司 | DVA US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 1,734 | 1,768,233.62 | 0.18 |
| 319 | Smith (A.O.) Corpo ratio n | AO 史 密斯公 司 | AOS US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 3,767 | 1,768,189.88 | 0.18 |
| 320 | PPL | PPL 公 | PPL US | 美 国 纽 | 美国 | 7,280 | 1,766,164.07 | 0.18 |

| | Corp. | 司 | | 约 证 券 交 易 所 | | | | |
|-----|---------------------------------|--------------------|----------|-------------------------|----|-------|--------------|------|
| 321 | C. H. Robinson World wide, Inc. | 罗宾逊全球物流有限公司 | CHRW US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美国 | 2,571 | 1,765,936.78 | 0.18 |
| 322 | WEC Energy Group, Inc. | WEC 能源集团股份有限公司 | WEC US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 2,361 | 1,761,131.57 | 0.18 |
| 323 | Corpay, Inc. | Corpay 股份有限公司 | CPAY US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 740 | 1,757,771.32 | 0.17 |
| 324 | Workday, Inc. | Workday 股份有限公司 | WDAY US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美国 | 1,023 | 1,757,579.47 | 0.17 |
| 325 | Invitation Homes Inc. | 邀请家园公司 | IN VH US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 7,472 | 1,754,441.14 | 0.17 |
| 326 | Otis World wide Corp | 奥的斯电梯公司 | OTIS US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 2,475 | 1,754,390.32 | 0.17 |
| 327 | Avery Dennison Corp. | 艾利丹尼森 | AVY US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 1,396 | 1,753,542.88 | 0.17 |
| 328 | Nucor Corporation | 纽柯公司 | NUE US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 1,890 | 1,752,644.33 | 0.17 |
| 329 | Regency Centers Corporation | Regency Centers 公司 | REG US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美国 | 3,435 | 1,751,530.81 | 0.17 |
| 330 | Cummins | 康明斯 | CMI US | 美 国 纽 约 证 券 | 美国 | 747 | 1,751,297.80 | 0.17 |

| | Inc. | | | 交易所 | | | | |
|-----|------------------------------------|----------------------------------|---------|-----------|----|-------|--------------|------|
| 331 | Xcel Energy Inc. | Xcel 能源 | XEL US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 3,592 | 1,751,102.37 | 0.17 |
| 332 | Extra Space Storage Inc. | Extra Space Storage 有限公司 | EXR US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 1,657 | 1,748,903.82 | 0.17 |
| 333 | Exxon Mobil Corp. | 埃克森美孚石油公司 | XOM US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 2,266 | 1,748,665.58 | 0.17 |
| 334 | American Water Works Company, Inc. | 美国自来水股份有限公司 | AWK US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 1,755 | 1,747,686.64 | 0.17 |
| 335 | Old Dominion Freight Line, Inc. | Old Dominion Freight Line 股份有限公司 | ODFL US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,503 | 1,746,246.69 | 0.17 |
| 336 | Amerson Corp | Ameren 公司 | AEE US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 2,538 | 1,744,905.31 | 0.17 |
| 337 | NVR, Inc. | NVR 股份有限公司 | NVR US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 33 | 1,744,742.53 | 0.17 |
| 338 | Agilent Technologies, Inc. | 安捷伦 | A US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 2,063 | 1,742,794.31 | 0.17 |
| 339 | Equinix, Inc. | Equinix 有限公司 | EQIX US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 306 | 1,742,502.17 | 0.17 |
| 340 | Illinois Tool Works | 伊利诺伊工具股份有限公司 | ITW US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 984 | 1,741,644.43 | 0.17 |

| | Inc. | | | | | | | |
|-----|-------------------------------------|---------------|----------|------------|----|-------|--------------|------|
| 341 | Arthur J. Gallagher & Co. | 亚瑟加拉格尔有限公司 | AJG US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 760 | 1,741,624.38 | 0.17 |
| 342 | The Sherwin-williams Company | 宣伟公司 | SHW US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 707 | 1,737,789.67 | 0.17 |
| 343 | Cognizant Technology Solutions Corp | 高知特科技解决方案公司 | CTSH US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 3,111 | 1,737,759.67 | 0.17 |
| 344 | Pinnacle West Capital Corp. | Pinnacle 西部资本 | PNW US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 2,711 | 1,736,341.12 | 0.17 |
| 345 | Humania Inc. | Humana 股份有限公司 | HUM US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 992 | 1,736,133.45 | 0.17 |
| 346 | Assurant Inc. | 安信龙集团 | AIZ US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,226 | 1,733,259.85 | 0.17 |
| 347 | Equity Residential | 公寓物业权益信托 | EQR US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 3,586 | 1,732,518.22 | 0.17 |
| 348 | Berkshire Hathaway Inc. | 伯克希尔哈撒韦公司 | BRK/B US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 498 | 1,731,761.69 | 0.17 |
| 349 | Federal Realta | 联邦房地产投资信托 | FRT US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 2,546 | 1,731,268.32 | 0.17 |

