大成标普 500 等权重指数证券投资基金
2026 年中期报告

2026 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：2026 年 8 月 28 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2026 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 14
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 92
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 94
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 94

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 94
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 94
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 94
7.11 投资组合报告附注 94

§8 基金份额持有人信息 95

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 95
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 95
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 96

§9 开放式基金份额变动 96

§10 重大事件揭示 96

10.1 基金份额持有人大会决议 96
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 96
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 97
10.4 基金投资策略的改变 97
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 97
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 97
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 97
10.8 其他重大事件 98

§11 影响投资者决策的其他重要信息 100

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 100
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 100

§12 备查文件目录 100

12.1 备查文件目录 100
12.2 存放地点 100
12.3 查阅方式 100

§1 基金简介

1.1 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	337,764,012.88 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	262,138,981.62 份	75,625,031.26 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)。

1.2 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。

1.3 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	许俊
	联系电话	0755-83183388	010-66596688

	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
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

1.4 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

1.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.dcfund.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人住所

1.6 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

§2 主要财务指标和基金净值表现

2.1 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(2026年1月1日 - 2026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	36,503,718.58	9,379,127.86
本期利润	50,044,090.33	13,144,061.29
加权平均基金份额本期利润	0.2093	0.2153
本期加权平均净值利润率	7.83%	8.08%

本期基金份额净值增长率	7.63%	7.47%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	256,879,259.29	72,617,941.81
期末可供分配基金份额利润	0.9799	0.9602
期末基金资产净值	730,385,358.59	209,635,785.48
期末基金份额净值	2.7863	2.7720
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	296.14%	31.88%

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。

2.2 基金净值表现

2.2.1 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

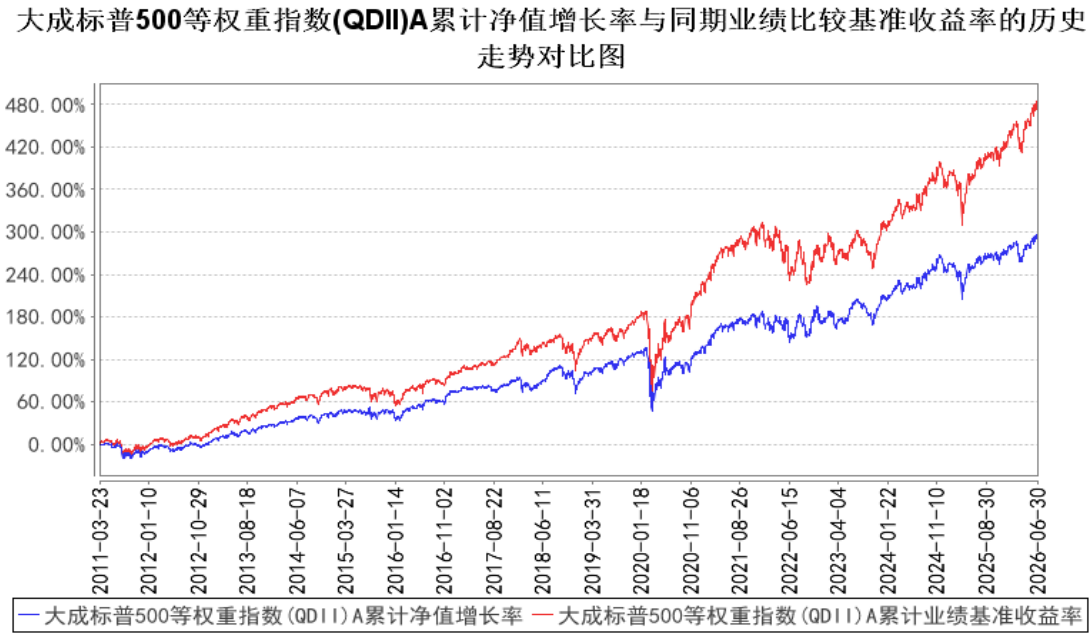
大成标普 500 等权重指数(QDII)A 人民币

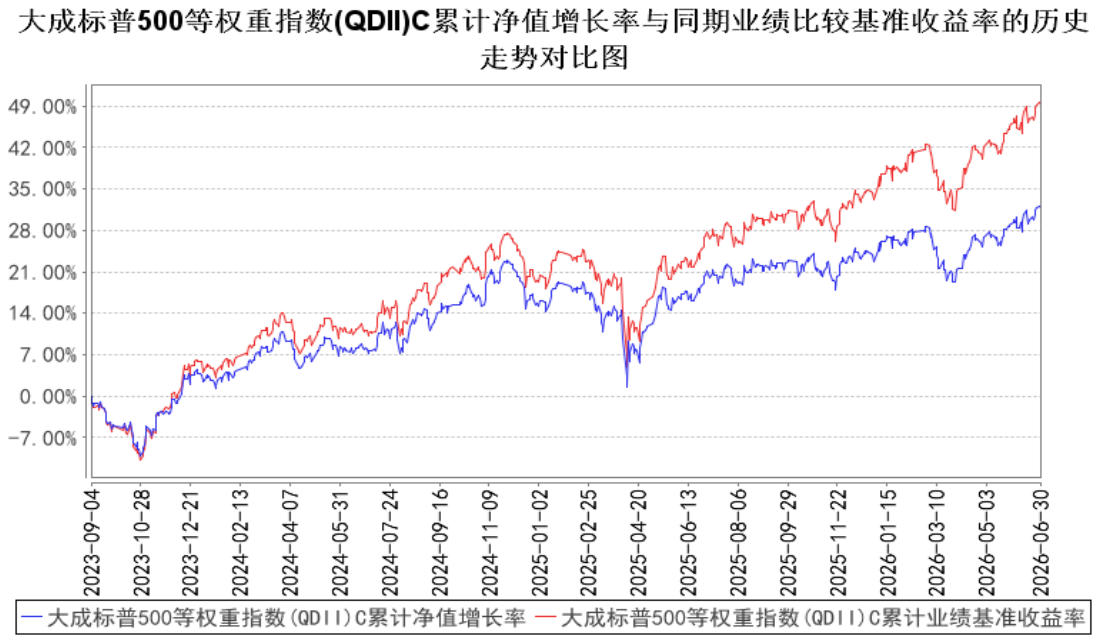
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	8.77%	0.66%	11.39%	0.71%	-2.62%	-0.05%
过去六个月	7.63%	0.74%	12.13%	0.80%	-4.50%	-0.06%
过去一年	11.03%	0.70%	19.20%	0.75%	-8.17%	-0.05%
过去三年	32.16%	0.82%	50.22%	0.88%	-18.06%	-0.06%
过去五年	47.72%	0.96%	54.87%	1.02%	-7.15%	-0.06%
过去七年	86.28%	1.24%	125.82%	1.30%	-39.54%	-0.06%
过去十年	154.89%	1.11%	220.77%	1.17%	-65.88%	-0.06%
自基金合同生效起至今	296.14%	1.08%	483.43%	1.13%	-187.29%	-0.05%

大成标普 500 等权重指数(QDII)C 人民币

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	8.69%	0.66%	11.39%	0.71%	-2.70%	-0.05%
过去六个月	7.47%	0.74%	12.13%	0.80%	-4.66%	-0.06%
过去一年	10.69%	0.70%	19.20%	0.75%	-8.51%	-0.05%
自基金合同生效起至今	31.88%	0.84%	49.37%	0.90%	-17.49%	-0.06%

2.2.2 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





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。

§3 管理人报告

3.1 基金管理人及基金经理情况

3.1.1 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。

3.1.2 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	-	23 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。

3.1.3 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。

3.2 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《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》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。

3.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

3.3.1 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。

3.3.2 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。

3.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

3.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026年上半年，美国宏观经济稳定增长，美股虽然出现过调整，但主要美股指数在二季度再次创出历史新高。主要有以下几方面：

从宏观经济来看，美国宏观经济保持着相对稳定但并不算强劲的增长趋势。这体现在制造业PMI维持在景气区间、就业数据较好等方面，但通胀数据受高油价的影响有所走高。

从国际局势来看，中东地缘政治局势逐步缓和，虽然过程起起伏伏，但从趋势来看总体是趋于缓解。

从货币政策来看，凯文·沃什已经正式就任新任美联储主席，虽然他被普遍认为是相对“鹰派”人士，但美联储目前还尚未加息，只是市场上存在一定的加息预期。在沃什获美联储主席提名时，曾经导致了全球流动性预期的收紧，同时也直接冲击了各类风险资产。

上半年美股最重要的影响因素还是 AI 发展趋势。近几个月来，市场对美国科技龙头 AI 资本开支的态度出现较大分歧，此前“AI 资本开支越大则获益越多”的线性叙事被质疑。市场开始担忧 AI 资本开支的超预期上行会影响公司的现金流和投资回报，并引发了 AI 泡沫的讨论。此外，市场还担心某些新 AI 公司会颠覆原有科技大厂的盈利模式，传统的互联网平台经济公司容易受到这种担心的冲击。但随着 AI 智能体的广泛应用，AI 应用端公司迎来了盈利曙光。同时，由于 AI 产业投资的持续加大，带动了全球半导体产业的繁荣，从而进一步推动了美股的上涨。

3.4.2 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 2.7863 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.63%，同期业绩比较基准收益率为 12.13%；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 2.7720 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.47%，同期业绩比较基准收益率为 12.13%。

3.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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 2026 年美股上市公司盈利仍然可能有较好的增长，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。

3.6 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的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。

3.7 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 20,806,590.50 元，每十份基金份额分红 0.9240 元；大成标普 500 等权重指数(QDII)C 已分配利润 4,412,718.26 元，每十份基金份额分红 0.9080 元；符合基金合同规定的分红比例。

3.8 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。

§4 托管人报告

4.1 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，完全尽职尽责的履行了应尽的义务。

4.2 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的复核，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。

4.3 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）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

§5 半年度财务会计报告（未经审计）

5.1 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：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	63,094,141.44	46,080,762.49
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	883,377,895.13	699,137,600.86
其中：股票投资		883,377,895.13	699,137,600.86
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	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		850,347.05	725,547.95
应收申购款		2,976,608.57	683,910.08
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		950,298,992.19	746,627,821.38
负债和净资产	**附注号**	**本期末**	**上年度末**

		2026 年 6 月 30 日	2025 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		9,203,380.75	3,794,002.53
应付管理人报酬		766,643.63	689,667.89
应付托管费		153,328.74	137,933.56
应付销售服务费		51,993.52	34,952.54
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	102,501.48	184,140.65
负债合计		10,277,848.12	4,840,697.17
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	337,764,012.88	277,168,093.70
未分配利润	6.4.7.12	602,257,131.19	464,619,030.51
净资产合计		940,021,144.07	741,787,124.21
负债和净资产总计		950,298,992.19	746,627,821.38

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日,基金份额总额 337,764,012.88 份。其中大成标普 500 等权重指数(QDII)A 类基金份额总额为 262,138,981.62 份，基金份额净值 2.7863 元；大成标普 500 等权重指数(QDII)C 类基金份额总额为 75,625,031.26 份，基金份额净值 2.7720 元。

5.2 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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		68,282,675.96	26,955,722.76
1.利息收入		71,062.36	136,883.86
其中：存款利息收入	6.4.7.13	71,062.36	136,883.86
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-

2.投资收益（损失以“-”填列）		50,843,679.28	20,750,580.90
其中：股票投资收益	6.4.7.14	44,598,950.10	12,542,374.85
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	6,244,729.18	8,208,206.05
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	17,305,305.18	9,807,496.70
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-80,610.29	-4,055,495.84
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	143,239.43	316,257.14
减：二、营业总支出		5,094,524.34	6,538,553.16
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	3,964,873.45	5,026,639.58
2．托管费	6.4.10.2.2	792,974.71	1,081,108.10
3．销售服务费	6.4.10.2.3	240,596.51	280,400.88
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	96,079.67	150,404.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		63,188,151.62	20,417,169.60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		63,188,151.62	20,417,169.60
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		63,188,151.62	20,417,169.60

