

大成标普 500 等权重指数证券投资基金  
2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 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 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经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 2026 年 3 月 30 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。

本报告财务资料已经审计。容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>17</b>
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>19</b>
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	20
7.3 净资产变动表.....	22
7.4 报表附注.....	23
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>52</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	52
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 .....	52
8.3 期末按行业分类的权益投资组合 .....	53
8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 .....	53
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动 .....	102
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....	104
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 .....	104
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 .....	104
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 .....	104
8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....	104
8.11 投资组合报告附注 .....	104
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>105</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	105
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	106
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	106
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	106
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>106</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>107</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	107
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	107
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	107
11.4 基金投资策略的改变 .....	107
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	107
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....	108
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	108
11.8 其他重大事件 .....	109
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>112</b>
12.1 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 .....	112
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	112
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>112</b>
13.1 备查文件目录 .....	112
13.2 存放地点 .....	112
13.3 查阅方式 .....	112

## § 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	277,168,093.70 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	227,462,177.16 份	49,705,916.54 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	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

## 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.dcfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
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、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据和指标	2025 年		2024 年		2023 年	2023 年 8 月 30 日(基金 合同生效 日) - 2023 年 12 月 31 日
	大成标普	大成标普	大成标普	大成标普	大成标普	大成标普

	500 等权重 指数 (QDII)A	500 等权重 指数 (QDII)C	500 等权重 指数 (QDII)A	500 等权重 指数 (QDII)C	500 等权重 指数 (QDII)A	500 等权重 指数 (QDII)C
本期已实现收益	72,049,359.92	14,296,589.51	32,218,201.19	2,576,201.08	8,266,278.39	-17,179.03
本期利润	44,198,434.22	6,704,380.52	68,890,479.87	2,923,199.24	49,265,014.99	658,422.73
加权平均基金份额本期利润	0.1417	0.1021	0.2648	0.1511	0.2822	0.3938
本期加权平均净值利润率	5.49%	3.99%	10.64%	6.01%	12.76%	16.84%
本期基金份额净值增长率	6.49%	6.20%	11.63%	11.34%	13.30%	3.78%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
期末可供分配利润	210,134,172.23	45,091,125.99	212,635,159.50	26,923,050.16	126,645,751.79	5,786,784.04
期末可供分配基金份额利润	0.9238	0.9072	0.7450	0.7360	0.6939	0.6921
期末基金资产净值	609,205,619.25	132,581,504.96	738,651,461.55	94,516,503.30	435,937,264.25	19,994,894.99
期末基金份额净值	2.6783	2.6673	2.5881	2.5838	2.3890	2.3910
3.1.3 累计期末指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
基金份额累计净值增长率	268.06%	22.71%	245.61%	15.54%	209.60%	3.78%

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

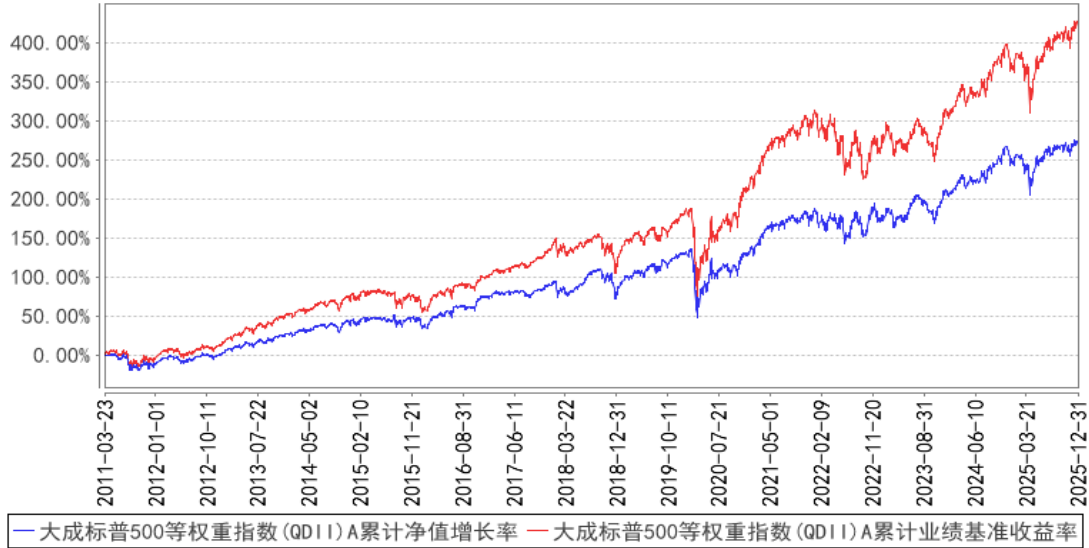
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.17%	0.70%	1.39%	0.75%	-1.56%	-0.05%
过去六个月	3.15%	0.66%	6.30%	0.70%	-3.15%	-0.04%
过去一年	6.49%	1.01%	11.43%	1.10%	-4.94%	-0.09%
过去三年	34.69%	0.86%	43.39%	0.92%	-8.70%	-0.06%
过去五年	58.77%	0.98%	64.60%	1.03%	-5.83%	-0.05%
自基金合同生效起至今	268.06%	1.09%	420.29%	1.14%	-152.23%	-0.05%

大成标普 500 等权重指数 (QDII) C

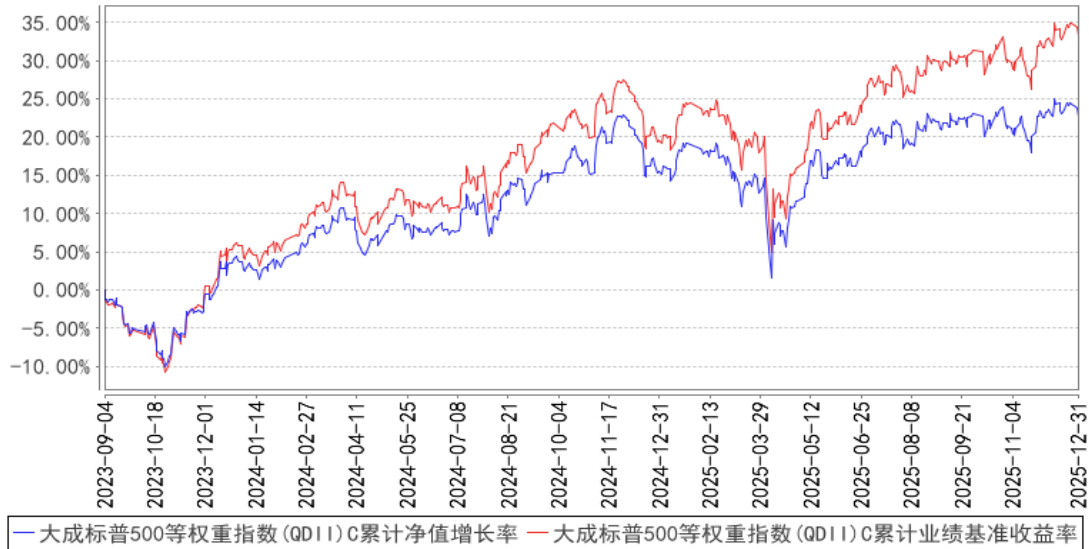
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.25%	0.70%	1.39%	0.75%	-1.64%	-0.05%
过去六个月	2.99%	0.66%	6.30%	0.70%	-3.31%	-0.04%
过去一年	6.20%	1.02%	11.43%	1.10%	-5.23%	-0.08%
自基金合同生效起至今	22.71%	0.86%	33.20%	0.92%	-10.49%	-0.06%

### 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



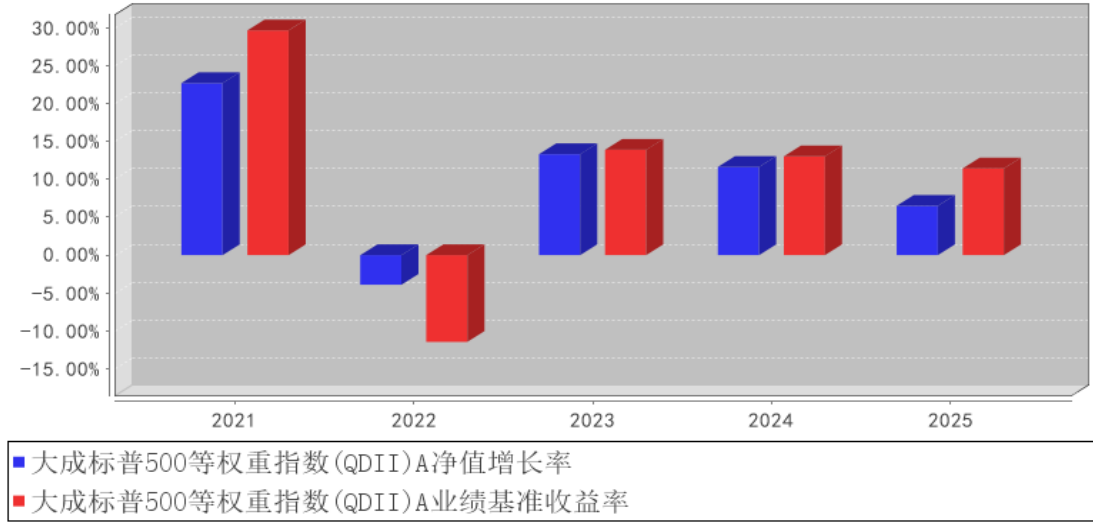
注：1、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

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。

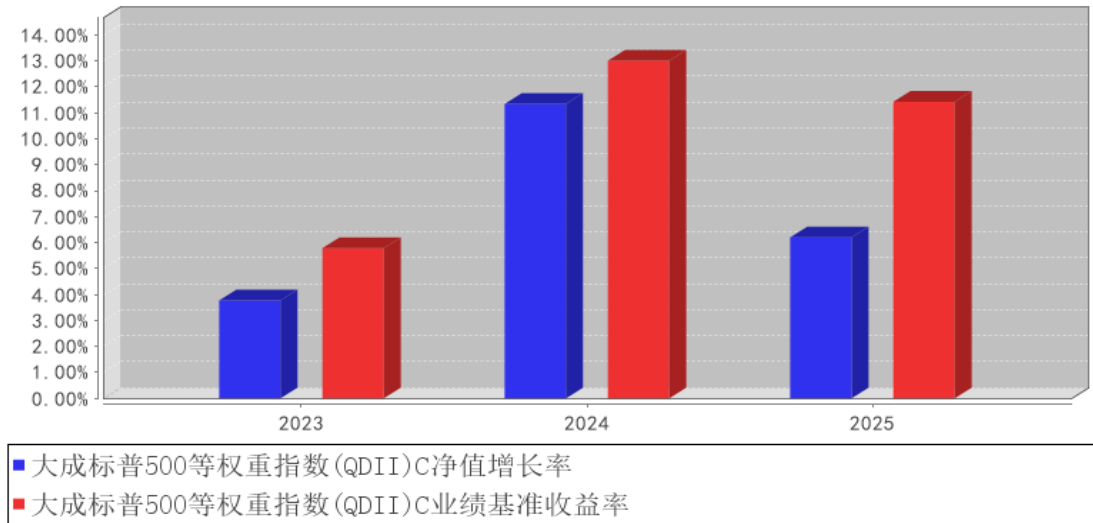
3、同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