| | | | | | | | | |
|-----|---|-------------------------|---------|------------|----|-------|--------------|------|
| | Key Invest ment Trust | 公司 | | | | | | |
| 350 | Consolidated Edison Inc. | 联合爱迪生 | ED US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 2,409 | 1,730,542.51 | 0.17 |
| 351 | Everest Group, Ltd. | Everest 集团有限公司 | EG US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 711 | 1,729,756.50 | 0.17 |
| 352 | West Pharmaceutical Services, Inc. | 西氏医药服务公司 | WST US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,103 | 1,727,630.75 | 0.17 |
| 353 | McDonald's Corp. | 麦当劳 | MCD US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 826 | 1,727,602.26 | 0.17 |
| 354 | Expeditors International of Washington Inc. | 华盛顿康捷国际物流公司 | EXPD US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 2,112 | 1,727,341.55 | 0.17 |
| 355 | Smurfit WestRock plc | Smurfit WestRock 公共有限公司 | SW US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 5,589 | 1,726,406.27 | 0.17 |
| 356 | CMS Energy Corp. | CMS 能源 | CMS US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 3,474 | 1,722,922.68 | 0.17 |
| 357 | Alliant Energy | Alliant 能源公司 | LNT US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 3,977 | 1,721,565.92 | 0.17 |

| | Corpo ratio n | | | | | | | |
|-----|---|------------------------------------|------------|-------------------|----|-------|--------------|------|
| 358 | Gilea d Scien ces Inc. | 吉利德 科学 | GILD US | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 2,169 | 1,721,478.87 | 0.17 |
| 359 | Lowe' s Compa nies Inc. | 劳氏 | LOW US | 美国纽 约证券 交易所 | 美国 | 1,083 | 1,720,105.70 | 0.17 |
| 360 | Hersh ey Co | 好时公 司 | HSY US | 美国纽 约证券 交易所 | 美国 | 1,446 | 1,717,804.14 | 0.17 |
| 361 | Simon Prope rty Group Inc. | 西蒙房 地产集 团公司 | SPG US | 美国纽 约证券 交易所 | 美国 | 1,491 | 1,715,867.46 | 0.17 |
| 362 | Avalon bay Commu nitie s Inc. | Avalon Bay 社 区股份 有限公 司 | AVB US | 美国纽 约证券 交易所 | 美国 | 1,177 | 1,714,624.29 | 0.17 |
| 363 | Union Pacif ic Corpo ratio n | 联合太 平洋 | UNP US | 美国纽 约证券 交易所 | 美国 | 1,041 | 1,714,579.77 | 0.17 |
| 364 | Princ ipal Finan cial Group , Inc. | 信安金 融 | PFG US | 纳斯达 克证券 交易所 | 美国 | 3,015 | 1,714,351.91 | 0.17 |
| 365 | Garmi n Ltd | 佳明有 限公司 | GRMN US | 美国纽 约证券 交易所 | 美国 | 1,147 | 1,713,782.01 | 0.17 |
| 366 | Essex Prope rty Trust | 埃塞克 斯房地 产信托 公司 | ESS US | 美国纽 约证券 交易所 | 美国 | 844 | 1,712,262.67 | 0.17 |

| | Inc. | | | | | | | |
|-----|------------------------------------|-----------------|---------|------------|----|--------|--------------|------|
| 367 | Public Storage | 公共存储 | PSA US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 815 | 1,711,888.28 | 0.17 |
| 368 | Viatris Inc. | 晖致 | VTRS US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 26,767 | 1,711,115.22 | 0.17 |
| 369 | Kellanova | Kellanova 公司 | K US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 3,005 | 1,710,816.99 | 0.17 |
| 370 | NIKE Inc. | 耐克公司 | NKE US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 3,361 | 1,709,226.28 | 0.17 |
| 371 | IDEX Corporation | 艺达思集团 | IEX US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,359 | 1,708,039.31 | 0.17 |
| 372 | Mettler-Toledo International, Inc. | 梅特勒-托利多国际股份有限公司 | MTD US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 203 | 1,707,098.17 | 0.17 |
| 373 | Zoetis Inc. | 硕腾股份有限公司 | ZTS US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,529 | 1,706,950.63 | 0.17 |
| 374 | Danaher Corp. | 丹纳赫 | DHR US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,206 | 1,705,416.47 | 0.17 |
| 375 | EOG Resources Inc. | EOG 资源 | EOG US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,990 | 1,703,917.89 | 0.17 |
| 376 | Philip Morris 66 | 菲利浦 66 | PSX US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,994 | 1,702,917.83 | 0.17 |
| 377 | Hess Corp. | 赫斯公司 | HES US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,717 | 1,702,838.95 | 0.17 |
| 378 | Progressive Corp | 前进保险公司 | PGR US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 891 | 1,702,116.50 | 0.17 |