5.3 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：2026年1月1日至2026年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026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	277,168,093.70	-	464,619,030.51	741,787,124.21
二、本期期初净资产	277,168,093.70	-	464,619,030.51	741,787,124.21
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	60,595,919.18	-	137,638,100.68	198,234,019.86
（一）、综合收益总额	-	-	63,188,151.62	63,188,151.62
（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）	60,595,919.18	-	99,669,257.82	160,265,177.00
其中：1.基金申购款	145,753,699.00	-	241,697,830.37	387,451,529.37
2.基金赎回款	-85,157,779.82	-	-142,028,572.55	-227,186,352.37
（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）	-	-	-25,219,308.76	-25,219,308.76
四、本期期末净资产	337,764,012.88	-	602,257,131.19	940,021,144.07
项目	上年度可比期间 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	-	-	20,417,169.60	20,417,169.60

益总额				
（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

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

5.4 报表附注

5.4.1 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。

5.4.2 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”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的《公开募集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>》、《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。

5.4.3 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 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

5.4.4 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。

5.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

5.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

5.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

5.4.5.3 差错更正的说明

无。

5.4.6 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]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[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》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部　税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，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。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。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。

5.4.7 重要财务报表项目的说明

5.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	63,094,141.44
等于：本金	63,088,678.96
加：应计利息	5,462.48
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	63,094,141.44

5.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		789,020,798.14	-	883,377,895.13	94,357,096.99
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		789,020,798.14	-	883,377,895.13	94,357,096.99

5.4.7.3 衍生金融资产/负债

5.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

5.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

5.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

5.4.7.4 买入返售金融资产

5.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

5.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

5.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

5.4.7.5 债权投资

5.4.7.5.1 债权投资情况

无。

5.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

5.4.7.6 其他债权投资

5.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

5.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

5.4.7.7 其他权益工具投资

5.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

5.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

5.4.7.8 其他资产

无。

5.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	11,990.70
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	3,730.33
预提费用	86,780.45
合计	102,501.48

5.4.7.10 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	227,462,177.16	227,462,177.16
本期申购	87,046,757.48	87,046,757.48
本期赎回（以“-”号填列）	-52,369,953.02	-52,369,953.02
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	262,138,981.62	262,138,981.62

大成标普 500 等权重指数(QDII)C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	49,705,916.54	49,705,916.54
本期申购	58,706,941.52	58,706,941.52
本期赎回（以“-”号填列）	-32,787,826.80	-32,787,826.80
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	75,625,031.26	75,625,031.26

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)。

5.4.7.11 其他综合收益

无。

5.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

大成标普 500 等权重指数(QDII)A 人民币

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	210,134,172.23	171,609,269.86	381,743,442.09
本期期初	210,134,172.23	171,609,269.86	381,743,442.09
本期利润	36,503,718.58	13,540,371.75	50,044,090.33
本期基金份额交易产生的变动数	31,047,958.98	26,217,476.07	57,265,435.05
其中：基金申购款	77,775,804.21	66,902,114.90	144,677,919.11
基金赎回款	-46,727,845.23	-40,684,638.83	-87,412,484.06
本期已分配利润	-20,806,590.50	-	-20,806,590.50
本期末	256,879,259.29	211,367,117.68	468,246,376.97

大成标普 500 等权重指数(QDII)C 人民币

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	45,091,125.99	37,784,462.43	82,875,588.42
本期期初	45,091,125.99	37,784,462.43	82,875,588.42
本期利润	9,379,127.86	3,764,933.43	13,144,061.29
本期基金份额交易产生的变动数	22,560,406.22	19,843,416.55	42,403,822.77
其中：基金申购款	51,476,717.53	45,543,193.73	97,019,911.26
基金赎回款	-28,916,311.31	-25,699,777.18	-54,616,088.49
本期已分配利润	-4,412,718.26	-	-4,412,718.26
本期末	72,617,941.81	61,392,812.41	134,010,754.22

5.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	70,938.03
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	124.33
合计	71,062.36

5.4.7.14 股票投资收益

5.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	44,598,950.10
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	44,598,950.10

5.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	178,917,324.22
减：卖出股票成本总额	134,195,264.43
减：交易费用	123,109.69
买卖股票差价收入	44,598,950.10

5.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

5.4.7.15 基金投资收益

无。

5.4.7.16 债券投资收益

5.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

无。

5.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

5.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

5.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

5.4.7.17 资产支持证券投资收益

5.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

5.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

5.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

5.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

5.4.7.18 贵金属投资收益

5.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

5.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

5.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

5.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

5.4.7.19 衍生工具收益

5.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

5.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

5.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	6,244,729.18
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	6,244,729.18

5.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	17,305,305.18
股票投资	17,305,305.18
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	17,305,305.18

5.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	143,239.43
合计	143,239.43

5.4.7.23 信用减值损失

无。

5.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026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	-
银行划款手续费	9,299.22
合计	96,079.67

5.4.7.25 分部报告

无。

5.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

5.4.8.1 或有事项

无。

5.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

5.4.9 关联方、关联关系

5.4.9.1 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。

5.4.9.2 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。

5.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

5.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

5.4.10.1.1 股票交易

无。

5.4.10.1.2 债券交易

无。

5.4.10.1.3 债券回购交易

无。

5.4.10.1.4 基金交易

无。

5.4.10.1.5 权证交易

无。

5.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

5.4.10.2 关联方报酬

5.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,964,873.45	5,026,639.58
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,802,221.56	1,642,737.41
应支付基金管理人的净管理费	2,162,651.89	3,383,902.17

注：本基金管理费年费率为 1.00%，每日计提，按月支付。其计算公式为：

日管理费＝前一日基金资产净值×管理费年费率/当年天数。

5.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	792,974.71	1,081,108.10

注：（1）本基金托管费年费率为 0.20%，每日计提，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值×托管费年费率/当年天数。

（2）本基金自 2025 年 2 月 28 日起，托管费年费率由 0.25%调整为 0.20%。

5.4.10.2.3 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	-	5,201.71	5,201.71
合计	-	5,201.71	5,201.71
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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

注：C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%。

销售服务费的计算方法如下：

H＝E×该类基金份额销售服务费年费率÷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

5.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

5.4.10.4 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

5.4.10.4.1 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。

5.4.10.4.2 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。

5.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

5.4.10.5.1 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	大成标普 500 等权重指数(QDII)A 人民币	大成标普 500 等权重指数(QDII)C 人民币
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	-	-
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	-	-
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 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 人民币	大成标普 500 等权重指数(QDII)C 人民币
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	-	4,340.28

回/卖出总份额		
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	-	-

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。

5.4.10.5.2 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。

5.4.10.6 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025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	53,905,525.46	70,938.03	60,070,230.67	117,103.30
中银香港	9,188,615.98	-	5,523,030.20	-

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。

5.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

5.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

5.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

大成标普 500 等权重指数(QDII)A 人民币								
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	备注
		场内	场外					
1	2026 年 1 月 16 日	-	2026 年 1 月 15 日	0.9240	9,453,894.68	11,352,695.82	20,806,590.50	-
合计	-	-	-	0.9240	9,453,894.68	11,352,695.82	20,806,590.50	-
大成标普 500 等权重指数(QDII)C 人民币								
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	备注
		场内	场外					

1	2026年1月16日	-	2026年1月15日	0.9080	2,211,616.86	2,201,101.40	4,412,718.26	-
合计	-	-	-	0.9080	2,211,616.86	2,201,101.40	4,412,718.26	-

5.4.12 期末（2026年6月30日）本基金持有的流通受限证券

5.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

5.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

5.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

5.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

5.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

5.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

5.4.13 金融工具风险及管理

5.4.13.1 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的建设，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。

5.4.13.2 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)。

5.4.13.3 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。

5.4.13.3.1 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。

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。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

5.4.13.4 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。

5.4.13.4.1 利率风险

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

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

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。

5.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 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	53,905,525.46	-	-	9,188,615.98	63,094,141.44
交易性金融资产	-	-	-	883,377,895.13	883,377,895.13
应收股利	-	-	-	850,347.05	850,347.05
应收申购款	187,248.05	-	-	2,789,360.52	2,976,608.57
资产总计	54,092,773.51	-	-	896,206,218.68	950,298,992.19
负债					
应付赎回款	-	-	-	9,203,380.75	9,203,380.75
应付管理人报酬	-	-	-	766,643.63	766,643.63
应付托管费	-	-	-	153,328.74	153,328.74
应付销售服务费	-	-	-	51,993.52	51,993.52

其他负债	-	-	-	102,501.48	102,501.48
负债总计	-	-	-	10,277,848.12	10,277,848.12
利率敏感度缺口	54,092,773.51	-	-	885,928,370.56	940,021,144.07
上年度末 2025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	36,151,508.49	-	-	9,929,254.00	46,080,762.49
交易性金融资产	-	-	-	699,137,600.86	699,137,600.86
应收股利	-	-	-	725,547.95	725,547.95
应收申购款	21,189.31	-	-	662,720.77	683,910.08
资产总计	36,172,697.80	-	-	710,455,123.58	746,627,821.38
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,794,002.53	3,794,002.53
应付管理人报酬	-	-	-	689,667.89	689,667.89
应付托管费	-	-	-	137,933.56	137,933.56
应付销售服务费	-	-	-	34,952.54	34,952.54
其他负债	-	-	-	184,140.65	184,140.65
负债总计	-	-	-	4,840,697.17	4,840,697.17
利率敏感度缺口	36,172,697.80	-	-	705,614,426.41	741,787,124.21

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。

5.4.13.4.1.2 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)。

5.4.13.4.2 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。

5.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026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	9,190,201	-	-	9,190,201.83

	.83			
交易性金融资产	883,377,895.13	-	-	883,377,895.13
应收股利	850,347.05	-	-	850,347.05
资产合计	893,418,444.01	-	-	893,418,444.01
以外币计价的负债				
其他负债	3,730.33	-	-	3,730.33
负债合计	3,730.33	-	-	3,730.33
资产负债表外汇风险敞口净额	893,414,713.68	-	-	893,414,713.68
项目	上年度末 2025 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	9,930,841.31	-	-	9,930,841.31
交易性金融资产	699,137,600.86	-	-	699,137,600.86
应收股利	725,547.95	-	-	725,547.95
资产合计	709,793,990.12	-	-	709,793,990.12
以外币计价的负债				
其他负债	3,849.67	-	-	3,849.67
负债合计	3,849.67	-	-	3,849.67
资产负债表外汇风险敞口净	709,790,140.45	-	-	709,790,140.45

额				

5.4.13.4.2.2 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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末 （2025 年 12 月 31 日 ）
	所有外币相对人民币升值 5%	44,670,735.70	35,489,507.00
	所有外币相对人民币贬值 5%	-44,670,735.70	-35,489,507.00

5.4.13.4.3 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。

5.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025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	883,377,895.13	93.97	699,137,600.86	94.25
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	883,377,895.13	93.97	699,137,600.86	94.25

5.4.13.4.3.2 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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	45,399,813.10	34,688,709.65
	业绩比较基准下降 5%	-45,399,813.10	-34,688,709.65

5.4.14 公允价值

5.4.14.1 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。

5.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

5.4.14.2.1 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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日

第一层次	883,377,895.13	699,137,600.86
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	883,377,895.13	699,137,600.86

5.4.14.2.2 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。

5.4.14.3 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)。

5.4.14.4 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。

5.4.15 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。

§6 投资组合报告

6.1 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	883,377,895.13	92.96
	其中：普通股	883,377,895.13	92.96
	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	63,094,141.44	6.64
8	其他各项资产	3,826,955.62	0.40
9	合计	950,298,992.19	100.00

6.2 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	883,377,895.13	93.97
合计	883,377,895.13	93.97