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

大成标普500等权重指数(QDII)A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



大成标普500等权重指数(QDII)C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

大成标普 500 等权重指数(QDII)A

年度	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	年度利润分配合计	备注
2025 年	0.7451	8,780,753.20	13,757,000.93	22,537,754.13	-
2024 年	0.6940	11,332,568.59	5,852,471.19	17,185,039.78	-

2023 年	0.7190	6,849,710.71	4,977,348.44	11,827,059.15	-
合计	2.1581	26,963,032.50	24,586,820.56	51,549,853.06	-

## 大成标普 500 等权重指数(QDII)C

年度	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	年度利润分配合计	备注
2025 年	0.7360	2,769,764.06	904,097.33	3,673,861.39	-
2024 年	0.6922	610,155.69	52,129.22	662,284.91	-
2023 年	-	-	-	-	-
合计	1.4282	3,379,919.75	956,226.55	4,336,146.30	-

## § 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

				<p>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。</p> <p>国籍：中国</p>
--	--	--	--	--

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《证券投资基金经营机构董事、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。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《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。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持，投资部门负责投资决策，交易管理部负责实施交易并实时监控，监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核，风险管理部负责对交易情况进行合理性分析，通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

#### 4.3.2 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。

##### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

无。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 1 次，为完全按照指数的构成比例进行投资的组合和其他组合发生的反向交易。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

2025 年，全球经济保持相对稳定增长的态势，美国主要股票指数也保持了持续上涨的态势，并再次创出历史新高。

2025 年总体来看，美国宏观经济保持正增长，但是在不同的时期展现出不同的经济趋势。在 1 季度，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 1 季度 GDP 出现负增长。4 月 2 日，特朗普政府正式推出所谓“对等关税政策”，进一步加剧了宏观经济前景的不确定性，也进一步加剧了美股的波动。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。美国 2 季度及 3 季度的 GDP 增速也展现出良好的增长态势。由于受美国政府关门等因素影响，4 季度 GDP 增速或会大幅降低，但全年依然维持正增长的预期。

2025 年，虽然特朗普政府提高了关税，但通胀依然维持稳定，并未受到显著影响。展望 2026 年，关税压力有望逐步消散，通胀有望保持稳定，但如果个人收入增速保持高位，则核心 CPI 下行空间有限。

2025 年，美联储采取了三次降息行动，将基准利率下调至 3.5%-3.75% 区间。但由于受到通胀的限制，未来降息次数可能有限。本轮降息的原因并非因为宏观经济大幅走弱，而是因为通胀水平出现了下行，因此降息利好美股。

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 2.6783 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.49%，同期业绩比较基准收益率为 11.43%；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 2.6673 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.20%，同期业绩比较基准收益率为 11.43%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年，美国宏观经济仍有望保持正常的增长速度，但美国劳动力市场的显著降温是最大风险点，最显著的标志性事件是 2025 年 4 季度以来非农就业数据大幅下降并曾出现过负增长，失业率也出现了小幅缓步上升的势头。2026 年劳动力市场的变化是宏观经济走向的重要决定因素之一，在劳动力市场降温的背景下，经济增速可能有所降低。

由于受到 AI 业务的推动，2025 年美股上市公司盈利保持快速增长，展望 2026 年，AI 浪潮有望持续推进，上市公司盈利仍然有望快速增长。但当前美股估值水平高于历史平均水平，因此未来盈利增长有望推动美股指数的持续走强，但指数增幅有可能低于盈利增速，且美股出现阶段性波动的概率在增加。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，依据相关的法律法规、基金合同以及内部监察稽核制度，本基金管理人对本基金运作、内部管理、制度执行及遵纪守法情况进行了监察稽核。内部监察稽核的重点是：国家法律法规及行业监管规则的执行情况；基金合同的遵守情况；内部规章制度的执行情况；资讯管制和保密工作落实情况；员工职业操守规范情况，目的是规范基金财产的运作，防范和控制投资风险，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，维护本基金份额持有人的合法权益。

（一）根据最新的法律法规、规章、规范性文件，本基金管理人及时制定了相应的公司制度，并对现有制度进行不断修订和完善，确保本基金管理人内控制度的适时性、全面性和合法合规性。同时，为保障制度的适时性，避免部分内控制度、业务规则与业务发展不相适应，报告期内本基金管理人组织各部门对内部管理制度作了进一步梳理和完善。

（二）全面加强风险监控，不断提高基金业务风险管理水平。为督促各部门完善并落实各项内控措施，公司严格执行风险控制管理员制度，健全内控工作协调机制及监督机制，并进一步加强投资风险数量化评价能力及事前风险防范能力，有效防范相关业务风险。同时，公司严格执行投资报备制度，建立了基金从业人员证券投资管理监控信息系统，将投资报备工作纳入常态。

（三）日常监察和专项监察相结合，确保监察稽核的有效性和深入性。本年度，公司继续对本基金销售、宣传等方面的材料、协议及其他法律资料等进行了严格审查，对本基金各项投资比例、投资权限、基金交易、股票投资限制、股票库维护等方面进行实时监控，同时，还专门针对基金投资交易（包括公平交易、转债投资、投资权限、投资比例、流动性风险、基金重仓股等）、基金运营（基金头寸、基金结算、登记清算等）、网上交易、基金销售等进行专项监察。通过日常监察，保证了公司监察的全面性、实时性，通过专项监察，及时发现并纠正了业务中的潜在风险，加强了业务部门和人员的风险意识，从而较好地预防了风险的发生。

（四）加强了对投资管理人员通讯工具在交易时间的集中管理，定期或不定期对投资管理人员的网络即时通讯记录、电话录音等进行抽查，有效的防范了各种形式的利益输送行为。

（五）以多种方式加强合规教育与培训，提高全公司的合规守法意识。及时向全公司传达与基金相关的法律法规，并要求公司各部门贯彻到日常工作中。公司监察稽核部通过解答各业务部门提出的法律问题，提供法律依据，对于较为重大疑难法律事项及时咨询公司外部律师或监管部

门，避免了业务发展中的盲目性，及时防范风险，维护了基金份额持有人的利益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 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，完全尽职尽责的履行了应尽的义务。

### 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。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	大成标普 500 等权重指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了大成标普 500 等权重指数证券投资基金财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则和中国注册会计师独立性准则，我们独立于大成标普 500 等权重指数证券投资基金，并遵守了独立性准则中</p>

	<p>适用于公众利益实体财务报表审计的规定，同时履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
其他信息	<p>大成标普 500 等权重指数证券投资基金的基金管理人大成基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2025 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估大成标普 500 等权重指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算大成标普 500 等权重指数证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督大成标普 500 等权重指数证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p>

	<p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对大成标普 500 等权重指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致大成标普 500 等权重指数证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	陈熹   陶文欣
会计师事务所的地址	北京市西城区阜成门外大街22号1幢10层1001-1至1001-26
审计报告日期	2026年3月30日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	46,080,762.49	61,453,622.90
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	699,137,600.86	770,025,843.25
其中：股票投资		699,137,600.86	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	7.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		725,547.95	789,805.31
应收申购款		683,910.08	8,850,413.32
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		746,627,821.38	841,119,684.78
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025年12月31日</b>	<b>上年度末 2024年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		3,794,002.53	6,852,047.19
应付管理人报酬		689,667.89	705,755.73
应付托管费		137,933.56	176,438.93
应付销售服务费		34,952.54	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	7.4.7.9	184,140.65	195,614.93
负债合计		4,840,697.17	7,951,719.93
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	277,168,093.70	321,984,645.37
未分配利润	7.4.7.12	464,619,030.51	511,183,319.48
净资产合计		741,787,124.21	833,167,964.85
负债和净资产总计		746,627,821.38	841,119,684.78

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 277,168,093.70 份。其中大成标普 500 等权重指数(QDII)A 类基金份额总额为 227,462,177.16 份，基金份额净值 2.6783 元；大成标普 500 等权重指数(QDII)C 类基金份额总额为 49,705,916.54 份，基金份额净值 2.6673 元。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年1月1日至2025 年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年12月31日
----	-----	---------------------------------	--------------------------------------

<b>一、营业总收入</b>		63,404,165.96	81,121,653.21
1. 利息收入		234,173.01	140,357.06
其中：存款利息收入	7.4.7.13	234,173.01	140,357.06
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）		102,076,603.10	45,844,828.18
其中：股票投资收益	7.4.7.14	86,520,426.26	34,771,688.93
基金投资收益	7.4.7.15	-	-
债券投资收益	7.4.7.16	-	-
资产支持证券投资	7.4.7.17	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.18	-	-
衍生工具收益	7.4.7.19	-	-
股利收益	7.4.7.20	15,556,176.84	11,073,139.25
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）	7.4.7.21	-35,443,134.69	37,019,276.84
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-4,175,715.87	-2,107,993.93
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.22	712,240.41	225,185.06
<b>减：二、营业总支出</b>		12,501,351.22	9,307,974.10
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	9,721,636.31	6,950,982.95
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,020,107.44	1,737,745.74
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	502,453.93	145,531.36
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	7.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.24	257,153.54	473,714.05
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		50,902,814.74	71,813,679.11
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		50,902,814.74	71,813,679.11
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		50,902,814.74	71,813,679.11