| | | | | | | | | |
|-----|--|------------------------------|--------|------------------------|----|-------|--------------|------|
| 379 | YUM! BRAND S INC. | 百胜餐 饮集团 | YUM US | 美国 纽 约证 券 交易 所 | 美国 | 1,601 | 1,698,278.92 | 0.17 |
| 380 | Sales force , Inc. | Salesf orce 股份有 限公司 | CRM US | 美国 纽 约证 券 交易 所 | 美国 | 869 | 1,696,356.33 | 0.17 |
| 381 | Air Produ cts and Chemi cals Inc. | 空气产 品公司 | APD US | 美国 纽 约证 券 交易 所 | 美国 | 839 | 1,694,070.81 | 0.17 |
| 382 | Snap- On Inc. | 实耐宝 | SNA US | 美国 纽 约证 券 交易 所 | 美国 | 759 | 1,690,758.38 | 0.17 |
| 383 | Packa ging Corpo ratio n of Ameri ca | 美国包 装公司 | PKG US | 美国 纽 约证 券 交易 所 | 美国 | 1,253 | 1,690,344.83 | 0.17 |
| 384 | Willi s Tower s Watso n Publi c Limit ed Compa ny | 韦莱韬 睿惠悦 公共有 限公司 | WTW US | 纳 斯 达 克 证 券 交易 所 | 美国 | 770 | 1,689,465.39 | 0.17 |
| 385 | Medtr onic plc | 美敦力 | MDT US | 美国 纽 约证 券 交易 所 | 美国 | 2,702 | 1,686,088.97 | 0.17 |
| 386 | Nexte ra Energ y Inc. | 新纪元 能源公 司 | NEE US | 美国 纽 约证 券 交易 所 | 美国 | 3,391 | 1,685,157.49 | 0.17 |
| 387 | Venta s Inc. | Ventas 公司 | VTR US | 美国 纽 约证 券 | 美国 | 3,727 | 1,684,848.45 | 0.17 |

| | | | | 交易所 | | | | |
|-----|---------------------------------|---------------------------|---------|------------|----|-------|--------------|------|
| 388 | Camden Property Trust | Camden 房地产信托公司 | CPT US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 2,088 | 1,684,395.10 | 0.17 |
| 389 | Marsh & McLennan Companies Inc. | Marsh & McLennan 股份有限公司 | MMC US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,076 | 1,684,108.18 | 0.17 |
| 390 | UDR, Inc. | UDR 公司 | UDR US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 5,755 | 1,682,103.85 | 0.17 |
| 391 | Procter & Gamble Co | 宝洁 | PG US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,468 | 1,674,265.97 | 0.17 |
| 392 | Eli Lilly & Co. | 礼来 | LLY US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 300 | 1,674,103.04 | 0.17 |
| 393 | Molina Health care Inc. | Molina Health care 股份有限公司 | MOH US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 785 | 1,674,049.35 | 0.17 |
| 394 | Elevance Health, Inc. | Elevance 健康股份有限公司 | ELV US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 601 | 1,673,429.84 | 0.17 |
| 395 | Brown & Brown, Inc. | Brown & Brown 股份有限公司 | BRO US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 2,108 | 1,673,064.75 | 0.17 |
| 396 | Apple Inc. | 苹果公司 | AAPL US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,139 | 1,672,883.43 | 0.17 |
| 397 | Pfizer Inc. | 辉瑞制药 | PFE US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 9,620 | 1,669,305.34 | 0.17 |
| 398 | Chevr | 雪佛龙 | CVX US | 美国 纽 | 美国 | 1,620 | 1,660,564.69 | 0.17 |

| | on Corpo ratio n | | | 约 证 券 交 易 所 | | | | |
|-----|--|---|------------|-------------------------|-----|--------|--------------|------|
| 399 | Johns on & Johns on | 强生 | JNJ US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美 国 | 1,518 | 1,659,896.80 | 0.16 |
| 400 | Diamo ndbac k Energ y, Inc. | Diamon dback 能源股 份有 限公 司 | FANG US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美 国 | 1,687 | 1,659,319.10 | 0.16 |
| 401 | Epam Syste ms, Inc. | EPAM 系统公 司 | EPAM US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美 国 | 1,307 | 1,654,379.23 | 0.16 |
| 402 | Waterr s Corp. | 沃特世 公司 | WAT US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美 国 | 662 | 1,654,098.19 | 0.16 |
| 403 | Willia ms-S onoma , Inc. | Willia ms-Son oma 股 份有 限公 司 | WSM US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美 国 | 1,414 | 1,653,673.68 | 0.16 |
| 404 | FedEx Corp. | 联邦快 递 | FDX US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美 国 | 1,015 | 1,651,629.69 | 0.16 |
| 405 | Coter ra Energ y Inc. | Coterr a能 源 股 份 有 限 公 司 | CTRA US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美 国 | 9,083 | 1,650,247.29 | 0.16 |
| 406 | T-Mob ile US, Inc. | T-Mobi le US 股份有 限公司 | TMUS US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美 国 | 967 | 1,649,322.97 | 0.16 |
| 407 | APA Corpo ratio n | APA 公 司 | APA US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美 国 | 12,586 | 1,647,894.97 | 0.16 |
| 408 | Targa Resou rces Corp. | Targa 资源公 司 | TRGP US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美 国 | 1,322 | 1,647,435.53 | 0.16 |