6.3 期末按行业分类的权益投资组合

6.3.1 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	44,573,720.09	4.74
非必需消费品	82,857,973.41	8.81
必需消费品	57,452,645.57	6.11
能源	35,630,849.99	3.79
金融	139,951,918.45	14.89
房地产	52,222,845.99	5.56
医疗保健	104,151,314.76	11.08
工业	140,080,610.19	14.90
材料	48,135,259.78	5.12
科技	121,422,995.36	12.92
公用事业	55,163,092.60	5.87
政府	-	-
合计	881,643,226.19	93.79

注：以上分类采用彭博行业分类标准。

6.3.2 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	1,734,668.94	0.18

能源	-	-
金融	-	-
房地产	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
材料	-	-
科技	-	-
公用事业	-	-
政府	-	-
合计	1,734,668.94	0.18

注：以上分类采用彭博行业分类标准。

6.4 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

6.4.1 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	Moderna Inc	莫德纳公司	MRNA US	纳斯达克证券交易所	美国	5,488	2,617,596.69	0.28
2	Corning Inc	康宁公司	GLW US	美国纽约证券交易所	美国	1,501	2,611,301.99	0.28
3	Applied Materials Inc	应用材料公司	AMAT US	纳斯达克证券交易所	美国	507	2,496,610.31	0.27
4	KLA Corp	科磊公司	KLAC US	纳斯达克证券交易所	美国	1,181	2,426,856.55	0.26
5	Teradyne Inc	泰瑞达	TER US	纳斯达克证券交易所	美国	726	2,392,450.13	0.25
6	Sandisk Corp	闪迪公司/特拉华州	SNDK US	纳斯达克证券交易所	美国	153	2,369,380.59	0.25
7	Lam Research Corp	泛林集团	LRCX US	纳斯达克证券交易所	美国	784	2,313,871.96	0.25
8	Bio-	Bio-	TECH	纳斯达	美国	4,808	2,313,561.93	0.25

	Techne Corp	techne公司	US	克证券交易所				
9	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	287	2,296,532.09	0.24
10	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	2,455	2,273,856.08	0.24
11	Intel Corp	英特尔公司	INTC US	纳斯达克证券交易所	美国	2,358	2,242,472.07	0.24
12	Western Digital Corp	西部数据公司	WDC US	纳斯达克证券交易所	美国	515	2,240,382.89	0.24
13	Palo Alto Networks Inc	派拓网络公司	PANW US	纳斯达克证券交易所	美国	958	2,225,101.69	0.24
14	Micron 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	283	2,224,876.31	0.24
15	Advanced Micro Devices Inc	AMD公司	AMD US	纳斯达克证券交易所	美国	557	2,203,781.59	0.23
16	Axon Enterprise Inc	Axon Enterprise股份有限公司	AXON US	纳斯达克证券交易所	美国	563	2,149,679.62	0.23

17	Southwest Airlines Co	西南航空	LUV US	美国纽约证券交易所	美国	6,097	2,135,269.87	0.23
18	Caterpillar Inc	卡特彼勒公司	CAT US	美国纽约证券交易所	美国	294	2,132,360.66	0.23
19	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	1,376	2,125,430.16	0.23
20	Stanley Black & Decker Inc	史丹利百得公司	SWK US	美国纽约证券交易所	美国	3,309	2,121,207.67	0.23
21	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	3,300	2,105,099.35	0.22
22	Generac Holdings Inc	Generac 控股公司	GNRC US	美国纽约证券交易所	美国	1,055	2,103,986.11	0.22
23	DoorDash Inc	DoorDash 股份有限公司	DASH US	纳斯达克证券交易所	美国	1,671	2,100,138.49	0.22
24	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	2,092	2,081,121.71	0.22
25	Amphenol Corp	安费诺公司	APH US	美国纽约证券交易所	美国	1,728	2,075,151.55	0.22
26	Verti	维谛技	VRT US	美国纽	美国	909	2,072,906.81	0.22

	v Holdings Co	术控股公司		约证券交易所				
27	Builders FirstSource Inc	Builders FirstSource 股份有限公司	BLDR US	美国纽约证券交易所	美国	3,382	2,061,123.82	0.22
28	Genuine Parts Co	原配部件	GPC US	美国纽约证券交易所	美国	2,564	2,060,302.15	0.22
29	International Paper Co	国际纸业	IP US	美国纽约证券交易所	美国	7,925	2,056,500.17	0.22
30	Zebra Technologies Corp	斑马技术公司	ZBRA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,142	2,047,648.86	0.22
31	Smurfit Westrock PLC	斯墨菲特·韦斯特罗克集团	SW US	美国纽约证券交易所	美国	6,480	2,041,668.08	0.22
32	Seagate Technology Holdings PLC	Seagate Technology 控股公共有限公司	STX US	纳斯达克证券交易所	美国	309	2,030,908.22	0.22
33	Royal Caribbean Cruises Ltd	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	939	2,030,742.51	0.22
34	Marvell Techn	美满电子科技公司	MRVL US	纳斯达克证券交易所	美国	999	2,026,870.10	0.22

	ology Inc							
35	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	14,086	2,025,258.30	0.22
36	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	389	2,021,893.72	0.22
37	General Electric Co	通用电气公司	GE US	美国纽约证券交易所	美国	792	2,015,986.62	0.21
38	Qnity Electronics Inc	启诺迪电子股份有限公司	Q US	美国纽约证券交易所	美国	1,806	2,008,792.27	0.21
39	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	1,152	2,007,674.60	0.21
40	Dell Technologies Inc	戴尔科技公司	DELL US	美国纽约证券交易所	美国	682	2,004,146.28	0.21
41	Texas Pacific Land Corp	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	672	2,003,045.37	0.21
42	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	3,581	1,999,722.40	0.21
43	Flex Ltd	伟创力国际有	FLEX US	纳斯达克证券	美国	1,809	1,996,851.20	0.21

		限公司		交易所				
44	Global Payments Inc	环汇有限公司	GPN US	美国纽约证券交易所	美国	4,040	1,996,563.57	0.21
45	Robinhood Markets Inc	罗宾汉市场股份公司	HOOD US	纳斯达克证券交易所	美国	2,922	1,995,717.39	0.21
46	Eaton Corp PLC	伊顿公共有限公司	ETN US	美国纽约证券交易所	美国	686	1,990,950.85	0.21
47	Pulte Group Inc	Pulte集团公司	PHM US	美国纽约证券交易所	美国	2,130	1,990,535.24	0.21
48	Williams-Sonoma Inc	Williams-Sonoma股份有限公司	WSM US	美国纽约证券交易所	美国	1,252	1,987,701.23	0.21
49	Masco Corp	马斯可	MAS US	美国纽约证券交易所	美国	3,561	1,973,516.64	0.21
50	Comfort Systems USA Inc	美国舒适系统公司	FIX US	美国纽约证券交易所	美国	146	1,970,834.04	0.21
51	Vistra Corp	Vistra公司	VST US	美国纽约证券交易所	美国	1,822	1,968,512.61	0.21
52	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	1,156	1,968,192.63	0.21
53	Datadog Inc	数据狗	DDOG US	纳斯达克证券交易所	美国	1,108	1,964,800.80	0.21

54	Ball Corp	波尔	BALL US	美国纽约证券交易所	美国	4,613	1,960,525.74	0.21
55	Vertex Pharmaceuticals Inc	福泰制药公司	VRTX US	纳斯达克证券交易所	美国	579	1,958,860.27	0.21
56	Corteva Inc	科迪华公司	CTVA US	美国纽约证券交易所	美国	3,390	1,955,403.26	0.21
57	Block Inc	Block股份有限公司	XYZ US	美国纽约证券交易所	美国	3,776	1,954,564.84	0.21
58	Amcor PLC	安姆科公共有限公司	AMCR US	美国纽约证券交易所	美国	6,613	1,952,504.88	0.21
59	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	500	1,951,152.58	0.21
60	Sherwin-Williams Co/The	宣伟公司	SHW US	美国纽约证券交易所	美国	830	1,946,457.14	0.21
61	Deere & Co	迪尔	DE US	美国纽约证券交易所	美国	450	1,944,161.19	0.21
62	Cummins Inc	康明斯	CMI US	美国纽约证券交易所	美国	400	1,943,040.80	0.21
63	Capital One Financial Corp	第一资本金融	COF US	美国纽约证券交易所	美国	1,421	1,941,658.32	0.21
64	Synchrony Finan	同步金融公司	SYF US	美国纽约证券交易所	美国	3,742	1,938,239.79	0.21

	cial							
65	Ciena Corp	Ciena公司	CIEN US	美国纽约证券交易所	美国	580	1,937,869.96	0.21
66	Rockwell Automation Inc	罗克韦尔自动化	ROK US	美国纽约证券交易所	美国	573	1,932,121.83	0.21
67	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	222	1,931,620.41	0.21
68	DaVita Inc	DaVita股份有限公司	DVA US	美国纽约证券交易所	美国	1,271	1,925,932.36	0.20
69	ARISTA NETWORKS INC	Arista网络股份有限公司	ANET US	美国纽约证券交易所	美国	1,663	1,924,150.36	0.20
70	AbbVie Inc	艾伯维股份有限公司	ABBV US	美国纽约证券交易所	美国	1,122	1,922,990.05	0.20
71	Chipotle Mexican Grill Inc	Chipotle Mexican Grill股份有限公司	CMG US	美国纽约证券交易所	美国	8,297	1,921,341.27	0.20
72	Hubbell Inc	哈贝尔公司	HUBB US	美国纽约证券交易所	美国	539	1,920,706.49	0.20
73	Parker-Hannifin Corp	派克汉尼汾公司	PH US	美国纽约证券交易所	美国	288	1,918,620.72	0.20
74	Coherent	相干公司	COHR US	美国纽约证券	美国	711	1,910,240.66	0.20

	Corp			交易所				
75	Booking Holdings Inc	缤客控股公司	BKNG US	纳斯达克证券交易所	美国	1,571	1,907,154.44	0.20
76	Airbnb Inc	爱彼迎股份有限公司	ABNB US	纳斯达克证券交易所	美国	1,955	1,905,420.79	0.20
77	Teledyne Technologies Inc	Teledyne科技股份有限公司	TDY US	美国纽约证券交易所	美国	419	1,903,177.28	0.20
78	Fortinet Inc	飞塔信息	FTNT US	纳斯达克证券交易所	美国	1,817	1,901,109.76	0.20
79	Home Depot Inc/The	家得宝	HD US	美国纽约证券交易所	美国	791	1,900,035.96	0.20
80	Quanta Services Inc	Quanta服务股份有限公司	PWR US	美国纽约证券交易所	美国	387	1,897,894.61	0.20
81	DR Horton Inc	霍顿房屋公司	DHI US	美国纽约证券交易所	美国	1,710	1,897,004.56	0.20
82	Xylem Inc/NY	赛莱默公司	XYL US	美国纽约证券交易所	美国	2,356	1,896,854.45	0.20
83	Tesla Inc	特斯拉公司	TSLA US	纳斯达克证券交易所	美国	661	1,893,543.26	0.20
84	Packaging Corp of America	美国包装公司	PKG US	美国纽约证券交易所	美国	1,165	1,890,679.96	0.20
85	JPMorgan Chase	摩根大通	JPM US	美国纽约证券交易所	美国	848	1,890,541.29	0.20

	& Co							
86	Globe Life Inc	Globe Life 股份有限公司	GL US	美国纽约证券交易所	美国	1,553	1,889,956.91	0.20
87	Carnival Corp Ltd	嘉年华公司	CCL US	美国纽约证券交易所	美国	9,712	1,889,832.96	0.20
88	Revvity Inc	Revvity 股份有限公司	RVTY US	美国纽约证券交易所	美国	2,492	1,888,389.59	0.20
89	Cardinal Health Inc	嘉德诺健康集团	CAH US	美国纽约证券交易所	美国	1,167	1,888,202.97	0.20
90	TransDigm Group Inc	TransDigm 集团公司	TDG US	美国纽约证券交易所	美国	208	1,887,057.38	0.20
91	Trane Technologies PLC	特灵科技公共有限公司	TT US	美国纽约证券交易所	美国	564	1,886,716.29	0.20
92	Biogen Inc	渤健公司	BIIB US	纳斯达克证券交易所	美国	1,281	1,885,072.27	0.20
93	Dollar Tree Inc	美元树公司	DLTR US	纳斯达克证券交易所	美国	2,288	1,884,804.88	0.20
94	A O Smith Corp	AO 史密斯公司	AOS US	美国纽约证券交易所	美国	4,411	1,884,289.43	0.20
95	Jabil Inc	捷普集团	JBL US	美国纽约证券交易所	美国	716	1,879,833.46	0.20
96	Cincinnati Financial Corp	辛辛那提金融	CINF US	纳斯达克证券交易所	美国	1,488	1,876,323.40	0.20