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 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）	-44,816,551.67	-	-46,564,288.97	-91,380,840.64
（一）、综合收益总额	-	-	50,902,814.74	50,902,814.74
（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）	-44,816,551.67	-	-71,255,488.19	-116,072,039.86
其中：1. 基金申购款	353,165,529.70	-	550,827,711.15	903,993,240.85
2. 基金赎回款	-397,982,081.37	-	-622,083,199.34	-1,020,065,280.71
（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	277,168,093.70	-	464,619,030.51	741,787,124.21
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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）	131,114,827.85	-	246,120,977.76	377,235,805.61
（一）、综合收益总额	-	-	71,813,679.11	71,813,679.11
（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）	131,114,827.85	-	192,154,623.34	323,269,451.19
其中：1. 基金申购款	269,685,517.17	-	398,278,540.18	667,964,057.35
2. 基金赎回款	-138,570,689.32	-	-206,123,916.84	-344,694,606.16
（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	321,984,645.37	-	511,183,319.48	833,167,964.85

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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

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。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

###### 债务工具

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

###### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融工具，自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利, 且该种法定权利现在是可执行的, 同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时, 金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外, 金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示, 不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征: (1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比份额获得该基金净资产的权利, 这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产; 这里所指按比份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位, 并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量; (2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别, 即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具, 且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权; (3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别), 所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征, 并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同); (4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外, 该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征; (5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额, 应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具, 是指根据合同约定, 持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利, 或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时, 自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同: (1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影

响)；(2)实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份

额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

#### 7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用。

(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩。

(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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》、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》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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	46,080,762.49	61,453,622.90
等于：本金	46,075,058.56	61,447,993.62
加：应计利息	5,703.93	5,629.28
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	46,080,762.49	61,453,622.90

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	622,085,809.05	-	699,137,600.86	77,051,791.81
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	622,085,809.05	-	699,137,600.86	77,051,791.81
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	657,530,916.75	-	770,025,843.25	112,494,926.50
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	657,530,916.75	-	770,025,843.25	112,494,926.50

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

##### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

## 7.4.7.4 买入返售金融资产

## 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

## 7.4.7.5 债权投资

## 7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

## 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

## 7.4.7.6 其他债权投资

## 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 7.4.7.7 其他权益工具投资

## 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 7.4.7.8 其他资产

无。

## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	5,290.98	16,677.84
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	3,849.67	3,937.09
预提费用	175,000.00	175,000.00
合计	184,140.65	195,614.93

#### 7.4.7.10 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 12 月 31 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	227,725,712.90	227,725,712.90
本期赎回 (以“-”号填列)	-285,667,531.89	-285,667,531.89
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	227,462,177.16	227,462,177.16

##### 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 12 月 31 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	125,439,816.80	125,439,816.80
本期赎回 (以“-”号填列)	-112,314,549.48	-112,314,549.48
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	49,705,916.54	49,705,916.54

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)。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 7.4.7.12 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	72,049,359.92	-27,850,925.70	44,198,434.22
本期基金份额交易产生的变动数	-52,012,593.06	-41,152,110.34	-93,164,703.40
其中：基金申购款	162,884,479.95	192,549,538.14	355,434,018.09
基金赎回款	-214,897,073.01	-233,701,648.48	-448,598,721.49
本期已分配利润	-22,537,754.13	-	-22,537,754.13
本期末	210,134,172.23	171,609,269.86	381,743,442.09

## 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	14,296,589.51	-7,592,208.99	6,704,380.52
本期基金份额交易产生的变动数	7,545,347.71	14,363,867.50	21,909,215.21
其中：基金申购款	86,309,497.48	109,084,195.58	195,393,693.06
基金赎回款	-78,764,149.77	-94,720,328.08	-173,484,477.85
本期已分配利润	-3,673,861.39	-	-3,673,861.39
本期末	45,091,125.99	37,784,462.43	82,875,588.42

## 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
活期存款利息收入	214,239.01	140,305.70
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	19,934.00	51.36
合计	234,173.01	140,357.06

## 7.4.7.14 股票投资收益

## 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	86,520,426.26	34,771,688.93
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券	-	-

出借差价收入		
合计	86,520,426.26	34,771,688.93

#### 7.4.7.14.2 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12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
卖出股票成交总额	554,844,826.54	159,345,257.25
减：卖出股票成本总额	468,003,586.29	124,394,736.99
减：交易费用	320,813.99	178,831.33
买卖股票差价收入	86,520,426.26	34,771,688.93

#### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 7.4.7.15 基金投资收益

无。

#### 7.4.7.16 债券投资收益

##### 7.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

无。

##### 7.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

##### 7.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 7.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.17 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

##### 7.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

##### 7.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.18 贵金属投资收益

## 7.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 7.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 7.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.19 衍生工具收益

## 7.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 7.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 7.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	15,556,176.84	11,073,139.25
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	15,556,176.84	11,073,139.25

## 7.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-35,443,134.69	37,019,276.84
股票投资	-35,443,134.69	37,019,276.84
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	-35,443,134.69	37,019,276.84

#### 7.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
基金赎回费收入	701,213.10	224,437.39
其他	11,027.31	747.67
合计	712,240.41	225,185.06

#### 7.4.7.23 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
审计费用	55,000.00	55,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	46,292.57	275,778.84
银行划款手续费	21,350.80	22,935.21
其他	14,510.17	-
合计	257,153.54	473,714.05

#### 7.4.7.25 分部报告

无。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2026 年 01 月 14 日宣告 2025 年度第 1 次分红，向截至 2026 年 01 月

16 日止在本基金注册登记人登记在册的全体持有人，大成标普 500 等权重指数(QDII)A 按每 10 份基金份额派发红利 0.9240 元，大成标普 500 等权重指数(QDII)C 按每 10 份基金份额派发红利 0.9080 元。

#### 7.4.9 关联方关系

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
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
大成国际资产管理有限公司(“大成国际”)	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司(“大成创新资本”)	基金管理人的合营企业

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 7.4.10.1.4 基金交易

无。

###### 7.4.10.1.5 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	9,721,636.31	6,950,982.95
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,248,180.45	1,972,271.54
应支付基金管理人的净管理费	6,473,455.86	4,978,711.41
应支付投资顾问的投资顾问费	-	-

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：

$$\text{日管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times \text{管理费年费率} / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,020,107.44	1,737,745.74

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：

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

（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%。

#### 7.4.10.2.3 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 12 月 31 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	-	13,248.20	13,248.20
合计	-	13,248.20	13,248.20
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 12 月 31 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	-	4,649.38	4,649.38
合计	-	4,649.38	4,649.38

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：

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

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

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

无。

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

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

无。

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

无。

**7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**

**7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自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 12 月 31 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	-	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 12 月 31 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	-	0.00
报告期内因拆分 变动份额	-	-
减: 报告期内赎回/ 卖出总份额	-	0.00
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。

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

无。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	36,151,508.49	214,239.01	47,770,589.76	140,305.70
中银香港	9,929,254.00	-	13,683,033.14	-

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。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

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	备注
		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	22,537,754.13	-
合计	-	-	-	0.7451	8,780,753.20	13,757,000.93	22,537,754.13	-
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	备注
		场内	场外					
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	-

#### 7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

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

无。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，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。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

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)。

#### 7.4.13.3 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。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《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同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。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

## 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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
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。

## 7.4.13.4.1.2 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）。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有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。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 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	699,137,6 00.86	-	-	699,137,600.86
应收股利	725,547.9 5	-	-	725,547.95
资产合计	709,793,9 90.12	-	-	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 额	709,790,1 40.45	-	-	709,790,140.45
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	13,684,93	-	-	13,684,938.78

	8.78			
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
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

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
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12月31日）	上年度末（2024年12月31日）
	所有外币相对人民币升值 5%	35,489,507.00	39,224,832.45
所有外币相对人民币贬值 5%	-35,489,507.00	-39,224,832.45	

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 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	699,137,600.86	94.25	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	699,137,600.86	94.25	770,025,843.25	92.42

#### 7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%		34,688,709.65
业绩比较基准下降 5%		-34,688,709.65	-39,224,832.45

## 7.4.14 公允价值

### 7.4.14.1 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。

### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	699,137,600.86	770,025,843.25
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	699,137,600.86	770,025,843.25

#### 7.4.14.2.2 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。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

无。

##### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

无。

**7.4.14.3 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)。

**7.4.14.4 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。

**7.4.15 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。

**§ 8 投资组合报告****8.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	699,137,600.86	93.64
	其中：普通股	699,137,600.86	93.64
	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	46,080,762.49	6.17
8	其他各项资产	1,409,458.03	0.19
9	合计	746,627,821.38	100.00

**8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布**

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
美国	699,137,600.86	94.25
合计	699,137,600.86	94.25

## 8.3 期末按行业分类的权益投资组合

## 8.3.1 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	36,517,041.63	4.92
非必需消费品	67,323,338.54	9.08
必需消费品	49,909,964.27	6.73
能源	31,015,795.20	4.18
金融	113,273,911.41	15.27
房地产	44,126,927.38	5.95
医疗保健	84,623,521.87	11.41
工业	103,232,373.30	13.92
材料	38,489,216.19	5.19
科技	86,087,999.77	11.61
公用事业	44,537,511.30	6.00
政府	-	-
合计	699,137,600.86	94.25

注：以上分类采用彭博行业分类标准。

## 8.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

无。

## 8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

## 8.4.1 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	Carnival Corp	嘉年华公司	CCL US	美国纽约证券交易所	美国	7,586	1,628,407.36	0.22
2	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	10,361	1,625,462.86	0.22
3	Freemport-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	4,387	1,566,127.20	0.21

		司						
4	Lululemon Athletica Inc	露露乐蒙	LULU US	纳斯达克证券交易所	美国	1,062	1,551,215.53	0.21
5	Merck & Co Inc	默克	MRK US	美国纽约证券交易所	美国	2,079	1,538,151.24	0.21
6	Camden Property Trust	Camden 房地产信托公司	CPT US	美国纽约证券交易所	美国	1,983	1,534,307.19	0.21
7	PG&E Corp	太平洋煤气电力	PCG US	美国纽约证券交易所	美国	13,572	1,532,995.62	0.21
8	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	2,243	1,531,312.57	0.21
9	Boeing Co/The	波音	BA US	美国纽约证券交易所	美国	1,003	1,530,671.34	0.21
10	Moody's Corp	穆迪	MCO US	美国纽约证券交易所	美国	426	1,529,622.22	0.21
11	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	5,873	1,527,365.27	0.21
12	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	1,056	1,521,743.07	0.21
13	Linde PLC	林德公司	LIN US	纳斯达克证券交易所	美国	507	1,519,484.09	0.20
14	Comca	康卡斯	CMCSA	纳斯达克	美国	7,228	1,518,536.53	0.20

	st Corp	特公司	US	克 证 券 交 易 所				
15	MSCI Inc	MSCI 明晟	MSCI US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	376	1,516,270.17	0.20
16	Citigroup Inc	花旗集团	C US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,848	1,515,712.36	0.20
17	Everest Group Ltd	Everest 集团有限公司	EG US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	635	1,514,616.78	0.20
18	Micro n 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	755	1,514,597.81	0.20
19	Tapestry Inc	-	TPR US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,686	1,514,145.64	0.20
20	Huntington Ingalls Industries Inc	Huntington Ingalls 工业公司	HII US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	633	1,513,049.78	0.20
21	Assurant Inc	安信龙集团	AIZ US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	893	1,511,747.63	0.20
22	Airbnb Inc	爱彼迎股份有限公司	ABNB US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,581	1,508,192.95	0.20
23	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	829	1,507,937.03	0.20
24	Ball Corp	波尔	BALL US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	4,041	1,504,527.08	0.20
25	Viatris Inc	晖致	VTRS US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	17,186	1,503,922.11	0.20