| | | | | | | | | |
|-----|--|--------------------|---------|------------|----|-------|--------------|------|
| 409 | Edison International | 爱迪生国际 | EIX US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 4,458 | 1,646,712.80 | 0.16 |
| 410 | Tyson Foods Inc. | 泰森食品公司 | TSN US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 4,112 | 1,646,658.97 | 0.16 |
| 411 | Lennar Corp | Lennar 公司 | LEN US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 2,079 | 1,646,178.70 | 0.16 |
| 412 | J.B. Hunt Transport Services, Inc. | JB Hunt 运输服务股份有限公司 | JBHT US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,601 | 1,645,787.91 | 0.16 |
| 413 | McCormick & Co Inc. | 味好美股份有限公司 | MKC US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 3,032 | 1,645,663.64 | 0.16 |
| 414 | The Interpublic Group of Companies, Inc. | Interpublic 集团 | IPG US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 9,386 | 1,644,826.37 | 0.16 |
| 415 | PACCAR Inc. | 帕卡 | PCAR US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 2,416 | 1,644,079.58 | 0.16 |
| 416 | Centene Corporation | Centene 公司 | CNC US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 4,231 | 1,644,034.63 | 0.16 |
| 417 | Starbucks Corporation | 星巴克 | SBUX US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 2,506 | 1,643,791.95 | 0.16 |
| 418 | CarMax | CarMax | KMX US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 3,409 | 1,640,170.49 | 0.16 |

| | x Inc. | 股份有限公司 | | 约 证 券 交 易 所 | | | | |
|-----|---|--------------------------------|---------|-------------------------|----|--------|--------------|------|
| 419 | Amcor plc. | 安姆科 公共有限公司 | AMCR US | 美国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 24,907 | 1,638,570.11 | 0.16 |
| 420 | Copart, Inc. | Copart 股份有限公司 | CPRT US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美国 | 4,663 | 1,637,983.68 | 0.16 |
| 421 | International Paper Co | 国际纸业 | IP US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 4,885 | 1,637,633.91 | 0.16 |
| 422 | International Flavors & Fragrances Inc. | 国际香料 | IFF US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 3,109 | 1,636,935.23 | 0.16 |
| 423 | Mohawk Industries, Inc. | Mohawk 工业股 份有 限公 司 | MHK US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 2,180 | 1,636,106.62 | 0.16 |
| 424 | Best Buy Co., Inc. | 百思买 | BBY US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 3,404 | 1,635,815.41 | 0.16 |
| 425 | Kimberly-Clark Corp. | 金佰利 | KMB US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 1,767 | 1,630,740.82 | 0.16 |
| 426 | Accenture Plc | 埃森哲 公司 | ACN US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 762 | 1,630,401.07 | 0.16 |
| 427 | Target Corp | 塔吉特 公司 | TGT US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 2,305 | 1,627,781.53 | 0.16 |
| 428 | ConocoPhillips | 康菲石 油 | COP US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美国 | 2,530 | 1,625,304.29 | 0.16 |
| 429 | Devon Energy | 戴文能 源 | DVN US | 美 国 纽 约 证 券 | 美国 | 7,117 | 1,620,648.12 | 0.16 |

| | | | | 交易所 | | | | |
|-----|---|-----------------------------|---------|------------|----|--------|--------------|------|
| 430 | Mid-American Apartment Communities Inc. | MID-AMERICA APARTMENT COMM | MAA US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,528 | 1,618,983.82 | 0.16 |
| 431 | Occidental Petroleum Corp | 西方石油 | OXY US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 5,365 | 1,613,431.40 | 0.16 |
| 432 | ProLogis, Inc. | 安博 | PLD US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 2,137 | 1,608,118.21 | 0.16 |
| 433 | DuPont de Nemours, Inc. | 杜邦公司 | DD US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 3,275 | 1,608,052.42 | 0.16 |
| 434 | Kenvue Inc. | Kenvue 公司 | KVUE US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 10,720 | 1,606,172.22 | 0.16 |
| 435 | Masco Corp. | 马斯可 | MAS US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 3,477 | 1,601,949.50 | 0.16 |
| 436 | Baker Hughes Company | 贝克休斯公司 | BKR US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 5,822 | 1,597,910.34 | 0.16 |
| 437 | Builders First Source, Inc. | Builders FirstSource 股份有限公司 | BLDR US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,910 | 1,595,493.73 | 0.16 |
| 438 | The Cooper Companies, Inc. | 库柏股份有限公司 | COO US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 3,127 | 1,592,912.49 | 0.16 |

| | Inc. | | | | | | | |
|-----|--|---------------|---------|------------|----|--------|--------------|------|
| 439 | Omnicom Group Inc. | Omnicom 集团 | OMC US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 3,091 | 1,591,833.11 | 0.16 |
| 440 | Vertex Pharmaceuticals Inc. | 福泰制药 | VRTX US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 499 | 1,590,317.35 | 0.16 |
| 441 | Biogen Inc. | 渤健公司 | BIIB US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,764 | 1,585,921.68 | 0.16 |
| 442 | Aon Plc | 怡安公共有限公司 | AON US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 620 | 1,583,419.32 | 0.16 |
| 443 | Amgen Inc. | 安进公司 | AMGN US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 791 | 1,581,013.39 | 0.16 |
| 444 | Pepsi Co, Inc. | 百事可乐 | PEP US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,669 | 1,577,574.76 | 0.16 |
| 445 | The AES Corporation | 爱伊斯公司 | AES US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 20,907 | 1,574,474.22 | 0.16 |
| 446 | Charles River Laboratories International, Inc. | 查理斯河实验室国际有限公司 | CRL US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,449 | 1,573,866.67 | 0.16 |
| 447 | Constellation Brands Inc. | 星座品牌股份有限公司 | STZ US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,345 | 1,566,334.61 | 0.16 |
| 448 | The J. M. | JM 斯马克公 | SJM US | 美国 纽约证券 | 美国 | 2,227 | 1,565,524.26 | 0.16 |