97	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	1,138	1,875,229.57	0.20
98	CDW Corp/DE	特拉华 CDW 公司	CDW US	纳斯达克证券交易所	美国	1,955	1,872,665.13	0.20
99	Humana Inc	Humana 股份有限公司	HUM US	美国纽约证券交易所	美国	692	1,872,154.58	0.20
100	IQVIA Holdings Inc	艾昆纬	IQV US	美国纽约证券交易所	美国	1,422	1,871,354.98	0.20
101	Baxter International Inc	百特	BAX US	美国纽约证券交易所	美国	12,885	1,871,010.08	0.20
102	Allegion plc	安朗杰公共有限公司	ALLE US	美国纽约证券交易所	美国	1,951	1,866,840.38	0.20
103	Ecolab Inc	艺康集团	ECL US	美国纽约证券交易所	美国	982	1,863,428.32	0.20
104	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	762	1,863,176.18	0.20
105	Illinois Tool Works Inc	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	1,009	1,858,723.42	0.20
106	Keysight Technologies Inc	是德科技公司	KEYS US	美国纽约证券交易所	美国	779	1,857,363.28	0.20
107	NVR	NVR 股	NVR US	美国纽	美国	40	1,856,215.44	0.20

	Inc	份有限公司		约证券交易所				
108	Jack Henry & Associates Inc	Jack Henry & Associates 公司	JKHY US	纳斯达克证券交易所	美国	1,978	1,855,627.80	0.20
109	Carrier Global Corp	开利全球公司	CARR US	美国纽约证券交易所	美国	3,713	1,854,938.74	0.20
110	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	3,885	1,854,076.48	0.20
111	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	1,011	1,851,321.54	0.20
112	Incyte Corp	因赛特公司	INCY US	纳斯达克证券交易所	美国	2,395	1,849,140.28	0.20
113	Everest Group Ltd	Everest 集团有限公司	EG US	美国纽约证券交易所	美国	759	1,846,690.88	0.20
114	Pentair PLC	Pentair 公共有限公司	PNR US	美国纽约证券交易所	美国	3,535	1,845,706.90	0.20
115	PPG Industries Inc	PPG 工业	PPG US	美国纽约证券交易所	美国	2,234	1,845,494.13	0.20
116	Veralto Corp	Veralto 公司	VLTO US	美国纽约证券交易所	美国	3,055	1,845,191.32	0.20
117	Visa Inc	维萨公司	V US	美国纽约证券交易所	美国	789	1,843,697.08	0.20

118	Amgen Inc	安进公司	AMGN US	纳斯达克证券交易所	美国	747	1,842,373.24	0.20
119	Fifth Third Bancorp	五三银行	FITB US	纳斯达克证券交易所	美国	4,794	1,840,562.50	0.20
120	CRH PLC	CRH公共股份公司	CRH US	美国纽约证券交易所	美国	2,524	1,839,406.14	0.20
121	Vulcan Materials Co	Vulcan材料	VMC US	美国纽约证券交易所	美国	915	1,838,494.50	0.20
122	Entergy Corp	Entergy公司	ETR US	美国纽约证券交易所	美国	2,350	1,838,404.94	0.20
123	Mosaic Co/The	Mosaic公司	MOS US	美国纽约证券交易所	美国	12,735	1,837,953.04	0.20
124	Merck & Co Inc	默克	MRK US	美国纽约证券交易所	美国	2,100	1,837,921.37	0.20
125	RTX Corp	RTX公司	RTX US	美国纽约证券交易所	美国	1,422	1,837,553.99	0.20
126	Franklin Resources Inc	富兰克林资源	BEN US	美国纽约证券交易所	美国	8,106	1,836,808.60	0.20
127	Welltower Inc	沃尔塔公司	WELL US	美国纽约证券交易所	美国	1,188	1,836,493.53	0.20
128	United Rentals Inc	联合租赁公司	URI US	美国纽约证券交易所	美国	238	1,836,408.12	0.20
129	American Express Co	美国运通	AXP US	美国纽约证券交易所	美国	797	1,836,118.18	0.20

130	T Rowe Price Group Inc	普徕仕	TROW US	纳斯达克证券交易所	美国	2,371	1,835,939.32	0.20
131	Live Nation Entertainment Inc	Live Nation娱乐公司	LYV US	美国纽约证券交易所	美国	1,471	1,834,548.68	0.20
132	International Flavors & Fragrances Inc	国际香料	IFF US	美国纽约证券交易所	美国	3,400	1,834,502.29	0.20
133	Travelers Cos Inc/The	旅行家集团	TRV US	美国纽约证券交易所	美国	815	1,832,457.66	0.19
134	Brown & Brown Inc	Brown & Brown股份有限公司	BRO US	美国纽约证券交易所	美国	4,194	1,832,439.27	0.19
135	Ralph Lauren Corp	拉夫劳伦	RL US	美国纽约证券交易所	美国	670	1,831,755.46	0.19
136	EMCOR Group Inc	埃姆科集团公司	EME US	美国纽约证券交易所	美国	324	1,831,322.42	0.19
137	Allstate Corp/The	好事达保险公司	ALL US	美国纽约证券交易所	美国	1,130	1,831,261.67	0.19
138	Nordson Corp	诺信公司	NDSN US	纳斯达克证券交易所	美国	891	1,830,809.36	0.19
139	Johns	强生	JNJ US	美国纽	美国	1,058	1,830,090.60	0.19

	on & Johnson			约证券交易所				
140	Veeva Systems Inc	Veeva Systems股份有限公司	VEEV US	美国纽约证券交易所	美国	1,514	1,830,017.86	0.19
141	American Electric Power Co Inc	美国电力公司	AEP US	纳斯达克证券交易所	美国	1,963	1,829,121.89	0.19
142	Sysco Corp	Sysco公司	SYY US	美国纽约证券交易所	美国	3,213	1,829,016.39	0.19
143	US Bancorp	美国合众银行	USB US	美国纽约证券交易所	美国	4,443	1,827,754.05	0.19
144	F5 Inc	F5股份有限公司	FFIV US	纳斯达克证券交易所	美国	645	1,827,324.97	0.19
145	Arch Capital Group Ltd	阿契资本集团	ACGL US	纳斯达克证券交易所	美国	2,764	1,827,186.30	0.19
146	M&T Bank Corp	M&T 银行	MTB US	美国纽约证券交易所	美国	1,127	1,826,937.22	0.19
147	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	3,923	1,824,651.48	0.19
148	PayPal Holdings Inc	贝宝	PYPL US	纳斯达克证券交易所	美国	6,202	1,823,975.09	0.19
149	Kimberly-Clark	金佰利	KMB US	美国纽约证券交易所	美国	2,439	1,823,475.65	0.19

	Corp							
150	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	西屋制动公司	WAB US	美国纽约证券交易所	美国	992	1,821,528.89	0.19
151	Cooper Cos Inc/The	库柏股份有限公司	COO US	纳斯达克证券交易所	美国	3,729	1,821,279.54	0.19
152	Henry Schein Inc	亨利香恩公司	HSIC US	纳斯达克证券交易所	美国	3,201	1,820,877.22	0.19
153	PNC Financial Services Group Inc/The	PNC财务服务	PNC US	美国纽约证券交易所	美国	1,085	1,819,523.08	0.19
154	Yum! Brands Inc	百胜餐饮集团	YUM US	美国纽约证券交易所	美国	1,670	1,818,280.09	0.19
155	IDEX Corp	艺达思集团	IEX US	美国纽约证券交易所	美国	1,176	1,817,782.90	0.19
156	GoDaddy Inc	GoDaddy股份有限公司	GDDY US	美国纽约证券交易所	美国	3,144	1,817,575.30	0.19
157	Texas Instruments Inc	德州仪器公司	TXN US	纳斯达克证券交易所	美国	895	1,816,961.84	0.19
158	Regions Financial Corp	Regions金融公司	RF US	美国纽约证券交易所	美国	8,832	1,816,646.84	0.19
159	CVS	CVS健	CVS US	美国纽	美国	2,575	1,814,313.08	0.19

	Health Corp	康公司		约证券交易所				
160	Eli Lilly & Co	礼来	LLY US	美国纽约证券交易所	美国	222	1,813,561.91	0.19
161	Monster Beverage Corp	怪兽饮料公司	MNST US	纳斯达克证券交易所	美国	2,767	1,811,454.48	0.19
162	PACCAR Inc	帕卡公司	PCAR US	纳斯达克证券交易所	美国	2,214	1,811,329.43	0.19
163	Huntington Bancshares Inc/OH	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	14,989	1,810,030.53	0.19
164	Ventas Inc	Ventas公司	VTR US	美国纽约证券交易所	美国	2,992	1,809,585.30	0.19
165	Snap-on Inc	实耐宝	SNA US	美国纽约证券交易所	美国	660	1,808,866.07	0.19
166	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	2,935	1,808,294.63	0.19
167	Uber Technologies Inc	优步技术股份有限公司	UBER US	美国纽约证券交易所	美国	3,679	1,808,134.85	0.19
168	Simon Property Group Inc	西蒙房地产集团公司	SPG US	美国纽约证券交易所	美国	1,186	1,806,583.73	0.19
169	eBay Inc	eBay股份有限公司	EBAY US	纳斯达克证券交易所	美国	2,372	1,805,372.07	0.19

170	Mastercard Inc	万事达股份有限公司	MA US	美国纽约证券交易所	美国	516	1,805,008.37	0.19
171	Citigroup Inc	花旗集团	C US	美国纽约证券交易所	美国	1,892	1,803,555.74	0.19
172	Fortive Corp	福迪威公司	FTV US	美国纽约证券交易所	美国	4,334	1,803,281.54	0.19
173	Progressive Corp/The	前进保险公司	PGR US	美国纽约证券交易所	美国	1,212	1,803,263.42	0.19
174	KeyCorp	KeyCorp公司	KEY US	美国纽约证券交易所	美国	11,484	1,802,887.46	0.19
175	State Street Corp	道富集团	STT US	美国纽约证券交易所	美国	1,560	1,802,000.68	0.19
176	Loews Corp	罗斯公司	L US	美国纽约证券交易所	美国	2,336	1,801,200.81	0.19
177	Kenvue Inc	科赴股份有限公司	KVUE US	美国纽约证券交易所	美国	13,828	1,799,801.30	0.19
178	Dollar General Corp	达乐公司	DG US	美国纽约证券交易所	美国	2,295	1,799,286.19	0.19
179	Johnson Controls International plc	江森自控国际有限公司	JCI US	美国纽约证券交易所	美国	1,808	1,799,214.20	0.19
180	Union Pacific Corp	联合太平洋	UNP US	美国纽约证券交易所	美国	971	1,798,840.42	0.19
181	North	北美信	NTRS	纳斯达	美国	1,519	1,798,506.41	0.19