26	Monster Beverage Corp	怪兽饮料公司	MNST US	纳斯达克证券交易所	美国	2,785	1,500,831.20	0.20
27	Gartner Inc	Gartner 公司	IT US	美国纽约证券交易所	美国	846	1,500,148.91	0.20
28	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	765	1,499,761.77	0.20
29	General Electric Co	通用电气公司	GE US	美国纽约证券交易所	美国	692	1,498,236.23	0.20
30	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	276	1,497,388.28	0.20
31	Zoetis Inc	硕腾股份有限公司	ZTS US	美国纽约证券交易所	美国	1,688	1,492,805.78	0.20
32	Walt Disney Co/The	华特迪士尼公司	DIS US	美国纽约证券交易所	美国	1,864	1,490,578.50	0.20
33	Centene Corp	Centene 公司	CNC US	美国纽约证券交易所	美国	5,153	1,490,428.57	0.20
34	Mid-America Apartment Communities Inc	-	MAA US	美国纽约证券交易所	美国	1,526	1,489,941.55	0.20
35	Edison	爱迪生国际	EIX US	美国纽约证券交易所	美国	3,528	1,488,352.34	0.20

	International			交易所				
36	Albemarle Corp	雅保公司	ALB US	美国纽约证券交易所	美国	1,496	1,487,253.59	0.20
37	Equinix Inc	Equinix 有限公司	EQIX US	纳斯达克证券交易所	美国	276	1,486,311.17	0.20
38	PPL Corp	PPL 公司	PPL US	美国纽约证券交易所	美国	6,033	1,485,014.36	0.20
39	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	766	1,481,370.49	0.20
40	Eli Lilly & Co	礼来	LLY US	美国纽约证券交易所	美国	196	1,480,527.31	0.20
41	Ameren Corp	Ameren 公司	AEE US	美国纽约证券交易所	美国	2,108	1,479,596.70	0.20
42	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	1,025	1,479,160.00	0.20
43	Visa Inc	维萨公司	V US	美国纽约证券交易所	美国	600	1,479,042.27	0.20
44	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	804	1,478,794.29	0.20
45	Aon PLC	怡安公共有限公司	AON US	美国纽约证券交易所	美国	595	1,475,792.15	0.20
46	Alexandria Real Estate	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	4,290	1,475,714.83	0.20

	e Equit ies Inc	司						
47	Charl es River Labor atori es Inter natio nal 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	1,052	1,475,014.49	0.20
48	TKO Group Holdi ngs 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	1,004	1,474,895.28	0.20
49	RTX Corp	RTX 公 司	RTX US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,144	1,474,709.72	0.20
50	W R Berkl ey Corp	WR Berkle y 公司	WRB US	美国纽 约证券 交易所	美国	2,992	1,474,635.49	0.20
51	JPMor gan Chase & Co	摩根大 通	JPM US	美国纽 约证券 交易所	美国	651	1,474,397.78	0.20
52	Waste Manag ement Inc	废品管 理	WM US	美国纽 约证券 交易所	美国	954	1,473,259.96	0.20
53	Phili p Morri s Inter natio nal 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	1,306	1,472,409.89	0.20
54	Amgen Inc	安进公 司	AMGN US	纳斯达 克证券	美国	640	1,472,381.78	0.20

				交易所				
55	Marriott International Inc/M D	万豪国际集团	MAR US	纳斯达克证券交易所	美国	675	1,471,915.07	0.20
56	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	729	1,471,867.62	0.20
57	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	1,131	1,471,545.42	0.20
58	Pinnacle West Capital Corp	Pinnacle 西部资本	PNW US	美国纽约证券交易所	美国	2,359	1,470,729.31	0.20
59	CenterPoint Energy Inc	中点能源	CNP US	美国纽约证券交易所	美国	5,457	1,470,575.24	0.20
60	Invitation Homes Inc	邀请家园公司	INVH US	美国纽约证券交易所	美国	7,528	1,470,446.89	0.20
61	Omnicom Group Inc	Omnicom 集团	OMC US	美国纽约证券交易所	美国	2,590	1,470,020.80	0.20
62	Wells Fargo & Co	富国银行	WFC US	美国纽约证券交易所	美国	2,244	1,470,008.86	0.20
63	Molina	Molina Health	MOH US	美国纽约证券交易所	美国	1,205	1,469,832.43	0.20

	Healthcare Inc	care 股份有限公司		交易所				
64	Mastercard Inc	万事达股份有限公司	MA US	美国纽约证券交易所	美国	366	1,468,612.09	0.20
65	Packaging Corp of America	美国包装公司	PKG US	美国纽约证券交易所	美国	1,013	1,468,393.57	0.20
66	CME Group Inc	芝加哥商业交易所	CME US	纳斯达克证券交易所	美国	765	1,468,359.90	0.20
67	Cigna Group /The	信诺集团	CI US	美国纽约证券交易所	美国	759	1,468,313.30	0.20
68	Arch Capital Group Ltd	阿契资本集团	ACGL US	纳斯达克证券交易所	美国	2,177	1,467,738.83	0.20
69	Target Corp	塔吉特公司	TGT US	美国纽约证券交易所	美国	2,136	1,467,571.27	0.20
70	Newmont Corp	纽蒙黄金公司	NEM US	美国纽约证券交易所	美国	2,091	1,467,517.50	0.20
71	SBA Communications Corp	SBA 通信公司	SBAC US	纳斯达克证券交易所	美国	1,079	1,466,987.67	0.20
72	Incyte Corp	因赛特公司	INCY US	纳斯达克证券交易所	美国	2,113	1,466,917.66	0.20
73	Baxter International Inc	百特	BAX US	美国纽约证券交易所	美国	10,917	1,466,375.46	0.20
74	Duke	杜克能	DUK US	美国纽	美国	1,779	1,465,621.41	0.20

	Energy Corp	源公司		约 证 券 交 易 所				
75	S&P Global Inc	标普全球	SPGI US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	399	1,465,599.06	0.20
76	Rollins Inc	Rollins 公司	ROL US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	3,473	1,465,149.56	0.20
77	Consolidated Edison Inc	联合爱迪生	ED US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	2,097	1,463,916.57	0.20
78	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	735	1,463,627.06	0.20
79	Loews Corp	罗斯公司	L US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,977	1,463,381.19	0.20
80	Dollar General Corp	达乐公司	DG US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,568	1,463,279.20	0.20
81	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	1,974	1,463,241.81	0.20
82	Federal Realty Investment Trust	联邦房地产投资信托公司	FRT US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	2,065	1,463,058.78	0.20
83	NiSource Inc	NiSource 公司	NI US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	4,983	1,462,623.55	0.20
84	Air Products and	空气产品公司	APD US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	842	1,461,926.02	0.20

	Chemicals Inc							
85	Lockheed Martin Corp	洛克希德马丁	LMT US	美国纽约证券交易所	美国	430	1,461,836.47	0.20
86	Travelers Cos Inc/The	旅行家集团	TRV US	美国纽约证券交易所	美国	717	1,461,800.76	0.20
87	Chubb Ltd	邱博保险集团	CB US	美国纽约证券交易所	美国	666	1,461,090.15	0.20
88	Charles Schwab Corp/The	嘉信理财	SCHW US	美国纽约证券交易所	美国	2,080	1,460,674.61	0.20
89	Verisk Analytics Inc	威瑞斯克分析公司	VRSK US	纳斯达克证券交易所	美国	929	1,460,640.94	0.20
90	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	2,586	1,459,571.09	0.20
91	American Electric Power Co Inc	美国电力公司	AEP US	纳斯达克证券交易所	美国	1,800	1,458,883.67	0.20
92	Adobe Inc	奥多比公司	ADBE US	纳斯达克证券交易所	美国	593	1,458,785.76	0.20
93	Erie	伊利赔	ERIE	纳斯达克	美国	724	1,458,719.20	0.20

	Indem nity Co	偿公司	US	克 证 券 交 易 所				
94	McKes son Corp	McKess on 公 司	MCK US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	253	1,458,710.55	0.20
95	IDEX Corp	艺达思 集团	IEX US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,166	1,458,321.65	0.20
96	McCor mick & Co Inc/M D	味好美 股份有 限公司 /马里 兰州	MKC US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,045	1,457,737.62	0.20
97	UDR Inc	UDR 公 司	UDR US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	5,654	1,457,693.84	0.20
98	Smurf it WestR ock 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	5,363	1,457,683.22	0.20
99	Take- Two Inter activ e Softw are Inc	Take-T wo 互 动软件 股份有 限公司	TTWO US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	810	1,457,662.77	0.20
100	Globe Life Inc	Globe Life 股份有 限公司	GL US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,482	1,456,877.09	0.20
101	Verte x Pharm aceut icals Inc	福泰制 药公司	VRTX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	457	1,456,265.58	0.20
102	Bank of Ameri ca	美国银 行公司	BAC US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,767	1,456,261.93	0.20