| | Smuck er Company | 司 | | 交易所 | | | | |
|-----|---------------------------------|-------------------------------|---------|-----------|----|-------|--------------|------|
| 449 | GE HealthCare Technologies Inc. | GE HealthCare Technologies 公司 | GEHC US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 2,951 | 1,564,730.87 | 0.16 |
| 450 | Church & Dwight Company, Inc. | 切迟杜威股份有限公司 | CHD US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 2,268 | 1,560,413.59 | 0.16 |
| 451 | Adobe Inc. | 奥多比 | ADBE US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 563 | 1,559,239.29 | 0.15 |
| 452 | Baxter International Inc. | 百特 | BAX US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 7,187 | 1,557,871.43 | 0.15 |
| 453 | Oneok Inc. | Oneok 股份有限公司 | OKE US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 2,660 | 1,554,388.34 | 0.15 |
| 454 | Gartner, Inc. | Gartner 公司 | IT US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 537 | 1,553,889.67 | 0.15 |
| 455 | Weyerhaeuser Co. | 惠好 | WY US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 8,449 | 1,553,808.56 | 0.15 |
| 456 | Zimmer Biomet Holdings, Inc. | 捷迈邦美控股股份有限公司 | ZBH US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 2,377 | 1,552,028.65 | 0.15 |
| 457 | United | 联合包裹服务 | UPS US | 美国纽约证券 | 美国 | 2,145 | 1,549,953.59 | 0.15 |

| | | | | | | | | |
|-----|--|--|------------|--------------------|----|--------|--------------|------|
| | Parce l Servi ce Inc. | 股份有 限公司 | | 交易所 | | | | |
| 458 | Abbvi e Inc. | 艾伯维 股份有 限公司 | ABBV US | 美国 纽 约证券 交易所 | 美国 | 1,166 | 1,549,356.70 | 0.15 |
| 459 | Pool Corpo ratio n | Pool 公司 | POOL US | 纳 斯达 克证券 交易所 | 美国 | 741 | 1,546,162.25 | 0.15 |
| 460 | LKQ Corpo ratio n | LKQ 公 司 | LKQ US | 纳 斯达 克证券 交易所 | 美国 | 5,814 | 1,540,359.92 | 0.15 |
| 461 | Revvit y, In c. | Revvit y股份 有限公 司 | RVTY US | 美国 纽 约证券 交易所 | 美国 | 2,217 | 1,535,006.00 | 0.15 |
| 462 | Healt hpeak Prope rties , Inc. | Health peak Proper ties 公司 | DOC US | 美国 纽 约证券 交易所 | 美国 | 12,244 | 1,534,749.72 | 0.15 |
| 463 | Gener al Mills , Inc. | 通用磨 坊 | GIS US | 美国 纽 约证券 交易所 | 美国 | 4,120 | 1,528,054.71 | 0.15 |
| 464 | Globa l Payme nts Inc. | 环汇有 限公司 | GPN US | 美国 纽 约证券 交易所 | 美国 | 2,662 | 1,525,257.70 | 0.15 |
| 465 | Albem arle Corpo ratio n | 雅保公 司 | ALB US | 美国 纽 约证券 交易所 | 美国 | 3,396 | 1,523,545.65 | 0.15 |
| 466 | PG&E Corpo ratio n | 太平洋 煤气电 力 | PCG US | 美国 纽 约证券 交易所 | 美国 | 15,248 | 1,521,611.40 | 0.15 |
| 467 | HP Inc. | 惠普 | HPQ US | 美国 纽 约证券 | 美国 | 8,687 | 1,521,088.11 | 0.15 |

| | | | | 交易所 | | | | |
|-----|-----------------------------|------------------------|---------|-----------|----|--------|--------------|------|
| 468 | Bio-Technology Corporation | Bio-technology Company | TECH US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 4,106 | 1,512,280.74 | 0.15 |
| 469 | The Kraft Heinz Company | 卡夫亨氏公司 | KHC US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 8,162 | 1,508,623.69 | 0.15 |
| 470 | IQVIA Holdings Inc. | 艾昆纬 | IQV US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 1,333 | 1,503,788.99 | 0.15 |
| 471 | Merck & Co., Inc. | 默克 | MRK US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 2,649 | 1,501,121.48 | 0.15 |
| 472 | Deckers Outdoor Corporation | 德克斯户外用品公司 | DECK US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 2,034 | 1,500,760.26 | 0.15 |
| 473 | Schlumberger NV | 斯伦贝谢公众有限公司 | SLB US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 6,175 | 1,494,107.20 | 0.15 |
| 474 | Stanley Black & Decker Inc. | 史丹利百得公司 | SWK US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 3,047 | 1,477,780.22 | 0.15 |
| 475 | News Corp | 新闻集团 | NWSA US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 6,900 | 1,467,999.78 | 0.15 |
| 476 | Erie Indemnity Company | 伊利赔偿公司 | ERIE US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 590 | 1,464,693.23 | 0.15 |
| 477 | Halliburton | 哈利伯 | HAL US | 美国纽 | 美国 | 10,009 | 1,460,235.71 | 0.15 |