	ern Trust Corp	托	US	克证券交易所				
182	Healthpeak Properties Inc	-	DOC US	美国纽约证券交易所	美国	12,331	1,797,283.45	0.19
183	Bank of America Corp	美国银行公司	BAC US	美国纽约证券交易所	美国	4,628	1,796,057.76	0.19
184	Eversource Energy	Eversource能源公司	ES US	美国纽约证券交易所	美国	3,648	1,795,632.21	0.19
185	HCA Healthcare Inc	HCA医疗保健有限公司	HCA US	美国纽约证券交易所	美国	676	1,795,119.22	0.19
186	Emerson Electric Co	艾默生电气	EMR US	美国纽约证券交易所	美国	1,841	1,794,938.80	0.19
187	Fastenal Co	法思诺公司	FAST US	纳斯达克证券交易所	美国	5,483	1,793,640.23	0.19
188	DTE Energy Co	DTE能源公司	DTE US	美国纽约证券交易所	美国	1,728	1,793,278.37	0.19
189	Assurant Inc	安信龙集团	AIZ US	美国纽约证券交易所	美国	980	1,792,352.36	0.19
190	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	456	1,791,097.79	0.19
191	Labcorp Holdi	Labcorp控股股份有	LH US	美国纽约证券交易所	美国	939	1,790,721.83	0.19

	ngs Inc	限公司						
192	Alliant Energy Corp	Alliant 能源公司	LNT US	纳斯达克证券交易所	美国	3,446	1,790,553.87	0.19
193	CMS Energy Corp	CMS 能源	CMS US	美国纽约证券交易所	美国	3,436	1,790,272.31	0.19
194	International Business Machines Corp	国际商业机器公司	IBM US	美国纽约证券交易所	美国	934	1,788,883.84	0.19
195	American Water Works Co 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	1,996	1,788,771.73	0.19
196	Linde PLC	林德公司	LIN US	纳斯达克证券交易所	美国	506	1,788,430.91	0.19
197	Avery Dennison Corp	艾利丹尼森	AVY US	美国纽约证券交易所	美国	1,617	1,787,997.13	0.19
198	Gilead Sciences Inc	吉利德科学公司	GILD US	纳斯达克证券交易所	美国	2,077	1,787,235.87	0.19
199	Quest Diagnostics Inc	Quest Diagnostics 股份有限公司	DGX US	美国纽约证券交易所	美国	1,238	1,787,139.98	0.19
200	Thermo Fishe	Thermo Fisher Scient	TMO US	美国纽约证券交易所	美国	523	1,785,894.81	0.19

	r Scientific Inc	ific 公司						
201	Tapestry Inc	-	TPR US	美国纽约证券交易所	美国	1,791	1,785,590.36	0.19
202	General Dynamics Corp	通用动力	GD US	美国纽约证券交易所	美国	740	1,785,392.98	0.19
203	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	2,871	1,783,333.36	0.19
204	Danaher Corp	丹纳赫	DHR US	美国纽约证券交易所	美国	1,374	1,782,545.48	0.19
205	Aflac Inc	家庭人寿保险公司	AFL US	美国纽约证券交易所	美国	2,232	1,782,426.15	0.19
206	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	4,540	1,781,696.02	0.19
207	Boeing Co/The	波音	BA US	美国纽约证券交易所	美国	1,207	1,779,547.12	0.19
208	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	419	1,779,437.94	0.19
209	Jacobs Solutions 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	2,073	1,778,993.46	0.19
210	W R Berkl	WR Berkle	WRB US	美国纽约证券	美国	3,703	1,778,820.39	0.19

	ey Corp	y公司		交易所				
211	Bank of New York Mellon Corp/ The	纽约梅隆银行	BNY US	美国纽约证券交易所	美国	1,806	1,778,773.19	0.19
212	Starbucks Corp	星巴克公司	SBUX US	纳斯达克证券交易所	美国	2,555	1,778,295.00	0.19
213	Erie Indemnity Co	伊利赔偿公司	ERIE US	纳斯达克证券交易所	美国	1,088	1,776,609.64	0.19
214	Charles Schwab Corp/ The	嘉信理财	SCHW US	美国纽约证券交易所	美国	2,827	1,776,604.81	0.19
215	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	521	1,775,623.36	0.19
216	Waters Corp	沃特世公司	WAT US	美国纽约证券交易所	美国	695	1,775,280.16	0.19
217	Public Service Enterprise Group Inc	公共服务企业集团	PEG US	美国纽约证券交易所	美国	3,211	1,774,952.96	0.19
218	Equinix Inc	Equinix有限公司	EQIX US	纳斯达克证券交易所	美国	250	1,774,903.51	0.19
219	Keurig Dr Peppe	克里格胡椒博士	KDP US	纳斯达克证券交易所	美国	7,962	1,774,895.07	0.19

	r Inc							
220	3M Co	3M公司	MMM US	美国纽约证券交易所	美国	1,609	1,774,329.29	0.19
221	Charter Communications Inc	特许通讯公司	CHTR US	纳斯达克证券交易所	美国	1,831	1,773,466.48	0.19
222	Evergy Inc	Evergy股份有限公司	EVRG US	纳斯达克证券交易所	美国	3,012	1,773,062.25	0.19
223	United Parcel Service Inc	联合包裹服务股份有限公司	UPS US	美国纽约证券交易所	美国	2,421	1,772,587.81	0.19
224	NextEra Energy Inc	新纪元能源公司	NEE US	美国纽约证券交易所	美国	2,965	1,772,455.33	0.19
225	JB 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	899	1,772,179.63	0.19
226	Dover Corp	都福	DOV US	美国纽约证券交易所	美国	1,160	1,771,956.44	0.19
227	Expand Energy Corp	Expand能源公司	EXE US	纳斯达克证券交易所	美国	2,850	1,770,095.02	0.19
228	WW Grainger Inc	固安捷股份有限公司	GWW US	美国纽约证券交易所	美国	191	1,769,719.74	0.19
229	General	通用磨坊	GIS US	美国纽约证券	美国	7,463	1,768,875.19	0.19

	Mills Inc			交易所				
230	AppLovin Corp	AppLovin公司	APP US	纳斯达克证券交易所	美国	504	1,768,626.72	0.19
231	Williams Cos Inc/The	威廉姆斯公司	WMB US	美国纽约证券交易所	美国	3,493	1,768,583.81	0.19
232	Xcel Energy Inc	Xcel能源股份有限公司	XEL US	纳斯达克证券交易所	美国	3,232	1,767,630.15	0.19
233	Pinnacle West Capital Corp	Pinnacle西部资本	PNW US	美国纽约证券交易所	美国	2,425	1,767,258.28	0.19
234	Consolidated Edison Inc	联合爱迪生	ED US	美国纽约证券交易所	美国	2,345	1,766,933.74	0.19
235	Otis Worldwide Corp	奥的斯电梯公司	OTIS US	美国纽约证券交易所	美国	3,623	1,766,793.77	0.19
236	Tractor Supply Co	拖拉机供应公司	TSCO US	纳斯达克证券交易所	美国	8,203	1,766,044.78	0.19
237	Universal Health Services Inc	Universal保健服务股份有限公司	UHS US	美国纽约证券交易所	美国	1,743	1,765,158.27	0.19
238	Prudential Financial Inc	保德信金融集团	PRU US	美国纽约证券交易所	美国	2,400	1,764,241.05	0.19

239	AutoZone Inc	AutoZone股份有限公司	AZO US	美国纽约证券交易所	美国	81	1,763,145.45	0.19
240	Garmin Ltd	佳明有限公司	GRMN US	美国纽约证券交易所	美国	1,089	1,761,850.83	0.19
241	Hartford Insurance Group Inc/The	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	1,952	1,761,837.07	0.19
242	Constellation Energy Corp	美国联合能源公司	CEG US	纳斯达克证券交易所	美国	1,041	1,760,979.79	0.19
243	CSX Corp	CSX公司	CSX US	纳斯达克证券交易所	美国	5,439	1,760,724.38	0.19
244	Comcast Corp	康卡斯特公司	CMCSA US	纳斯达克证券交易所	美国	10,530	1,760,695.98	0.19
245	Iron Mountain Inc	美国铁山公司	IRM US	美国纽约证券交易所	美国	2,046	1,760,142.66	0.19
246	First Energy Corp	第一能源	FE US	美国纽约证券交易所	美国	5,436	1,760,123.45	0.19
247	Essex Property Trust Inc	埃塞克斯房地产信托公司	ESS US	美国纽约证券交易所	美国	886	1,759,587.43	0.19
248	Becton Dickinson & Co	碧迪	BDX US	美国纽约证券交易所	美国	1,707	1,759,393.80	0.19
249	Exelo	爱克斯	EXC US	纳斯达	美国	5,534	1,757,178.69	0.19

	n Corp	龙公司		克证券交易所				
250	Norfolk Southern Corp	诺福克南方	NSC US	美国纽约证券交易所	美国	820	1,756,965.65	0.19
251	PPL Corp	PPL公司	PPL US	美国纽约证券交易所	美国	7,094	1,756,305.67	0.19
252	Chubb Ltd	邱博保险集团	CB US	美国纽约证券交易所	美国	756	1,754,484.03	0.19
253	Target Corp	塔吉特公司	TGT US	美国纽约证券交易所	美国	1,972	1,754,235.29	0.19
254	Tyson Foods Inc	泰森食品公司	TSN US	美国纽约证券交易所	美国	4,497	1,753,488.34	0.19
255	Air Products and Chemicals Inc	空气产品公司	APD US	美国纽约证券交易所	美国	878	1,753,207.66	0.19
256	Lowe's Cos Inc	劳氏	LOW US	美国纽约证券交易所	美国	1,167	1,752,525.14	0.19
257	UnitedHealth Group Inc	联合健康集团	UNH US	美国纽约证券交易所	美国	619	1,752,274.09	0.19
258	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	5,381	1,752,210.34	0.19
259	Stryker Corp	史赛克公司	SYK US	美国纽约证券交易所	美国	817	1,751,928.85	0.19
260	Interactiv	盈透证券集团	IBKR US	纳斯达克证券	美国	2,955	1,751,785.27	0.19

	e Brokers Group Inc	股份有限公司		交易所				
261	Sempra	-	SRE US	美国纽约证券交易所	美国	2,772	1,750,347.63	0.19
262	O'Reilly Automotive Inc	奥莱利汽车公司	ORLY US	纳斯达克证券交易所	美国	2,790	1,749,932.03	0.19
263	Southern Co/The	南方公司	SO US	美国纽约证券交易所	美国	2,684	1,749,622.41	0.19
264	Atmos Energy Corp	Atmos 能源公司	ATO US	美国纽约证券交易所	美国	1,491	1,749,410.79	0.19
265	Abbott Laboratories	雅培制药公司	ABT US	美国纽约证券交易所	美国	2,830	1,748,999.62	0.19
266	Invitation Homes Inc	邀请家园公司	INVH US	美国纽约证券交易所	美国	8,496	1,748,113.93	0.19
267	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	9,623	1,747,330.81	0.19
268	UDR Inc	UDR 公司	UDR US	美国纽约证券交易所	美国	6,419	1,745,269.15	0.19
269	Broadcom Inc	博通股份有限公司	AVGO US	纳斯达克证券交易所	美国	678	1,744,370.25	0.19
270	McCormick & Co	味好美股份有限公司	MKC US	美国纽约证券交易所	美国	5,079	1,744,156.93	0.19

	Inc/MD	/马里兰州						
271	BXP Inc	波士顿地产公司	BXP US	美国纽约证券交易所	美国	3,854	1,740,585.02	0.19
272	Coca-Cola Co/The	可口可乐	KO US	美国纽约证券交易所	美国	3,144	1,740,272.67	0.19
273	Roper Technologies Inc	儒博技术公司	ROP US	纳斯达克证券交易所	美国	755	1,740,079.04	0.19
274	Duke Energy Corp	杜克能源公司	DUK US	美国纽约证券交易所	美国	2,018	1,739,765.67	0.19
275	Aon PLC	怡安公共有限公司	AON US	美国纽约证券交易所	美国	770	1,739,512.71	0.19
276	Trimble Inc	天宝股份有限公司	TRMB US	纳斯达克证券交易所	美国	4,988	1,738,726.33	0.18
277	Darden Restaurants Inc	达登餐饮公司	DRI US	美国纽约证券交易所	美国	1,239	1,738,457.64	0.18
278	Morgan Stanley	摩根士丹利	MS US	美国纽约证券交易所	美国	1,221	1,738,399.40	0.18
279	STERIS PLC	思泰瑞医疗公共有限公司	STE US	美国纽约证券交易所	美国	1,212	1,738,215.51	0.18
280	Gen Digital Inc	Gen Digital股份有限公司	GEN US	纳斯达克证券交易所	美国	10,252	1,737,952.88	0.18
281	EQT Corp	EQT公司	EQT US	美国纽约证券交易所	美国	4,798	1,737,526.38	0.18