	Corp							
103	AES Corp/The	爱伊斯科公司	AES US	美国纽约证券交易所	美国	14,446	1,456,055.56	0.20
104	Exelon Corp	爱克斯龙公司	EXC US	纳斯达克证券交易所	美国	4,752	1,455,943.38	0.20
105	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	1,503	1,455,758.67	0.20
106	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	1,020	1,455,670.10	0.20
107	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	3,839	1,455,493.40	0.20
108	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	630	1,455,088.12	0.20
109	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	1,850	1,454,026.77	0.20
110	Regency Centers Corp	Regency Centers 公司	REG US	纳斯达克证券交易所	美国	2,995	1,453,168.20	0.20
111	General Motor	通用汽车公司	GM US	美国纽约证券交易所	美国	2,542	1,452,961.48	0.20

	s Co							
112	Equity Residential	公寓物业权益信托	EQR US	美国纽约证券交易所	美国	3,278	1,452,467.22	0.20
113	American International Group Inc	美国国际集团	AIG US	美国纽约证券交易所	美国	2,415	1,452,172.92	0.20
114	Textron Inc	德事隆	TXT US	美国纽约证券交易所	美国	2,370	1,452,100.18	0.20
115	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	411	1,452,073.82	0.20
116	Cardinal Health Inc	嘉德诺健康集团	CAH US	美国纽约证券交易所	美国	1,005	1,451,640.49	0.20
117	Southwest Airlines Co	西南航空	LUV US	美国纽约证券交易所	美国	4,996	1,451,339.52	0.20
118	Alliant Energy Corp	Alliant 能源公司	LNT US	纳斯达克证券交易所	美国	3,176	1,451,248.71	0.20
119	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	362	1,450,856.92	0.20
120	Avery Dennison Corp	艾利丹尼森	AVY US	美国纽约证券交易所	美国	1,134	1,449,703.50	0.20
121	PNC Financial Services Group Inc	PNC 金融服务	PNC US	美国纽约证券交易所	美国	988	1,449,515.97	0.20

	cial Servi ces Group Inc/T he			交易所				
122	Aflac Inc	家庭人 寿保险 公司	AFL US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,869	1,448,597.94	0.20
123	Kinde r Morga n Inc	特拉华 州金德 摩根公 司	KMI US	美国纽 约证券 交易所	美国	7,497	1,448,583.17	0.20
124	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	1,721	1,448,563.63	0.20
125	CMS Ener gy Corp	CMS 能 源	CMS US	美国纽 约证券 交易所	美国	2,946	1,448,029.66	0.20
126	eBay Inc	eBay 股份有 限公司	EBAY US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,365	1,447,873.06	0.20
127	Motor ola Solut ions 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	537	1,446,828.15	0.20
128	Honey well Inter natio nal Inc	霍尼韦 尔国际 公司	HON US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,055	1,446,667.26	0.20
129	South ern Co/Th e	南方公 司	SO US	美国纽 约证券 交易所	美国	2,358	1,445,244.99	0.19
130	Starb ucks	星巴克 公司	SBUX US	纳斯达 克证券	美国	2,441	1,444,816.30	0.19

	Corp			交易所				
131	Molson Coors Bever age Co	莫尔森 库尔斯 饮料公 司	TAP US	美国纽 约证 券交 易所	美国	4,402	1,444,315.50	0.19
132	Moder na Inc	莫德纳 公司	MRNA US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	6,967	1,444,114.97	0.19
133	Inter natio nal Flavo rs & Fragr ances Inc	国际香 料	IFF US	美国纽 约证 券交 易所	美国	3,048	1,443,748.70	0.19
134	Coca- Cola Co/Th e	可口可 乐	KO US	美国纽 约证 券交 易所	美国	2,937	1,443,193.07	0.19
135	Evers ource Ener gy	Evers ource 能源公 司	ES US	美国纽 约证 券交 易所	美国	3,049	1,442,936.52	0.19
136	Tyson Foods Inc	泰森食 品公司	TSN US	美国纽 约证 券交 易所	美国	3,501	1,442,510.92	0.19
137	Decke rs Outdo or Corp	德克斯 户外用 品公司	DECK US	美国纽 约证 券交 易所	美国	1,979	1,442,049.20	0.19
138	Colga te-Pa lmoli ve Co	高露洁 棕榄	CL US	美国纽 约证 券交 易所	美国	2,595	1,441,303.94	0.19
139	Bosto n Scien tific Corp	波士顿 科学	BSX US	美国纽 约证 券交 易所	美国	2,150	1,440,921.57	0.19
140	Brown &	Brown &	BRO US	美国纽 约证 券	美国	2,572	1,440,822.47	0.19

	Brown Inc	Brown 股份有限公司		交易所				
141	Yum! Brands Inc	百胜餐饮集团	YUM US	美国纽约证券交易所	美国	1,355	1,440,794.35	0.19
142	Block Inc	Block 股份有限公司	XYZ US	美国纽约证券交易所	美国	3,149	1,440,681.96	0.19
143	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	8,648	1,440,605.98	0.19
144	Ventas Inc	Ventas 公司	VTR US	美国纽约证券交易所	美国	2,648	1,440,216.86	0.19
145	Darden Restaurants Inc	达登餐饮公司	DRI US	美国纽约证券交易所	美国	1,113	1,439,598.47	0.19
146	Realty Income Corp	Realty Income 公司	O US	美国纽约证券交易所	美国	3,632	1,439,047.27	0.19
147	Live Nation Entertainment Inc	Live Nation 娱乐公司	LYV US	美国纽约证券交易所	美国	1,436	1,438,303.34	0.19
148	L3Harris Technologies Inc	L3Harris Technologies 股份有限公司	LHX US	美国纽约证券交易所	美国	697	1,438,221.04	0.19
149	Allstate Corp/The	好事达保险公司	ALL US	美国纽约证券交易所	美国	983	1,438,172.96	0.19
150	CBRE Group	世邦魏理仕	CBRE US	美国纽约证券交易所	美国	1,272	1,437,564.48	0.19

	Inc			交易所				
151	Atmos Energy Corp	Atmos 能源公司	ATO US	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,220	1,437,450.05	0.19
152	Franklin Resources Inc	富兰克林资源	BEN US	美国 纽约 证券 交易所	美国	8,552	1,436,035.01	0.19
153	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	328	1,435,509.26	0.19
154	Procter & Gamble Co/Ther	宝洁	PG US	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,425	1,435,398.69	0.19
155	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	3,483	1,434,359.98	0.19
156	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	437	1,434,000.45	0.19
157	Snap-on Inc	实耐宝	SNA US	美国 纽约 证券 交易所	美国	592	1,433,897.69	0.19
158	Northern Trust Corp	北美信托	NTRS US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	1,493	1,433,375.24	0.19
159	WW Grain Processing Inc	固安捷股份有限公司	GWW US	美国 纽约 证券 交易所	美国	202	1,432,666.95	0.19
160	Weyerhaeuser	惠好	WY US	美国 纽约 证 券	美国	8,603	1,432,505.08	0.19

	er Co			交易所				
161	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	1,131	1,432,036.04	0.19
162	Cincinnati Financial Corp	辛辛那提金融	CINF US	纳斯达克证券交易所	美国	1,247	1,431,485.69	0.19
163	Henry Schein Inc	亨利香恩公司	HSIC US	纳斯达克证券交易所	美国	2,693	1,430,620.44	0.19
164	Booking Holdings Inc	缤客控股公司	BKNG US	纳斯达克证券交易所	美国	38	1,430,378.65	0.19
165	TransDigm Group Inc	TransDigm 集团公司	TDG US	美国纽约证券交易所	美国	153	1,430,129.20	0.19
166	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	1,559	1,430,005.85	0.19
167	PPG Industries Inc	PPG 工业	PPG US	美国纽约证券交易所	美国	1,985	1,429,539.13	0.19
168	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	2,753	1,429,212.15	0.19
169	Veralto Corp	Veralto 公司	VLTO US	美国纽约证券交易所	美国	2,037	1,428,616.67	0.19
170	Abbott Laboratories	雅培制药公司	ABT US	美国纽约证券交易所	美国	1,622	1,428,395.41	0.19
171	Sandi	闪迪公	SNDK	纳斯达克	美国	856	1,428,233.04	0.19

	sk Corp/DE	司/特拉华州	US	克 证 券 交 易 所				
172	Ecolab Inc	艺康集团	ECL US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	774	1,428,185.25	0.19
173	Capital One Financial Corp	第一资本金融	COF US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	838	1,427,532.97	0.19
174	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	1,120	1,427,318.74	0.19
175	AT&T Inc	美国电话电报公司	T US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	8,173	1,426,968.14	0.19
176	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	2,925	1,426,811.26	0.19
177	Intercontinental Exchange Inc	洲际交易所 (ICE)	ICE US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,253	1,426,395.71	0.19
178	Amcor PLC	安姆科公共有限公司	AMCR US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	24,312	1,425,174.11	0.19
179	Intuitive Surgical Inc	直觉外科手术公司	ISRG US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	358	1,425,137.56	0.19
180	Nordson Corp	诺信公司	NDSN US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	843	1,424,614.69	0.19
181	Lam Research	泛林集团	LRCX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,184	1,424,576.94	0.19

	Corp							
182	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	2,620	1,424,251.37	0.19
183	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	578	1,424,160.70	0.19
184	Jack Henry & Associates Inc	Jack Henry & Associates 公司	JKHY US	纳斯达克证券交易所	美国	1,110	1,423,703.12	0.19
185	FedEx Corp	联邦快递	FDX US	美国纽约证券交易所	美国	701	1,423,267.76	0.19
186	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	2,375	1,423,112.35	0.19
187	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	1,259	1,422,606.91	0.19
188	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	2,469	1,422,342.63	0.19
189	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	396	1,421,568.33	0.19
190	Verizon	Verizon 通信	VZ US	美国纽约证券交易所	美国	4,965	1,421,395.21	0.19

	Communications Inc	股份有限公司		交易所				
191	AbbVie Inc	艾伯维股份有限公司	ABBV US	美国纽约证券交易所	美国	885	1,421,319.30	0.19
192	Mosaic Co/Theme	Mosaic 公司	MOS US	美国纽约证券交易所	美国	8,394	1,421,303.91	0.19
193	NVIDIA Corp	英伟达公司	NVDA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,084	1,420,984.38	0.19
194	Dover Corp	都福	DOV US	美国纽约证券交易所	美国	1,035	1,420,333.51	0.19
195	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	306	1,419,730.02	0.19
196	VICI Properties Inc	VICI Properties 股份有限公司	VICI US	美国纽约证券交易所	美国	7,181	1,419,323.62	0.19
197	Allegion plc	安朗杰公共有限公司	ALLE US	美国纽约证券交易所	美国	1,267	1,417,932.05	0.19
198	UnitedHealth Group Inc	联合健康集团	UNH US	美国纽约证券交易所	美国	611	1,417,689.35	0.19
199	Kenvue Inc	科赴股份有限公司	KVUE US	美国纽约证券交易所	美国	11,691	1,417,496.34	0.19
200	Hershey Co/Theme	好时公司	HSY US	美国纽约证券交易所	美国	1,108	1,417,243.93	0.19
201	Corteva Inc	科迪华公司	CTVA US	美国纽约证券交易所	美国	3,008	1,417,190.52	0.19