| | | | | | | | | |
|-----|---------------------------------|-----------------------------|---------|----------------------|-----|-------|--------------|------|
| | burton Co | 顿 | | 约 证 券 交 易 所 | | | | |
| 478 | Fiserv Inc. | Fiserv 股份有限公司 | FI US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美 国 | 1,170 | 1,444,030.64 | 0.14 |
| 479 | The Clorox Co. | 高乐氏公司 | CLX US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美 国 | 1,676 | 1,440,577.48 | 0.14 |
| 480 | Molson Coors Beverage Company | 莫尔森库尔斯饮料公司 | TAP US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美 国 | 4,165 | 1,433,830.71 | 0.14 |
| 481 | Eastman Chemical Co. | 伊士曼化工 | EMN US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美 国 | 2,676 | 1,430,217.84 | 0.14 |
| 482 | Lyondellbasell Industries N. v. | 利安德巴塞尔工业公司 | LYB US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美 国 | 3,426 | 1,419,037.54 | 0.14 |
| 483 | The Campbell's Company | 金宝汤公司 | CPB US | 纳 斯 达 克 证 券 交 易 所 | 美 国 | 6,410 | 1,406,425.09 | 0.14 |
| 484 | Thermo Fisher Scientific Inc. | Thermo Fisher Scientific 公司 | TMO US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美 国 | 482 | 1,399,017.51 | 0.14 |
| 485 | Conagra Brands, Inc. | 康尼格拉品牌股份有限公司 | CAG US | 美 国 纽 约 证 券 交 易 所 | 美 国 | 9,545 | 1,398,691.29 | 0.14 |
| 486 | Moderna, In | 莫德纳公司 | MRNA US | 纳 斯 达 克 证 券 | 美 国 | 7,064 | 1,395,180.79 | 0.14 |

| | c. | | | 交易所 | | | | |
|-----|---------------------------------|----------------------------|---------|------------|----|-------|--------------|------|
| 487 | Brown-Forman Corporation | 百富门公司 | BF/B US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 7,231 | 1,392,964.84 | 0.14 |
| 488 | Texas Pacific Land Corporation | 德克萨斯州太平洋土地公司 | TPL US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 183 | 1,383,896.04 | 0.14 |
| 489 | Bristol-Myers Squibb Co. | 百时美施贵宝公司 | BMY US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 4,135 | 1,370,221.54 | 0.14 |
| 490 | Becton, Dickinson & Co. | 碧迪 | BDX US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 1,105 | 1,362,541.08 | 0.14 |
| 491 | Regeneron Pharmaceuticals, Inc. | 再生元制药股份有限公司 | REGN US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 358 | 1,345,458.87 | 0.13 |
| 492 | lululemon Athletica inc. | Lululemon Athletica 股份有限公司 | LULU US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 781 | 1,328,278.09 | 0.13 |
| 493 | Dow Inc. | 陶氏公司 | DOW US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 6,918 | 1,311,374.20 | 0.13 |
| 494 | Alexandria Real Estate Equities | 亚历山大房地产股份有限公司 | ARE US | 美国 纽约证券交易所 | 美国 | 2,510 | 1,305,022.09 | 0.13 |

| | ies, I nc. | | | | | | | |
|-----|-------------------------|-------------------|----------|-----------|----|-------|--------------|------|
| 495 | Coinbase Global, Inc. | Coinbase 全球股份有限公司 | COIN US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 500 | 1,254,508.86 | 0.12 |
| 496 | Fortive Corporation | 福迪威公司 | FTV US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 3,347 | 1,249,026.16 | 0.12 |
| 497 | Fox Corporation | 福克斯公司 | FOXA US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 3,029 | 1,215,137.70 | 0.12 |
| 498 | Enphase Energy, Inc. | Enphase 能源股份有限公司 | ENPH US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 4,229 | 1,200,352.97 | 0.12 |
| 499 | UnitedHealth Group Inc. | 联合健康集团 | UNH US | 美国纽约证券交易所 | 美国 | 514 | 1,147,899.98 | 0.11 |
| 500 | Alphabet Inc. | Alphabet 公司 | GOOGL US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 813 | 1,025,648.34 | 0.10 |
| 501 | Alphabet Inc. | Alphabet 公司 | GOOG US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 659 | 836,840.41 | 0.08 |
| 502 | Fox Corporation | 福克斯公司 | FOX US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,834 | 677,843.68 | 0.07 |
| 503 | News Corp | 新闻集团 | NWS US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 2,038 | 500,556.37 | 0.05 |

7.4.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称（英） | 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（%） |
|----|---------|----------|------|--------|----------|-------|------|--------------|
|----|---------|----------|------|--------|----------|-------|------|--------------|

| | 文) | | | | | | | |
|---|-------------------------------------|---------------------|--------|----------------------|----|-------|------------|------|
| 1 | Ralli ant Corpo ratio n | Rallia nt 公 司 | RAL US | 美国 纽 约证 券 交易 所 | 美国 | 1,115 | 387,039.37 | 0.04 |