282	AvalonBay Communities Inc	AvalonBay社区股份有限公司	AVB US	美国纽约证券交易所	美国	1,352	1,737,521.07	0.18
283	Analog Devices Inc	亚德诺半导体公司	ADI US	纳斯达克证券交易所	美国	642	1,736,664.67	0.18
284	Insulet Corp	Insulet股份有限公司	PODD US	纳斯达克证券交易所	美国	1,674	1,735,870.24	0.18
285	Goldman Sachs Group Inc/The	高盛	GS US	美国纽约证券交易所	美国	252	1,735,861.66	0.18
286	Valero Energy Corp	Valero能源	VLO US	美国纽约证券交易所	美国	978	1,734,806.52	0.18
287	Agilent Technologies Inc	安捷伦	A US	美国纽约证券交易所	美国	1,917	1,734,294.27	0.18
288	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	613	1,733,869.68	0.18
289	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	1,108	1,732,444.77	0.18
290	Lennar Corp	莱纳公司	LEN US	美国纽约证券交易所	美国	2,809	1,731,238.22	0.18
291	Viatr	晖致	VTRS	纳斯达	美国	16,006	1,731,162.41	0.18

	is Inc		US	克证券交易所				
292	ResMed Inc	瑞思迈股份有限公司	RMD US	美国纽约证券交易所	美国	1,304	1,730,809.88	0.18
293	Newmont Corp	纽蒙黄金公司	NEM US	美国纽约证券交易所	美国	2,720	1,730,295.52	0.18
294	Edison International	爱迪生国际	EIX US	美国纽约证券交易所	美国	3,412	1,730,127.98	0.18
295	PG&E Corp	太平洋煤气电力	PCG US	美国纽约证券交易所	美国	15,097	1,729,502.33	0.18
296	Cencora Inc	Cencora股份有限公司	COR US	美国纽约证券交易所	美国	897	1,728,831.59	0.18
297	Equity Residential	公寓物业权益信托	EQR US	美国纽约证券交易所	美国	3,733	1,727,126.34	0.18
298	Brown-Forman Corp	百富门公司	BF/B US	美国纽约证券交易所	美国	9,514	1,726,890.75	0.18
299	Textron Inc	德事隆	TXT US	美国纽约证券交易所	美国	2,763	1,726,222.54	0.18
300	Kinder Morgan Inc	特拉华州金德摩根公司	KMI US	美国纽约证券交易所	美国	7,927	1,726,060.44	0.18
301	GE HealthCare Technologies Inc	GE医疗技术公司	GEHC US	纳斯达克证券交易所	美国	3,958	1,725,552.28	0.18
302	Hasbr	孩之宝	HAS US	纳斯达	美国	3,067	1,725,225.01	0.18

	o Inc			克证券交易所				
303	DuPont de Nemours Inc	杜邦公司	DD US	美国纽约证券交易所	美国	1,867	1,724,791.50	0.18
304	Best Buy Co Inc	百思买	BBY US	美国纽约证券交易所	美国	3,337	1,724,598.61	0.18
305	Lumentum Holdings Inc	Lumentum控股股份有限公司	LITE US	纳斯达克证券交易所	美国	295	1,724,027.45	0.18
306	Republic Services Inc	公共服务公司	RSG US	美国纽约证券交易所	美国	1,187	1,722,653.42	0.18
307	Super Micro Computer Inc	超微电脑	SMCI US	纳斯达克证券交易所	美国	8,623	1,722,562.36	0.18
308	Truist Financial Corp	Truist金融公司	TFC US	美国纽约证券交易所	美国	5,072	1,721,026.16	0.18
309	Amazon.com Inc	亚马逊公司	AMZN US	纳斯达克证券交易所	美国	1,060	1,720,708.50	0.18
310	Ameren Corp	Ameren公司	AEE US	美国纽约证券交易所	美国	2,232	1,718,426.03	0.18
311	Kimco Realty Corp	-	KIM US	美国纽约证券交易所	美国	9,945	1,717,067.05	0.18
312	Federal Realty	联邦房地产投资信托公司	FRT US	美国纽约证券交易所	美国	2,041	1,715,945.23	0.18

	Investment Trust							
313	NVIDIA Corp	英伟达公司	NVDA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,259	1,715,756.36	0.18
314	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	6,477	1,715,160.07	0.18
315	TE Connectivity PLC	TE Connectivity公共有限公司	TEL US	美国纽约证券交易所	美国	1,249	1,715,058.79	0.18
316	Realty Income Corp	Realty Income公司	O US	美国纽约证券交易所	美国	4,064	1,715,021.67	0.18
317	Marsh & McLennan Cos Inc	Marsh & McLennan股份有限公司	MRSH US	美国纽约证券交易所	美国	1,510	1,714,110.78	0.18
318	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	2,154	1,713,095.14	0.18
319	Weyerhaeuser Co	惠好	WY US	美国纽约证券交易所	美国	10,506	1,713,034.25	0.18
320	General Motors Co	通用汽车公司	GM US	美国纽约证券交易所	美国	3,263	1,713,023.35	0.18
321	AES	爱伊斯	AES US	美国纽	美国	17,152	1,712,589.36	0.18

	Corp/The	公司		约证券交易所				
322	Synopsys Inc	新思科技公司	SNPS US	纳斯达克证券交易所	美国	563	1,710,471.79	0.18
323	American International Group Inc	美国国际集团	AIG US	美国纽约证券交易所	美国	3,368	1,709,651.96	0.18
324	NiSource Inc	NiSource 公司	NI US	美国纽约证券交易所	美国	5,276	1,708,676.36	0.18
325	Mid-America Apartment Communities Inc	-	MAA US	美国纽约证券交易所	美国	1,805	1,708,083.14	0.18
326	Waste Management Inc	废品管理	WM US	美国纽约证券交易所	美国	1,125	1,707,765.07	0.18
327	Hershey Co/The	好时公司	HSY US	美国纽约证券交易所	美国	1,429	1,707,615.57	0.18
328	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	10,099	1,707,200.99	0.18
329	Blackstone Inc	黑石集团股份有限公司	BX US	美国纽约证券交易所	美国	2,130	1,707,064.22	0.18
330	Camden Property Trust	Camden房地产信托公司	CPT US	美国纽约证券交易所	美国	2,189	1,706,938.29	0.18
331	Regen	Regenc	REG US	纳斯达	美国	3,142	1,706,423.86	0.18

	cy Centers Corp	y Centers 公司		克证券交易所				
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	1,724	1,706,111.38	0.18
333	Hewlett Packard Enterprise Co	慧与公司	HPE US	美国纽约证券交易所	美国	5,549	1,704,873.09	0.18
334	Apple Inc	苹果公司	AAPL US	纳斯达克证券交易所	美国	865	1,704,743.75	0.18
335	CenterPoint Energy Inc	中点能源	CNP US	美国纽约证券交易所	美国	5,682	1,704,327.47	0.18
336	Electronic Arts Inc	艺电公司	EA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,220	1,703,738.46	0.18
337	Raymond James Financial Inc	Raymond James 金融股份有限公司	RJF US	美国纽约证券交易所	美国	1,645	1,703,333.55	0.18
338	CF Industries Holdings Inc	CF 工业控股股份有限公司	CF US	美国纽约证券交易所	美国	2,310	1,703,273.96	0.18
339	Wells Fargo & Co	富国集团公司	WFC US	美国纽约证券交易所	美国	3,025	1,702,629.65	0.18
340	Host Hotel	Host 酒店及	HST US	纳斯达克证券	美国	10,539	1,701,905.58	0.18

	s & Resorts Inc	度假股份有限公司		交易所				
341	Willis Towers Watson PLC	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	956	1,701,837.68	0.18
342	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	1,532	1,700,582.02	0.18
343	Colgate-Palmolive Co	高露洁棕榄	CL US	美国纽约证券交易所	美国	2,723	1,700,304.68	0.18
344	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	1,480	1,700,115.06	0.18
345	Cisco Systems Inc	思科公司	CSCO US	纳斯达克证券交易所	美国	2,124	1,699,217.66	0.18
346	Philip Morris International Inc	菲利普莫里斯国际股份有限公司	PM US	美国纽约证券交易所	美国	1,379	1,699,148.53	0.18
347	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	3,966	1,698,786.53	0.18

348	CH Robinson Worldwide 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	1,323	1,697,097.97	0.18
349	Kraft Heinz Co/The	卡夫亨氏公司	KHC US	纳斯达克证券交易所	美国	10,547	1,696,732.36	0.18
350	Principal Financial Group Inc	信安金融	PFG US	纳斯达克证券交易所	美国	2,311	1,696,456.11	0.18
351	Church & Dwight Co Inc	切迟杜威股份有限公司	CHD US	美国纽约证券交易所	美国	2,570	1,695,788.78	0.18
352	Meta Platforms Inc	Meta平台股份有限公司	META US	纳斯达克证券交易所	美国	442	1,695,738.24	0.18
353	Omnicom Group Inc	Omnicom集团股份有限公司	OMC US	美国纽约证券交易所	美国	3,412	1,692,481.13	0.18
354	Altria Group Inc	高特利	MO US	美国纽约证券交易所	美国	3,451	1,691,142.72	0.18
355	Targa Resources Corp	Targa资源公司	TRGP US	美国纽约证券交易所	美国	926	1,691,130.40	0.18
356	Procter & Gamble Co/The	宝洁	PG US	美国纽约证券交易所	美国	1,693	1,690,884.39	0.18
357	Ameriprise	阿默普莱斯金	AMP US	美国纽约证券	美国	541	1,690,391.55	0.18

	Financial Inc	融公司		交易所				
358	NXP Semiconductors NV	恩智浦半导体公司	NXPI US	纳斯达克证券交易所	美国	883	1,690,121.36	0.18
359	CBRE Group Inc	世邦魏理仕	CBRE US	美国纽约证券交易所	美国	1,842	1,689,777.34	0.18
360	Centene Corp	Centene 公司	CNC US	美国纽约证券交易所	美国	3,863	1,688,871.43	0.18
361	Public Storage	公共存储	PSA US	美国纽约证券交易所	美国	779	1,688,854.53	0.18
362	MetLife Inc	大都会集团	MET US	美国纽约证券交易所	美国	2,930	1,688,471.83	0.18
363	Moody's Corp	穆迪	MCO US	美国纽约证券交易所	美国	547	1,687,381.68	0.18
364	ONEOK Inc	Oneok 股份有限公司	OKE US	美国纽约证券交易所	美国	2,846	1,685,229.43	0.18
365	Verisk Analytics Inc	威瑞斯克分析公司	VRSK US	纳斯达克证券交易所	美国	1,378	1,684,964.49	0.18
366	FedEx Corp	联邦快递	FDX US	美国纽约证券交易所	美国	790	1,684,830.72	0.18
367	Carvana Co	Carvana 公司	CVNA US	美国纽约证券交易所	美国	3,753	1,682,445.27	0.18
368	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	1,774	1,680,560.02	0.18
369	Hilto	希尔顿	HLT US	美国纽	美国	746	1,679,044.59	0.18

	n Worldwide Holdings Inc	全球控股股份有限公司		约证券交易所				
370	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	2,862	1,678,134.79	0.18
371	Walt Disney Co/The	华特迪士尼公司	DIS US	美国纽约证券交易所	美国	2,559	1,677,550.21	0.18
372	Blackrock Inc	贝莱德股份有限公司	BLK US	美国纽约证券交易所	美国	256	1,676,566.79	0.18
373	Medtronic PLC	美敦力	MDT US	美国纽约证券交易所	美国	3,145	1,675,708.54	0.18
374	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	1,222	1,675,486.98	0.18
375	Corpay Inc	Corpay股份有限公司	CPAY US	美国纽约证券交易所	美国	738	1,675,163.06	0.18
376	Cadence Design Systems Inc	铿腾电子科技有限公司	CDNS US	纳斯达克证券交易所	美国	655	1,674,354.88	0.18
377	Ford Motor Co	福特汽车	F US	美国纽约证券交易所	美国	17,652	1,671,141.49	0.18
378	Alexandria Real	亚历山大房地产股份	ARE US	美国纽约证券交易所	美国	4,635	1,668,396.36	0.18