202	Cintas Corp	信达思公司	CTAS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,072	1,417,083.68	0.19
203	Netflix Inc	奈飞公司	NFLX US	纳斯达克证券交易所	美国	2,150	1,416,893.62	0.19
204	Gilead Sciences Inc	吉利德科学公司	GILD US	纳斯达克证券交易所	美国	1,642	1,416,577.89	0.19
205	IQVIA Holdings Inc	艾昆纬	IQV US	美国纽约证券交易所	美国	894	1,416,419.46	0.19
206	Marsh & McLennan Cos Inc	Marsh & McLennan 股份有限公司	MMC US	美国纽约证券交易所	美国	1,086	1,416,125.51	0.19
207	Johnson & Johnson	强生	JNJ US	美国纽约证券交易所	美国	973	1,415,335.69	0.19
208	American Express Co	美国运通	AXP US	美国纽约证券交易所	美国	544	1,414,565.68	0.19
209	Kroger Co/Ther	克罗格公司	KR US	美国纽约证券交易所	美国	3,221	1,414,532.50	0.19
210	Akamai Technologies Inc	阿卡迈技术公司	AKAM US	纳斯达克证券交易所	美国	2,306	1,414,184.02	0.19
211	Microsoft Corp	微软公司	MSFT US	纳斯达克证券交易所	美国	416	1,414,095.59	0.19
212	Fiserv Inc	Fiserv 股份有限公司	FISV US	纳斯达克证券交易所	美国	2,994	1,413,540.74	0.19

213	Thermo Fisher Scientific Inc	Thermo Fisher Scientific 公司	TMO US	美国 纽约 证券 交易所	美国	347	1,413,274.84	0.19
214	First Energy Corp	第一能源	FE US	美国 纽约 证券 交易所	美国	4,490	1,412,910.40	0.19
215	Cencora Inc	Cencora 股份有限公司	COR US	美国 纽约 证券 交易所	美国	595	1,412,516.43	0.19
216	Norfolk Southern Corp	诺福克南方	NSC US	美国 纽约 证券 交易所	美国	696	1,412,431.17	0.19
217	Equifax Inc	Equifax 股份有限公司	EFX US	美国 纽约 证券 交易所	美国	926	1,412,250.96	0.19
218	Cboe Global Markets Inc	Cboe 环球市场公司	CBOE US	巴 兹 全 球 市场	美国	800	1,411,383.04	0.19
219	Fortive Corp	福迪威公司	FTV US	美国 纽约 证券 交易所	美国	3,637	1,411,374.39	0.19
220	General Mills Inc	通用磨坊	GIS US	美国 纽约 证券 交易所	美国	4,318	1,411,291.67	0.19
221	International Paper Co	国际纸业	IP US	美国 纽约 证券 交易所	美国	5,096	1,410,901.15	0.19
222	Gen Digital Inc	Gen Digital 股份有限公司	GEN US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	7,382	1,410,796.70	0.19

		司						
223	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	1,667	1,410,024.94	0.19
224	Chevron Corp	雪佛龙	CVX US	美国纽约证券交易所	美国	1,316	1,409,777.38	0.19
225	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	691	1,409,424.04	0.19
226	Bunge Global SA	-	BG US	美国纽约证券交易所	美国	2,251	1,409,408.51	0.19
227	KeyCorp	KeyCorp 公司	KEY US	美国纽约证券交易所	美国	9,715	1,409,398.11	0.19
228	Ford Motor Co	福特汽车	F US	美国纽约证券交易所	美国	15,272	1,408,351.10	0.19
229	Targa Resources Corp	Targa 资源公司	TRGP US	美国纽约证券交易所	美国	1,086	1,408,339.57	0.19
230	Union Pacific Corp	联合太平洋	UNP US	美国纽约证券交易所	美国	866	1,408,031.15	0.19
231	Roper Technologies Inc	儒博技术公司	ROP US	纳斯达克证券交易所	美国	450	1,407,928.38	0.19
232	CVS Health Corp	CVS 健康公司	CVS US	美国纽约证券交易所	美国	2,524	1,407,901.25	0.19
233	Republic Services Inc	公共服务公司	RSG US	美国纽约证券交易所	美国	945	1,407,684.84	0.19
234	Ulta Beaut	Ulta 美容产	ULTA US	纳斯达克证券交易所	美国	331	1,407,575.61	0.19

	y Inc	品公司		交易所				
235	Electronic Arts Inc	艺电公司	EA US	纳斯达克证券交易所	美国	979	1,406,034.62	0.19
236	Prudential Financial Inc	保德信金融集团	PRU US	美国纽约证券交易所	美国	1,772	1,405,924.19	0.19
237	McDonald's Corp	麦当劳	MCD US	美国纽约证券交易所	美国	654	1,404,930.74	0.19
238	Salesforce Inc	Salesforce 股份有限公司	CRM US	美国纽约证券交易所	美国	754	1,403,947.55	0.19
239	VeriSign Inc	威瑞信股份有限公司	VRSN US	纳斯达克证券交易所	美国	822	1,403,685.80	0.19
240	Dominick's Pizza Inc	达美乐披萨公司	DPZ US	纳斯达克证券交易所	美国	479	1,403,347.58	0.19
241	Progressive Corp/The	前进保险公司	PGR US	美国纽约证券交易所	美国	876	1,402,124.14	0.19
242	State Street Corp	道富集团	STT US	美国纽约证券交易所	美国	1,546	1,401,890.36	0.19
243	Masco Corp	马斯可	MAS US	美国纽约证券交易所	美国	3,142	1,401,481.71	0.19
244	Dayforce Inc	Dayforce 股份有限公司	DAY US	美国纽约证券交易所	美国	2,883	1,401,460.34	0.19
245	Citizens Financial Group	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	3,410	1,399,983.03	0.19

	Inc							
246	A O Smith Corp	AO 史密斯公司	AOS US	美国纽约证券交易所	美国	2,978	1,399,916.54	0.19
247	MetLife Inc	大都会集团	MET US	美国纽约证券交易所	美国	2,523	1,399,895.31	0.19
248	Copart Inc	科帕特公司	CPRT US	纳斯达克证券交易所	美国	5,087	1,399,828.04	0.19
249	Mondelez International Inc	亿滋国际公司	MDLZ US	纳斯达克证券交易所	美国	3,699	1,399,554.76	0.19
250	Archer-Daniels-Midland Co	Archer-Daniels-Midland 公司	ADM US	美国纽约证券交易所	美国	3,462	1,398,944.73	0.19
251	Hasbro Inc	孩之宝	HAS US	纳斯达克证券交易所	美国	2,426	1,398,253.24	0.19
252	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	2,993	1,398,132.21	0.19
253	Walmart Inc	沃尔玛股份有限公司	WMT US	美国纽约证券交易所	美国	1,785	1,397,795.32	0.19
254	CRH PLC	CRH 公共股份公司	CRH US	美国纽约证券交易所	美国	1,593	1,397,370.42	0.19
255	Deere & Co	迪尔	DE US	美国纽约证券交易所	美国	427	1,397,314.12	0.19
256	Cogni	高知特	CTSH	纳斯达克	美国	2,395	1,397,220.01	0.19

	zant Techn ology Solut ions Corp	科技解 决方案 公司	US	克 证 券 交 易 所				
257	Axon Enter prise Inc	Axon Enterp rise 股份有 限公司	AXON US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	350	1,397,153.23	0.19
258	Intui t Inc	财捷集 团	INTU US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	300	1,396,805.31	0.19
259	Old Domin ion Freig ht Line Inc	奥多明 尼昂货 运	ODFL US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,267	1,396,380.77	0.19
260	Wynn Resor ts Ltd	永利渡 假村有 限公司	WYNN US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,651	1,396,375.36	0.19
261	US Banco rp	美国合 众银行	USB US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,722	1,395,961.29	0.19
262	ONEOK Inc	Oneok 股份有 限公司	OKE US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,702	1,395,898.59	0.19
263	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	760	1,395,461.40	0.19
264	Amazo n.com Inc	亚马逊 公司	AMZN US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	860	1,395,253.35	0.19
265	Holog ic Inc	豪洛捷 公司	HOLX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,664	1,394,804.63	0.19
266	Unite d Parce l Servi	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	2,000	1,394,373.34	0.19

	ce Inc							
267	Tyler Technologies Inc	Tyler 科技公司	TYL US	美国 纽约 证券交易所	美国	437	1,394,346.28	0.19
268	Sysco Corp	Sysco 公司	SYU US	美国 纽约 证券交易所	美国	2,692	1,394,327.52	0.19
269	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	11,184	1,393,757.06	0.19
270	United Rentals Inc	联合租 赁公司	URI US	美国 纽约 证券交易所	美国	245	1,393,694.36	0.19
271	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	805	1,393,610.72	0.19
272	Otis Worldwide Corp	奥的斯 电梯公 司	OTIS US	美国 纽约 证券交易所	美国	2,269	1,393,088.13	0.19
273	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	690	1,392,980.24	0.19
274	Paychex Inc	沛齐公 司	PAYX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,766	1,392,474.72	0.19
275	Williams Cos Inc/The	威廉姆 斯公司	WMB US	美国 纽约 证券交易所	美国	3,295	1,392,141.35	0.19
276	Ralph Lauren Corp	拉夫劳 伦	RL US	美国 纽约 证券交易所	美国	560	1,391,854.22	0.19
277	Danaher	丹纳赫	DHR US	美国 纽约 证 券	美国	865	1,391,813.46	0.19

	Corp			交易所				
278	Truist Financial Corp	Truist 金融公司	TFC US	美国纽约证券交易所	美国	4,022	1,391,158.51	0.19
279	Stryker Corp	史赛克	SYK US	美国纽约证券交易所	美国	563	1,390,842.15	0.19
280	Nucor Corp	纽柯公司	NUE US	美国纽约证券交易所	美国	1,213	1,390,665.16	0.19
281	DTE Energy Co	DTE 能源公司	DTE US	美国纽约证券交易所	美国	1,533	1,389,778.90	0.19
282	Jacobus 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	1,492	1,389,103.99	0.19
283	Sempra	-	SRE US	美国纽约证券交易所	美国	2,238	1,388,841.82	0.19
284	PTC Inc	PTC 公司	PTC US	纳斯达克证券交易所	美国	1,134	1,388,568.54	0.19
285	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	768	1,388,558.00	0.19
286	CoStar Group Inc	科斯塔集团	CSGP US	纳斯达克证券交易所	美国	2,937	1,388,074.70	0.19
287	Jabil Inc	捷普集团	JBL US	美国纽约证券交易所	美国	866	1,387,944.24	0.19
288	Biogen Inc	渤健公司	BIIB US	纳斯达克证券交易所	美国	1,122	1,387,912.33	0.19
289	Entergy	Entergy 公司	ETR US	美国纽约证券交易所	美国	2,136	1,387,699.36	0.19