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 | Expand Energy Corporation | EXE US | 2,241,564.65 | 0.27 |
| 2 | DoorDash, Inc. | DASH US | 2,175,946.46 | 0.26 |
| 3 | TKO Group Holdings, Inc. | TKO US | 2,139,756.49 | 0.26 |
| 4 | Williams-Sonoma, Inc. | WSM US | 2,005,891.38 | 0.24 |
| 5 | Capital One Financial Corp | COF US | 2,005,125.68 | 0.24 |
| 6 | Tesla, Inc. | TSLA US | 1,348,807.84 | 0.16 |
| 7 | Coinbase Global, Inc. | COIN US | 1,259,877.81 | 0.15 |
| 8 | ON Semiconductor Corporation | ON US | 1,224,184.04 | 0.15 |
| 9 | Western Digital Corp. | WDC US | 1,208,688.23 | 0.15 |
| 10 | Hewlett Packard Enterprise Company | HPE US | 1,197,936.64 | 0.14 |
| 11 | Deckers Outdoor Corporation | DECK US | 1,197,475.24 | 0.14 |
| 12 | Dayforce, Inc. | DAY US | 1,170,013.17 | 0.14 |
| 13 | Norwegian Cruise Line Holdings Ltd. | NCLH US | 1,164,401.60 | 0.14 |
| 14 | Delta Air Lines, Inc. | DAL US | 1,139,541.15 | 0.14 |
| 15 | United Airlines Holdings, Inc. | UAL US | 1,128,129.67 | 0.14 |
| 16 | Align Technology, Inc. | ALGN US | 1,102,548.31 | 0.13 |
| 17 | Teradyne Inc. | TER US | 1,101,522.33 | 0.13 |
| 18 | Arista Networks, Inc. | ANET US | 1,080,657.49 | 0.13 |

| | | | | |
|----|----------------------------|--------|--------------|------|
| 19 | Carnival Corporation | CCL US | 1,073,872.44 | 0.13 |
| 20 | Lamb Weston Holdings, Inc. | LW US | 1,072,129.41 | 0.13 |

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

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 | CELANESE CORP | CE US | 1,904,355.92 | 0.23 |
| 2 | BORGWARNER INC | BWA US | 1,836,816.90 | 0.22 |
| 3 | TELEFLEX INC | TFX US | 1,657,587.91 | 0.20 |
| 4 | FMC CORP | FMC US | 1,617,463.53 | 0.19 |
| 5 | DISCOVER FINANCIAL SERVICES | DFS US | 1,518,944.75 | 0.18 |
| 6 | CVS Health Corporation | CVS US | 1,010,794.68 | 0.12 |
| 7 | Gilead Sciences Inc. | GILD US | 866,038.88 | 0.10 |
| 8 | Palantir Technologies Inc. | PLTR US | 863,215.65 | 0.10 |
| 9 | Abbvie Inc. | ABBV US | 834,030.62 | 0.10 |
| 10 | Philip Morris International Inc. | PM US | 808,126.90 | 0.10 |
| 11 | General Electric Company | GE US | 800,215.84 | 0.10 |
| 12 | Exelon Corp. | EXC US | 792,181.16 | 0.10 |
| 13 | Globe Life Inc. | GL US | 791,454.36 | 0.09 |
| 14 | Uber Technologies, inc. | UBER US | 788,953.92 | 0.09 |
| 15 | Darden Restaurants Inc. | DRI US | 758,292.88 | 0.09 |
| 16 | Arthur J. Gallagher & Co. | AJG US | 749,067.12 | 0.09 |
| 17 | Tapestry, Inc. | TPR US | 724,463.08 | 0.09 |
| 18 | Abbott Laboratories | ABT US | 717,499.00 | 0.09 |
| 19 | Howmet Aerospace Inc. | HWM US | 709,394.43 | 0.09 |
| 20 | Amgen Inc. | AMGN US | 697,684.41 | 0.08 |

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

交易费用。

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 | 326,657,325.54 |
| 卖出收入（成交）总额 | 168,701,888.47 |

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

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

无。

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

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

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未超出基金合同规定的备选股票库。

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 | 4,589,018.45 |
| 3 | 应收股利 | 904,336.18 |
| 4 | 应收利息 | — |
| 5 | 应收申购款 | 1,551,876.20 |
| 6 | 其他应收款 | 149,223.24 |
| 7 | 待摊费用 | — |

| | | |
|---|----|--------------|
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 7,194,454.07 |

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

7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|------------------------|----------|-----------|---------------|-----------|----------------|-----------|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例(%) | 持有份额 | 占总份额比例(%) |
| 大成标普 500 等权重指数 (QDII)A | 107,272 | 2,980.43 | 76,847,176.09 | 24.04 | 242,869,470.25 | 75.96 |
| 大成标普 500 等权重指数 (QDII)C | 87,175 | 780.03 | 3,352,897.90 | 4.93 | 64,646,106.29 | 95.07 |
| 合计 | 194,447 | 1,993.94 | 80,200,073.99 | 20.69 | 307,515,576.54 | 79.31 |

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

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

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 | 大成标普 500 等权重指数 | 45,561.87 | 0.0143 |

| | | | |
|-------------------------------|----------------------------|-----------|--------|
| 理人所 有从业 人员持 有本基 金 | (QDII) A | | |
| | 大成标普 500 等权重指数 (QDII) C | 20,389.58 | 0.0300 |
| | 合计 | 65,951.45 | 0.0170 |