	Estate Equities Inc	有限公司						
379	Marathon Petroleum Corp	马拉松石油公司	MPC US	美国纽约证券交易所	美国	958	1,668,206.41	0.18
380	Automatic Data Processing Inc	自动数据处理公司	ADP US	纳斯达克证券交易所	美国	1,092	1,665,628.75	0.18
381	Lockheed Martin Corp	洛克希德马丁	LMT US	美国纽约证券交易所	美国	480	1,665,542.93	0.18
382	Huntington Ingalls Industries Inc	Huntington Ingalls工业公司	HII US	美国纽约证券交易所	美国	873	1,664,202.35	0.18
383	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM US	纳斯达克证券交易所	美国	1,320	1,661,333.80	0.18
384	KKR & Co Inc	KKR & Co股份有限公司	KKR US	美国纽约证券交易所	美国	2,656	1,660,277.29	0.18
385	Tyler Technologies Inc	Tyler科技公司	TYL US	美国纽约证券交易所	美国	833	1,659,265.87	0.18
386	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	3,591	1,658,248.46	0.18

387	Intuitive Surgical Inc	直觉外科手术公司	ISRG US	纳斯达克证券交易所	美国	612	1,657,637.93	0.18
388	Paychex Inc	沛齐公司	PAYX US	纳斯达克证券交易所	美国	2,474	1,656,876.88	0.18
389	Phillips 66	菲利浦66	PSX US	美国纽约证券交易所	美国	1,439	1,656,839.63	0.18
390	NetApp Inc	美国网域存储技术有限公司	NTAP US	纳斯达克证券交易所	美国	1,571	1,655,920.22	0.18
391	J M Smucker Co/The	JM斯马克公司	SJM US	美国纽约证券交易所	美国	2,161	1,655,814.93	0.18
392	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	1,351	1,652,410.02	0.18
393	Invesco Ltd	景顺有限公司	IVZ US	美国纽约证券交易所	美国	9,192	1,652,166.87	0.18
394	Clorox Co/The	高乐氏公司	CLX US	美国纽约证券交易所	美国	2,541	1,651,732.06	0.18
395	Lululemon Athletica Inc	露露乐蒙	LULU US	纳斯达克证券交易所	美国	2,122	1,650,212.69	0.18
396	Paramount Skydance Corp	派拉蒙天空之舞公司	PSKY US	纳斯达克证券交易所	美国	24,554	1,648,935.51	0.18
397	L3Harris	L3Harris	LHX US	美国纽约证券	美国	833	1,648,656.47	0.18

	Technologies Inc	Technologies股份有限公司		交易所				
398	Marriott International Inc/MD	万豪国际集团	MAR US	纳斯达克证券交易所	美国	653	1,648,205.58	0.18
399	Ulta Beauty Inc	Ulta美容产品公司	ULTA US	纳斯达克证券交易所	美国	536	1,646,366.71	0.18
400	McDonald's Corp	麦当劳	MCD US	美国纽约证券交易所	美国	893	1,644,061.56	0.17
401	Equifax Inc	Equifax股份有限公司	EFX US	美国纽约证券交易所	美国	1,520	1,643,159.59	0.17
402	S&P Global Inc	标普全球	SPGI US	美国纽约证券交易所	美国	592	1,642,093.82	0.17
403	McKesson Corp	McKesson公司	MCK US	美国纽约证券交易所	美国	319	1,641,674.82	0.17
404	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	623	1,640,969.14	0.17
405	Solventum Corp	索尔文图姆公司	SOLV US	美国纽约证券交易所	美国	3,118	1,638,387.20	0.17
406	Molson Coors Beverage Co	莫尔森库尔斯饮料公司	TAP US	美国纽约证券交易所	美国	6,171	1,637,491.29	0.17
407	Coinbase Global Inc	Coinbase全球股份有限公	COIN US	纳斯达克证券交易所	美国	1,639	1,631,928.49	0.17

		司						
408	Costco Wholesale Corp	开市客	COST US	纳斯达克证券交易所	美国	256	1,631,076.51	0.17
409	EOG Resources Inc	EOG资源	EOG US	美国纽约证券交易所	美国	1,841	1,626,667.20	0.17
410	First Solar Inc	福思第一太阳能公司	FSLR US	纳斯达克证券交易所	美国	1,012	1,626,385.16	0.17
411	IDEXX Laboratories Inc	爱德士股份有限公司	IDXX US	纳斯达克证券交易所	美国	453	1,624,245.18	0.17
412	Cintas Corp	信达思公司	CTAS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,399	1,620,598.62	0.17
413	Fair Isaac Corp	费埃哲公司	FICO US	美国纽约证券交易所	美国	199	1,619,367.89	0.17
414	Pfizer Inc	辉瑞制药公司	PFE US	美国纽约证券交易所	美国	9,860	1,617,103.81	0.17
415	Archer-Daniels-Midland Co	Archer-Daniels-Midland公司	ADM US	美国纽约证券交易所	美国	3,105	1,615,695.32	0.17
416	Domino's Pizza Inc	达美乐披萨公司	DPZ US	纳斯达克证券交易所	美国	801	1,615,055.37	0.17
417	Walmart Inc	沃尔玛股份有限公司	WMT US	纳斯达克证券交易所	美国	2,093	1,614,545.50	0.17
418	Microsoft Corp	微软公司	MSFT US	纳斯达克证券交易所	美国	635	1,613,282.22	0.17
419	North	诺斯洛	NOC US	美国纽	美国	465	1,613,019.66	0.17

	rop Grumman Corp	普格鲁门公司		约证券交易所				
420	PepsiCo Inc	百事公司	PEP US	纳斯达克证券交易所	美国	1,749	1,612,920.56	0.17
421	Trade Desk Inc/The	Trade Desk 股份有限公司	TTD US	纳斯达克证券交易所	美国	13,085	1,611,300.93	0.17
422	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	171	1,609,984.79	0.17
423	ServiceNow Inc	ServiceNow 公司	NOW US	美国纽约证券交易所	美国	2,380	1,609,323.04	0.17
424	Dexcom Inc	德康医疗	DXCM US	纳斯达克证券交易所	美国	3,507	1,608,710.40	0.17
425	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	1,723	1,607,133.00	0.17
426	NIKE Inc	耐克公司	NKE US	美国纽约证券交易所	美国	5,742	1,605,391.11	0.17
427	Cigna Group/The	信诺集团	CI US	美国纽约证券交易所	美国	853	1,601,617.46	0.17
428	Prologis Inc	安博	PLD US	美国纽约证券交易所	美国	1,731	1,597,146.31	0.17
429	Estee Lauder Cos Inc/The	雅诗兰黛	EL US	美国纽约证券交易所	美国	2,956	1,589,501.96	0.17
430	APTIV	安波福	APTV	美国纽	美国	3,802	1,589,437.67	0.17

	PLC	公共有限公司	US	约证券交易所				
431	FactSet Research Systems Inc	FactSet研究系统股份有限公司	FDS US	美国纽约证券交易所	美国	1,013	1,587,423.55	0.17
432	Fiserv Inc	Fiserv股份有限公司	FISV US	纳斯达克证券交易所	美国	4,737	1,582,511.59	0.17
433	MSCI Inc	MSCI明晟	MSCI US	美国纽约证券交易所	美国	414	1,579,151.84	0.17
434	Intuit Inc	财捷集团	INTU US	纳斯达克证券交易所	美国	888	1,578,548.67	0.17
435	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	1,088	1,577,273.67	0.17
436	Old Dominion Freight Line Inc	奥多明尼昂货运	ODFL US	纳斯达克证券交易所	美国	1,069	1,577,032.56	0.17
437	Albemarle Corp	雅保公司	ALB US	美国纽约证券交易所	美国	1,714	1,576,324.37	0.17
438	Salesforce Inc	Salesforce股份有限公司	CRM US	美国纽约证券交易所	美国	1,476	1,574,885.50	0.17
439	Baker Hughes Co	贝克休斯公司	BKR US	纳斯达克证券交易所	美国	4,138	1,564,184.48	0.17
440	Akamai Technologies Inc	阿卡迈技术公司	AKAM US	纳斯达克证券交易所	美国	1,942	1,563,536.22	0.17

441	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	4,967	1,562,595.70	0.17
442	T-Mobile US Inc	T-Mobile US股份有限公司	TMUS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,360	1,553,653.47	0.17
443	VICI Properties Inc	VICI Properties股份有限公司	VICI US	美国纽约证券交易所	美国	8,588	1,552,962.84	0.17
444	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	1,924	1,550,354.54	0.16
445	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	5,376	1,550,295.97	0.16
446	Mondelez International Inc	亿滋国际公司	MDLZ US	纳斯达克证券交易所	美国	3,933	1,549,375.68	0.16
447	Copart Inc	科帕特公司	CPRT US	纳斯达克证券交易所	美国	8,049	1,545,402.13	0.16
448	Palantir Technologies Inc	Palantir技术股份有限公司	PLTR US	纳斯达克证券交易所	美国	1,938	1,539,988.49	0.16
449	Diamondback	戴蒙德巴克能源	FANG US	纳斯达克证券交易所	美国	1,284	1,537,230.48	0.16

	Energy Inc							
450	Wynn Resorts Ltd	永利渡假村有限公司	WYNN US	纳斯达克证券交易所	美国	2,324	1,536,792.13	0.16
451	AT&T Inc	美国电话电报公司	T US	美国纽约证券交易所	美国	10,875	1,533,218.73	0.16
452	Nasdaq Inc	纳斯达克股份有限公司	NDAQ US	纳斯达克证券交易所	美国	2,854	1,532,127.48	0.16
453	Deckers Outdoor Corp	德克斯户外用品公司	DECK US	美国纽约证券交易所	美国	2,264	1,531,039.65	0.16
454	Workday Inc	Workday股份有限公司	WDAY US	纳斯达克证券交易所	美国	1,836	1,530,839.13	0.16
455	Nucor Corp	纽柯公司	NUE US	美国纽约证券交易所	美国	1,007	1,527,747.87	0.16
456	HP Inc	惠普	HPQ US	美国纽约证券交易所	美国	10,223	1,527,634.61	0.16
457	Devon Energy Corp	戴文能源	DVN US	美国纽约证券交易所	美国	5,416	1,524,205.32	0.16
458	TJX Cos Inc/The	TJX公司	TJX US	美国纽约证券交易所	美国	1,473	1,519,917.04	0.16
459	Zoetis Inc	硕腾股份有限公司	ZTS US	美国纽约证券交易所	美国	3,105	1,519,684.11	0.16
460	Boston Scientific Corp	波士顿科学	BSX US	美国纽约证券交易所	美国	5,221	1,517,688.38	0.16