	Corp			交易所				
290	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	1,506	1,387,001.40	0.19
291	Regions Financial Corp	Regions 金融 公司	RF US	美国 纽约 证券 交易所	美国	7,281	1,386,888.37	0.19
292	Carrier Global Corp	开利全 球公司	CARR US	美国 纽约 证券 交易所	美国	3,733	1,386,442.89	0.19
293	BXP Inc	波士顿 地产公 司	BXP US	美国 纽约 证券 交易所	美国	2,923	1,386,388.91	0.19
294	Pentair PLC	Pentair 公共 有限公司	PNR US	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,894	1,386,368.67	0.19
295	Steel Dynamics Inc	Steel Dynamics 股 份有限 公司	STLD US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,164	1,386,359.11	0.19
296	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	西屋制 动公司	WAB US	美国 纽约 证券 交易所	美国	924	1,386,274.76	0.19
297	Hubbell Inc	哈贝尔 公司	HUBB US	美国 纽约 证券 交易所	美国	444	1,385,972.80	0.19
298	Campbell's Company/The	金宝汤 公司	CPB US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	7,074	1,385,744.65	0.19
299	Autodesk	欧特克	ADSK	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	666	1,385,676.33	0.19

	esk Inc	公司	US	克 证 券 交 易 所				
300	T Rowe Price Group Inc	普徠仕	TROW US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,925	1,385,246.45	0.19
301	F5 Inc	F5 股 份 有 限 公 司	FFIV US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	772	1,385,100.39	0.19
302	Tesla Inc	特 斯 拉 公 司	TSLA US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	438	1,384,514.47	0.19
303	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	11,353	1,384,494.72	0.19
304	Blackrock Inc	贝莱德股份有限公司	BLK US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	184	1,384,269.87	0.19
305	NextEra Energy Inc	新纪元能源公司	NEE US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,453	1,384,159.37	0.19
306	Goldman Sachs Group Inc/The	高盛	GS US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	224	1,383,942.60	0.19
307	Parke-Hanfin Corp	派克汉尼汾公司	PH US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	224	1,383,879.63	0.19
308	Morgan Stanley	摩根士丹利	MS US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,109	1,383,835.56	0.19
309	AutoZone Inc	AutoZone 股 份 有 限 公 司	AZO US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	58	1,382,614.16	0.19
310	Synch	同步金	SYF US	美 国 纽	美国	2,357	1,382,174.93	0.19

	rony Finan cial	融公司		约 证 券 交 易 所				
311	TJX Cos Inc/T he	TJX 公 司	TJX US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,280	1,382,008.28	0.19
312	Everg y Inc	Evergy 股份有 限公司	EVRG US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,712	1,381,812.03	0.19
313	Mettl er-To ledo Inter natio nal 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	141	1,381,727.06	0.19
314	Kraft Heinz Co/Th e	卡夫亨 氏公司	KHC US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	8,102	1,380,972.94	0.19
315	Globa l Payme nts Inc	环汇有 限公司	GPN US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	2,538	1,380,745.91	0.19
316	Quest Diagno stic s Inc	Quest Diagno stics 股份有 限公司	DGX US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,132	1,380,709.08	0.19
317	Accen ture PLC	埃森哲 公司	ACN US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	732	1,380,425.39	0.19
318	Pfize r Inc	辉瑞制 药公司	PFE US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	7,887	1,380,360.03	0.19
319	Synop sys Inc	新思科 技公司	SNPS US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	418	1,380,055.40	0.19
320	Kimco Realt y Corp	-	KIM US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	9,683	1,379,573.57	0.19
321	Exped	华盛顿	EXPD	美 国 纽	美 国	1,317	1,379,375.08	0.19

	itors Inter natio nal of Washi ngton Inc	康捷国 际物流 公司	US	约 证 券 交 易 所				
322	M&T Bank Corp	M&T 银 行	MTB US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	974	1,379,342.40	0.19
323	Fifth Third Banco rp	五三银 行	FITB US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	4,192	1,379,243.99	0.19
324	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	1,273	1,379,192.68	0.19
325	Ameri prise Finan cial Inc	阿默普 莱斯金 融公司	AMP US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	400	1,378,600.72	0.19
326	Prolo gis Inc	安博	PLD US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,536	1,378,247.59	0.19
327	Cloro x Co/Th e	高乐氏 公司	CLX US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,944	1,377,739.83	0.19
328	Xylem Inc/N Y	赛莱默 公司	XYL US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,439	1,377,384.87	0.19
329	Gener al Dynam ics Corp	通用动 力	GD US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	582	1,377,195.80	0.19
330	ON Semic onduc tor Corp	安森美 半导体	ON US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	3,618	1,377,045.24	0.19
331	Altri	高特利	MO US	美 国 纽	美国	3,396	1,376,332.94	0.19

	a Group Inc			约 证 券 交 易 所				
332	Dexcom Inc	德康医疗	DXCM US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,950	1,376,179.30	0.19
333	Sherwin-Williams Co/The	宣伟公司	SHW US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	604	1,375,635.41	0.19
334	DuPont de Nemours Inc	杜邦公司	DD US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	4,867	1,375,208.62	0.19
335	American Tower Corp	美国发射塔公司	AMT US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,114	1,374,727.71	0.19
336	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	5,359	1,374,481.21	0.19
337	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	1,006	1,374,172.85	0.19
338	Bank of New York Mellon Corp/The	纽约梅隆银行	BK US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,684	1,374,099.19	0.19
339	Dollar Tree Inc	美元树公司	DLTR US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,589	1,373,869.56	0.19
340	Faste	法思诺	FAST	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	4,870	1,373,660.17	0.19

	nal Co	公司	US	克 证 券 交 易 所				
341	Crown Castl e Inc	冠城股 份有限 公司	CCI US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,199	1,373,604.15	0.19
342	Lowe' s Cos Inc	劳氏	LOW US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	810	1,373,002.98	0.19
343	STERI S 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	770	1,372,094.86	0.18
344	Stanl ey Black & Decke r Inc	史丹利 百得公 司	SWK US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,628	1,372,076.87	0.18
345	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	2,999	1,372,056.27	0.18
346	Home Depot Inc/The	家得宝	HD US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	567	1,371,351.92	0.18
347	Chart er Commu nicat ions Inc	特许通 讯公司	CHTR US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	934	1,370,422.71	0.18
348	Inger soll 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	2,461	1,370,337.80	0.18
349	Kimbe rly-C lark Corp	金佰利	KMB US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,932	1,370,050.04	0.18
350	Unive rsal Healt h	Univer sal 保 健服务 股份有	UHS US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	894	1,369,982.56	0.18

	Servi ces Inc	限公司						
351	Princ ipal Finan cial Group Inc	信安金 融	PFG US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,209	1,369,603.08	0.18
352	Becto n Dicki nson & Co	碧迪	BDX US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,004	1,369,535.53	0.18
353	CSX Corp	CSX 公 司	CSX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	5,375	1,369,517.75	0.18
354	Vistr a Corp	Vistra 公司	VST US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,207	1,368,685.26	0.18
355	Churc h & Dwigh t 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	2,321	1,367,915.89	0.18
356	Estee Lauder Cos Inc/The	雅诗兰 黛	EL US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,858	1,367,591.93	0.18
357	Warne r Bros Disco very 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	6,751	1,367,550.18	0.18
358	Inves co Ltd	景顺有 限公司	IVZ US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	7,402	1,366,753.96	0.18
359	Fair Isaac Corp	费埃哲 公司	FICO US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	115	1,366,548.43	0.18
360	KLA Corp	科磊公 司	KLAC US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	160	1,366,488.69	0.18

361	Apple Inc	苹果公司	AAPL US	纳斯达克证券交易所	美国	715	1,366,257.44	0.18
362	Constellation Energy Corp	美国联合能源公司	CEG US	纳斯达克证券交易所	美国	550	1,365,685.30	0.18
363	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	499	1,365,068.87	0.18
364	Amphe nol Corp	安费诺公司	APH US	美国纽约证券交易所	美国	1,437	1,364,966.11	0.18
365	Coterra Energy Inc	Coterra 能源股份有限公司	CTRA US	美国纽约证券交易所	美国	7,378	1,364,915.36	0.18
366	O'Reilly Automotive Inc	奥莱利汽车公司	ORLY US	纳斯达克证券交易所	美国	2,129	1,364,895.19	0.18
367	Humana Inc	Humana 股份有限公司	HUM US	美国纽约证券交易所	美国	758	1,364,617.20	0.18
368	Public Storage	公共存储	PSA US	美国纽约证券交易所	美国	748	1,364,332.25	0.18
369	Costco Wholesale Corp	开市客	COST US	纳斯达克证券交易所	美国	225	1,363,773.46	0.18
370	Halliburton Co	哈利伯顿	HAL US	美国纽约证券交易所	美国	6,865	1,363,621.64	0.18
371	Fortinet Inc	飞塔信息	FTNT US	纳斯达克证券交易所	美国	2,443	1,363,577.57	0.18
372	Cummins Inc	康明斯	CMI US	美国纽约证券交易所	美国	380	1,363,383.36	0.18

				交易所				
373	Paycom Software Inc	Paycom 软件股份有限公司	PAYC US	美国纽约证券交易所	美国	1,217	1,363,173.34	0.18
374	EMCOR Group Inc	埃姆科集团公司	EME US	美国纽约证券交易所	美国	317	1,363,147.41	0.18
375	Extra Space Storage Inc	Extra Space Storage 有限公司	EXR US	美国纽约证券交易所	美国	1,489	1,362,867.31	0.18
376	Welltower Inc	沃尔塔公司	WELL US	美国纽约证券交易所	美国	1,043	1,360,714.04	0.18
377	GE HealthCare Technologies Inc	GE 医疗技术公司	GEHC US	纳斯达克证券交易所	美国	2,360	1,360,545.14	0.18
378	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	1,337	1,360,382.91	0.18
379	Healthpeak Properties Inc	-	DOC US	美国纽约证券交易所	美国	12,030	1,359,667.94	0.18
380	Iron Mountain Inc	美国铁山公司	IRM US	美国纽约证券交易所	美国	2,331	1,359,063.82	0.18
381	Aptiv PLC	安波福公共有限公司	APTV US	美国纽约证券交易所	美国	2,538	1,357,376.69	0.18
382	Emerson	艾默生电气	EMR US	美国纽约证券交易所	美国	1,455	1,357,314.70	0.18