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

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 大成标普 500 等权重指数 (QDII) A | 大成标普 500 等权重指数 (QDII) C |
|------------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 基金合同生效日 (2011 年 3 月 23 日) | 822,754,222.26 | - |
| 基金份额总额 | | |
| 本报告期期初基金份 额总额 | 285,403,996.15 | 36,580,649.22 |
| 本报告期基金总申购 份额 | 186,195,452.69 | 99,984,122.24 |
| 减：本报告期基金总 赎回份额 | 151,882,802.50 | 68,565,767.27 |
| 本报告期基金拆分变 动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份 额总额 | 319,716,646.34 | 67,999,004.19 |

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

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

无。

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

一、基金管理人的重大人事变动

无。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

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

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，自 2024 年 12 月 11 日起，改聘容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元 数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|--------|------------|--------------|-------------------------|------------|-----------------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成 交总额的比例 (%) | 佣金 | 占当期佣金 总量的比例 (%) | |
| Morgan | 1 | 381,090,896. | 77.36 | 146,924.68 | 83.42 | - |

| | | | | | | |
|---|---|----------------|-------|-----------|-------|---|
| Stanley | | 25 | | | | |
| CLSA Limited | 1 | 111,507,674.76 | 22.64 | 29,209.03 | 16.58 | - |
| Daiwa Capital Markets Hong Kong Limited | 1 | - | - | - | - | - |

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

（一）筛选标准

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

（二）筛选流程

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

2、公司按照白名单与证券公司进行协议签署。

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

无。

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 | 大成基金管理有限公司关于再次提醒投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 6 月 30 日 |
| 2 | 大成标普 500 等权重指数证券投资基金(美元 A 类份额)基金产品资料概要更新 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 6 月 30 日 |
| 3 | 大成标普 500 等权重指数证券投资基金(人民币 C 类份额)基金产品资料概要更新 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 6 月 30 日 |
| 4 | 大成标普 500 等权重指数证券投资基金(美元 C 类份额)基金产品资料概要更新 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 6 月 30 日 |
| 5 | 大成标普 500 等权重指数证券投资基金 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 6 月 30 日 |

| | | | |
|----|--|--------------------------|-----------------|
| | 金(人民币 A 类份额)基金产品资料概要更新 | 露网站、规定报刊及本公司网站 | |
| 6 | 关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金调整大额申购(含定期定额申购)业务的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 6 月 30 日 |
| 7 | 大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 6 月 6 日 |
| 8 | 大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 4 月 26 日 |
| 9 | 大成标普 500 等权重指数证券投资基金更新招募说明书 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 4 月 23 日 |
| 10 | 大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2025 年第 1 季度报告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 4 月 22 日 |
| 11 | 关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金调整大额申购(含定期定额申购)业务的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 4 月 8 日 |
| 12 | 大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2024 年年度报告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 3 月 31 日 |
| 13 | 大成基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况(2024 年度) | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 3 月 31 日 |
| 14 | 大成标普 500 等权重指数证券投资基金(人民币 C 类份额)基金产品资料概要更新 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 3 月 21 日 |
| 15 | 大成标普 500 等权重指数证券投资基金更新招募说明书 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 3 月 21 日 |
| 16 | 大成标普 500 等权重指数证券投资基金(人民币 A 类份额)基金产品资料概要更新 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 3 月 21 日 |
| 17 | 大成标普 500 等权重指数证券投资基金(美元 C 类份额)基金产品资料概要更新 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 3 月 21 日 |
| 18 | 大成标普 500 等权重指数证券投资基金(美元 A 类份额)基金产品资料概要更新 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 3 月 21 日 |
| 19 | 大成标普 500 等权重指数证券投资基 金托管协议 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 3 月 20 日 |

| | | | |
|----|--|--------------------------|-----------------|
| 20 | 大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 3 月 20 日 |
| 21 | 关于大成基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 3 月 19 日 |
| 22 | 大成标普 500 等权重指数证券投资基金更新招募说明书 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 2 月 28 日 |
| 23 | 大成标普 500 等权重指数证券投资基金(美元 C 类份额)基金产品资料概要更新 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 2 月 28 日 |
| 24 | 大成标普 500 等权重指数证券投资基金(人民币 A 类份额)基金产品资料概要更新 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 2 月 28 日 |
| 25 | 大成标普 500 等权重指数证券投资基金(人民币 C 类份额)基金产品资料概要更新 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 2 月 28 日 |
| 26 | 大成标普 500 等权重指数证券投资基金(美元 A 类份额)基金产品资料概要更新 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 2 月 28 日 |
| 27 | 大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 2 月 27 日 |
| 28 | 大成标普 500 等权重指数证券投资基金托管协议 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 2 月 27 日 |
| 29 | 大成基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同和托管协议的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 2 月 27 日 |
| 30 | 大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2024 年第 4 季度报告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 1 月 22 日 |
| 31 | 大成基金管理有限公司关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2024 年度第 1 次分红的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 1 月 16 日 |
| 32 | 关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金暂停大额申购(含定期定额申购)业务的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 1 月 11 日 |
| 33 | 关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金恢复大额申购(含定期定额申购)业务的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 1 月 10 日 |
| 34 | 大成基金管理有限公司关于旗下部分基金 2025 年境外(地区)主要市场节 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2025 年 1 月 4 日 |

| | | |
|---------------|------|--|
| 假日暂停申购赎回安排的公告 | 公司网站 | |
|---------------|------|--|

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

大成基金管理有限公司

2025 年 8 月 29 日