461	Autodesk Inc	欧特克公司	ADSK US	纳斯达克证券交易所	美国	1,140	1,509,559.70	0.16
462	Adobe Inc	奥多比公司	ADBE US	纳斯达克证券交易所	美国	1,081	1,509,476.75	0.16
463	Intercontinental Exchange Inc	洲际交易所(ICE)	ICE US	美国纽约证券交易所	美国	1,798	1,507,604.84	0.16
464	EchoStar Corp	回声星通信公司	ECHO US	纳斯达克证券交易所	美国	2,175	1,503,591.31	0.16
465	Rollins Inc	Rollins公司	ROL US	美国纽约证券交易所	美国	5,284	1,502,172.33	0.16
466	VeriSign Inc	威瑞信股份有限公司	VRSN US	纳斯达克证券交易所	美国	876	1,500,894.60	0.16
467	Chevron Corp	雪佛龙	CVX US	美国纽约证券交易所	美国	1,329	1,500,407.49	0.16
468	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	1,610	1,499,209.86	0.16
469	Netflix Inc	奈飞公司	NFLX US	纳斯达克证券交易所	美国	3,078	1,496,826.04	0.16
470	Ares Management Corp	阿瑞斯管理公司	ARES US	美国纽约证券交易所	美国	1,967	1,491,224.56	0.16
471	Casey's General Stores Inc	凯西杂货公司	CASY US	纳斯达克证券交易所	美国	275	1,488,639.68	0.16
472	Kroger Co/The	克罗格公司	KR US	美国纽约证券交易所	美国	3,915	1,480,689.32	0.16

473	Fedex Freight Holding Co Inc	联邦快递货运控股股份有限公司	FDXF US	美国纽约证券交易所	美国	1,439	1,479,933.65	0.16
474	ConocoPhillips	康菲石油	COP US	美国纽约证券交易所	美国	2,085	1,476,307.53	0.16
475	ON Semiconductor Corp	安森美半导体	ON US	纳斯达克证券交易所	美国	2,291	1,475,180.60	0.16
476	APA Corp	-	APA US	纳斯达克证券交易所	美国	6,642	1,473,401.59	0.16
477	Steel Dynamics Inc	Steel Dynamics股份有限公司	STLD US	纳斯达克证券交易所	美国	940	1,469,059.37	0.16
478	Halliburton Co	哈利伯顿	HAL US	美国纽约证券交易所	美国	6,353	1,469,004.54	0.16
479	SBA Communications Corp	SBA通信公司	SBAC US	纳斯达克证券交易所	美国	1,217	1,462,653.17	0.16
480	Leidos Holdings Inc	Leidos控股公司	LDOS US	美国纽约证券交易所	美国	2,074	1,454,534.31	0.15
481	Occidental Petroleum Corp	西方石油	OXY US	美国纽约证券交易所	美国	4,391	1,452,566.57	0.15
482	PTC Inc	PTC股份有限公司	PTC US	纳斯达克证券交易所	美国	1,868	1,445,432.90	0.15
483	Bunge Globa	-	BG US	美国纽约证券	美国	1,988	1,445,131.59	0.15

	l SA			交易所				
484	SLB Ltd	斯伦贝谢有限公司	SLB US	美国纽约证券交易所	美国	4,547	1,439,756.36	0.15
485	Gartner Inc	Gartner 公司	IT US	美国纽约证券交易所	美国	1,629	1,438,128.21	0.15
486	CME Group Inc	芝加哥商业交易所	CME US	纳斯达克证券交易所	美国	956	1,437,872.80	0.15
487	Crown Castle Inc	冠城股份有限公司	CCI US	美国纽约证券交易所	美国	2,787	1,437,505.22	0.15
488	CoStar Group Inc	科斯塔集团	CSGP US	纳斯达克证券交易所	美国	7,374	1,422,331.69	0.15
489	Cboe Global Markets Inc	Cboe 环球市场公司	CBOE US	巴兹全球市场	美国	859	1,419,756.15	0.15
490	American Tower Corp	美国发射塔公司	AMT US	美国纽约证券交易所	美国	1,272	1,417,082.94	0.15
491	LyondellBasell Industries NV	利安德巴塞尔工业公司	LYB US	美国纽约证券交易所	美国	3,874	1,389,192.71	0.15
492	Dow Inc	陶氏公司	DOW US	美国纽约证券交易所	美国	7,101	1,323,244.54	0.14
493	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	4,872	1,285,166.16	0.14
494	Accenture	埃森哲公司	ACN US	美国纽约证券	美国	1,480	1,254,371.63	0.13

	PLC			交易所				
495	Oracle Corp	甲骨文股份有限公司	ORCL US	美国纽约证券交易所	美国	1,254	1,251,664.29	0.13
496	News Corp	新闻集团	NWSA US	纳斯达克证券交易所	美国	6,985	1,181,265.81	0.13
497	Alphabet Inc	Alphabet股份有限公司	GOOGL US	纳斯达克证券交易所	美国	417	1,014,982.73	0.11
498	Honeywell International Inc	霍尼韦尔国际公司	HON US	纳斯达克证券交易所	美国	613	934,800.79	0.10
499	Honeywell Aerospace Inc	霍尼韦尔航空航天股份有限公司	HONA US	纳斯达克证券交易所	美国	613	923,027.06	0.10
500	Fox Corp	福克斯公司	FOXA US	纳斯达克证券交易所	美国	2,450	870,378.53	0.09
501	Alphabet Inc	Alphabet股份有限公司	GOOG US	纳斯达克证券交易所	美国	335	806,175.92	0.09
502	Fox Corp	福克斯公司	FOX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,728	551,270.98	0.06
503	News Corp	新闻集团	NWS US	纳斯达克证券交易所	美国	2,182	417,010.43	0.04

6.4.2 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	Conagra Brand	康尼格拉品牌股份有	CAG US	美国纽约证券交易所	美国	18,922	1,734,668.94	0.18

	s Inc	限公司						

6.5 报告期内权益投资组合的重大变动

6.5.1 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	Marvell Technology Inc	MRVL US	2,080,091.81	0.28
2	Ciena Corp	CIEN US	2,000,077.86	0.27
3	Devon Energy Corp	DVN US	1,878,902.48	0.25
4	Flex Ltd	FLEX US	1,876,806.57	0.25
5	Lumentum Holdings Inc	LITE US	1,816,651.19	0.24
6	Echostar Corporation	SATS US	1,765,230.95	0.24
7	Casey's General Stores Inc	CASY US	1,724,629.79	0.23
8	Veeva Systems Inc	VEEV US	1,691,740.23	0.23
9	Coherent Corp	COHR US	1,658,827.57	0.22
10	Vertiv Holdings Co	VRT US	1,614,242.58	0.22
11	Intuit Inc	INTU US	1,528,645.31	0.21
12	Coinbase Global Inc	COIN US	1,301,694.02	0.18
13	Fedex Freight Holding Co Inc	FDXF US	1,233,627.45	0.17
14	Trade Desk Inc/The	TTD US	1,231,838.22	0.17
15	DoorDash Inc	DASH US	1,171,169.77	0.16
16	Boston Scientific Corp	BSX US	1,168,580.84	0.16
17	NRG Energy Inc	NRG US	1,156,642.52	0.16
18	Insulet Corp	PODD US	1,155,838.28	0.16
19	Fidelity National Information Services Inc	FIS US	1,151,065.73	0.16
20	CoStar Group Inc	CSGP US	1,106,316.57	0.15

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。

6.5.2 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	Sandisk Corp	SNDK US	5,740,632.19	0.77
2	Micron Technology Inc	MU US	3,172,559.24	0.43
3	Seagate Technology Holdings PLC	STX US	2,936,622.87	0.40
4	Intel Corp	INTC US	2,858,711.88	0.39
5	Dell Technologies Inc	DELL US	2,858,573.52	0.39
6	Western Digital Corp	WDC US	2,648,904.83	0.36
7	Advanced Micro Devices Inc	AMD US	2,500,842.17	0.34
8	Hewlett Packard Enterprise Co	HPE US	1,982,943.59	0.27
9	Humana Inc	HUM US	1,977,784.52	0.27
10	Coterra Energy Inc	CTRA US	1,867,743.98	0.25
11	ON Semiconductor Corp	ON US	1,859,826.61	0.25
12	Devon Energy Corp	DVN US	1,686,906.80	0.23
13	Pool Corporation	POOL US	1,541,180.04	0.21
14	Molina Healthcare Inc	MOH US	1,497,692.59	0.20
15	Campbell's Company/The	CPB US	1,489,267.53	0.20
16	Corning Inc	GLW US	1,483,776.71	0.20
17	Paycom Software Inc	PAYC US	1,405,870.09	0.19
18	Dayforce Inc	DAY US	1,403,039.41	0.19
19	Hologic Inc	HOLX US	1,390,975.61	0.19
20	Lam Research Corp	LRCX US	1,368,798.58	0.18

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。

6.5.3 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	301,130,253.52
卖出收入（成交）总额	178,917,324.22

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。

6.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

6.7 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。

6.8 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。

6.9 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。

6.10 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。

6.11 投资组合报告附注

6.11.1 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。

6.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

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。

6.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	850,347.05
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,976,608.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,826,955.62

6.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

6.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

6.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

6.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

6.11.6 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。

§7 基金份额持有人信息

7.1 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 人民币	234,996	1,115.50	433,192.85	0.17	261,705,788.77	99.83
大成标普 500 等权重指数(QDII)C 人民币	273,014	277.00	618,752.34	0.82	75,006,278.92	99.18
合计	508,010	664.88	1,051,945.19	0.31	336,712,067.69	99.69

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。

7.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	大成标普 500 等权重指数(QDII)A	71,372.09	0.0272
	大成标普 500 等权重指数(QDII)C	13,432.41	0.0178
	合计	84,804.50	0.0251

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）。

7.3 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	0~10
	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	0~10
	大成标普 500 等权重指数(QDII)C	0
	合计	0~10

§8 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）基金份额总额	822,754,222.26	-
本报告期期初基金份额总额	227,462,177.16	49,705,916.54
本报告期基金总申购份额	87,046,757.48	58,706,941.52
减：本报告期基金总赎回份额	52,369,953.02	32,787,826.80
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	262,138,981.62	75,625,031.26

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）。

§9 重大事件揭示

9.1 基金份额持有人大会决议

无。

9.2 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

经大成基金管理有限公司 2026 年第一次临时股东会及公司九届四次监事会审议通过，同意

选举郭向东先生为公司第九届监事会股东代表监事，监事会主席，任期自2026年4月30日之日起计算，与公司第九届监事会剩余任期一致。自郭向东先生的监事任职生效之日起，陈勇先生将不再担任公司监事、监事会主席职务。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

无。

9.3 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。

9.4 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。

9.5 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。

9.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

9.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

9.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

9.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

9.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

9.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

9.7.1 基金租用或者通过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(%)	
CLSA Limited	1	274,351,277.42	57.86	59,055.90	48.63	-

Morgan Stanley	1	199,809,517.29	42.14	62,392.61	51.37	-
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。

9.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

9.8 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	2026 年 06 月 30 日
2	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	2026 年 06 月 30 日
3	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	2026 年 06 月 30 日
4	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	2026 年 06 月 30 日
5	关于大成标普 500 等权重指数证券	中国证监会基金电子披	2026 年 06 月 03 日

	投资基金调整大额申购（含定期定额申购）的公告	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	2026 年 05 月 20 日
7	2025 年度公募基金管理人以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 04 月 30 日
8	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	2026 年 04 月 23 日
9	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2026 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	2026 年 04 月 22 日
10	大成基金管理有限公司旗下 212 只公募基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2026 年 04 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	2026 年 04 月 07 日
12	大成基金管理有限公司旗下 205 只公募基金 2025 年年度报告提示性公告	规定报刊	2026 年 03 月 31 日
13	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2025 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	2026 年 03 月 31 日
14	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	2026 年 02 月 14 日
15	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	2026 年 01 月 30 日
16	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	2026 年 01 月 23 日
17	大成基金管理有限公司旗下 205 只公募基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	规定报刊	2026 年 01 月 22 日
18	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2025 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	2026 年 01 月 22 日
19	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 2025 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	2026 年 01 月 14 日

20	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金 2026 年境外（地区）主要市场节假日暂停申购赎回安排的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 01 月 07 日

§10 影响投资者决策的其他重要信息

10.1 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。

10.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§11 备查文件目录

11.1 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。

11.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

11.3 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

2026 年 8 月 28 日