	Elect ric Co			交易所				
383	Conag ra Brand s 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	11,154	1,357,090.76	0.18
384	NIKE Inc	耐克公 司	NKE US	美国纽 约证券 交易所	美国	3,030	1,356,848.69	0.18
385	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	5,083	1,356,211.74	0.18
386	Solve ntum Corp	索尔文 图姆公 司	SOLV US	美国纽 约证券 交易所	美国	2,434	1,355,645.78	0.18
387	EPAM Syste ms Inc	EPAM 系统公 司	EPAM US	美国纽 约证券 交易所	美国	941	1,355,096.97	0.18
388	Advan ced Micro Devic es Inc	AMD 公 司	AMD US	纳斯达 克证券 交易所	美国	900	1,354,759.03	0.18
389	Conoc oPhil lips	康菲石 油	COP US	美国纽 约证券 交易所	美国	2,059	1,354,751.93	0.18
390	Bio-T echn e Corp	Bio-te chne 公司	TECH US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,277	1,354,592.94	0.18
391	GoDad dy Inc	GoDadd y 股份 有限公司	GDDY US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,553	1,354,423.33	0.18
392	3M Co	3M 公 司	MMM US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,203	1,353,748.99	0.18
393	Broad ridge Finan cial Solut ions 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	863	1,353,716.73	0.18

394	PACCA R Inc	帕卡公 司	PCAR US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,756	1,351,635.15	0.18
395	Corpa y Inc	Corpay 股份有 限公司	CPAY US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	639	1,351,597.96	0.18
396	Inter activ e Brok ers Group Inc	盈透证 券集团 股份有 限公司	IBKR US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,990	1,351,546.16	0.18
397	ResMe d Inc	瑞思迈 股份有 限公司	RMD US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	798	1,351,035.59	0.18
398	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	284	1,350,475.11	0.18
399	Workda y Inc	Workda y 股份 有限公 司	WDAY US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	894	1,349,623.22	0.18
400	PayPa l Holdi ngs Inc	贝宝	PYPL US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	3,289	1,349,612.68	0.18
401	Analo g Devic es Inc	亚德诺 半导体 公司	ADI US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	708	1,349,597.08	0.18
402	Digit al Realt y 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	1,241	1,349,495.23	0.18
403	J M Smuck er Co/Th e	JM 斯 马克公 司	SJM US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,962	1,348,849.35	0.18

404	Insulet Corp	Insulet 股份有限公司	PODD US	纳斯达克证券交易所	美国	675	1,348,559.63	0.18
405	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	1,194	1,347,733.46	0.18
406	Occidental Petroleum Corp	西方石油	OXY US	美国纽约证券交易所	美国	4,663	1,347,720.11	0.18
407	SLB Ltd	斯伦贝谢有限公司	SLB US	美国纽约证券交易所	美国	4,992	1,346,668.60	0.18
408	Vulcan Materials Co	Vulcan 材料	VMC US	美国纽约证券交易所	美国	671	1,345,190.16	0.18
409	Cisco Systems Inc	思科公司	CSCO US	纳斯达克证券交易所	美国	2,484	1,344,908.30	0.18
410	Waters Corp	沃特世公司	WAT US	美国纽约证券交易所	美国	503	1,342,883.80	0.18
411	Pepsi Co Inc	百事公司	PEP US	纳斯达克证券交易所	美国	1,331	1,342,677.36	0.18
412	Leidos Holdings Inc	Leidos 控股公司	LDOS US	美国纽约证券交易所	美国	1,058	1,341,539.26	0.18
413	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	4,407	1,341,257.41	0.18
414	AppLo	AppLov	APP US	纳斯达克	美国	283	1,340,329.32	0.18

	vin Corp	in 公司		克 证券交易所				
415	Labcorp Holdings Inc	Labcorp 控股有限公司	LH US	美国 纽约 证券交易所	美国	760	1,340,172.86	0.18
416	Genuine Parts Co	原配部件	GPC US	美国 纽约 证券交易所	美国	1,548	1,337,876.41	0.18
417	Texas Instruments Inc	德州仪器公司	TXN US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	1,097	1,337,710.88	0.18
418	Palo Alto Networks Inc	派拓网络公司	PANW US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	1,033	1,337,430.22	0.18
419	Williams-Sonoma Inc	Williams-Sonoma 股份有限公司	WSM US	美国 纽约 证券交易所	美国	1,065	1,336,866.16	0.18
420	Keyight Technologies Inc	是德科技公司	KEYS US	美国 纽约 证券交易所	美国	936	1,336,778.23	0.18
421	Devon Energy Corp	戴文能源	DVN US	美国 纽约 证券交易所	美国	5,190	1,336,243.06	0.18
422	Medtronic PLC	美敦力	MDT US	美国 纽约 证券交易所	美国	1,978	1,335,518.95	0.18
423	DoorDash Inc	DoorDash 股份有限公司	DASH US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	838	1,333,997.64	0.18
424	Zimmer Biomet	捷迈邦美控股有限公司	ZBH US	美国 纽约 证券交易所	美国	2,110	1,333,582.66	0.18

	Holdings Inc							
425	NVR Inc	NVR 股份有限公司	NVR US	美国纽约证券交易所	美国	26	1,332,744.97	0.18
426	Hewlett Packard Enterprise Co	慧与公司	HPE US	美国纽约证券交易所	美国	7,892	1,332,420.38	0.18
427	Dow Inc	陶氏公司	DOW US	美国纽约证券交易所	美国	8,107	1,332,250.42	0.18
428	Pool Corp	Pool 公司	POOL US	纳斯达克证券交易所	美国	828	1,331,289.86	0.18
429	Trimble Inc	天宝股份有限公司	TRMB US	纳斯达克证券交易所	美国	2,417	1,331,057.56	0.18
430	Teradyne Inc	泰瑞达	TER US	纳斯达克证券交易所	美国	977	1,329,203.15	0.18
431	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	1,211	1,329,129.56	0.18
432	Keurig Dr Pepper Inc	克里格胡椒博士	KDP US	纳斯达克证券交易所	美国	6,751	1,329,114.52	0.18
433	Agilent Technologies Inc	安捷伦	A US	美国纽约证券交易所	美国	1,389	1,328,451.85	0.18
434	Baker Hughes Co	贝克休斯公司	BKR US	纳斯达克证券交易所	美国	4,149	1,328,059.85	0.18
435	Qnity Electronic	启诺迪电子股份有限	Q US	美国纽约证券交易所	美国	2,312	1,326,860.31	0.18

	s Inc	公司						
436	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	1,185	1,326,330.34	0.18
437	Rockwell Automation Inc	罗克韦尔自动化	ROK US	美国纽约证券交易所	美国	485	1,326,327.18	0.18
438	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	637	1,326,234.54	0.18
439	Western Digital Corp	西部数据公司	WDC US	纳斯达克证券交易所	美国	1,095	1,325,882.26	0.18
440	Expanded Energy Corp	Expand 能源公司	EXE US	纳斯达克证券交易所	美国	1,708	1,324,892.81	0.18
441	EOG Resources Inc	EOG 资源	EOG US	美国纽约证券交易所	美国	1,795	1,324,879.25	0.18
442	Palantir Technologies Inc	帕兰提尔技术公司	PLTR US	纳斯达克证券交易所	美国	1,060	1,324,331.35	0.18
443	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	386	1,317,435.26	0.18
444	NXP Semic	恩智浦半导体	NXPI US	纳斯达克证券交易所	美国	863	1,316,654.36	0.18

	conductors NV	公司		交易所				
445	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	2,292	1,316,348.88	0.18
446	Builders FirstSource Inc	Builders FirstSource 股份有限公司	BLDR US	美国纽约证券交易所	美国	1,819	1,315,488.49	0.18
447	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM US	纳斯达克证券交易所	美国	1,094	1,315,290.21	0.18
448	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	2,936	1,314,961.40	0.18
449	Pulte Group Inc	Pulte 集团公司	PHM US	美国纽约证券交易所	美国	1,594	1,313,770.16	0.18
450	Diamondback Energy Inc	戴蒙德巴克能源	FANG US	纳斯达克证券交易所	美国	1,243	1,313,402.90	0.18
451	EQT Corp	EQT 公司	EQT US	美国纽约证券交易所	美国	3,482	1,311,821.49	0.18
452	Revvity Inc	Revvity 股份有限公司	RVTY US	美国纽约证券交易所	美国	1,926	1,309,750.11	0.18
453	Applied Materials Inc	应用材料公司	AMAT US	纳斯达克证券交易所	美国	724	1,307,783.87	0.18
454	Skyworks Solutions	思佳讯解决方案公司	SWKS US	纳斯达克证券交易所	美国	2,934	1,307,672.67	0.18

	ions Inc							
455	TE Conne ctivi ty PLC	TE Conne ctivi ty 公 共有限 公司	TEL US	美国纽 约证券 交易所	美国	816	1,304,883.79	0.18
456	Garmi n Ltd	佳明有 限公司	GRMN US	美国纽 约证券 交易所	美国	915	1,304,599.75	0.18
457	DaVit a Inc	DaVita 股份有 限公司	DVA US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,632	1,303,220.49	0.18
458	Corni ng Inc	康宁公 司	GLW US	美国纽 约证券 交易所	美国	2,116	1,302,274.70	0.18
459	APA Corp	-	APA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	7,574	1,302,155.77	0.18
460	Const ellation Brand s Inc	星座品 牌股份 有限公司	STZ US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,342	1,301,328.34	0.18
461	Cater pilla r Inc	卡特彼 勒公司	CAT US	美国纽 约证券 交易所	美国	323	1,300,588.14	0.18
462	DR Horto n Inc	霍顿房 屋公司	DHI US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,283	1,298,855.40	0.18
463	Tract or Suppl y Co	拖拉机 供应公 司	TSCO US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,694	1,298,479.00	0.18
464	Valer o Ener gy Corp	Valero 能源	VLO US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,132	1,295,255.17	0.17
465	Caden ce Desig n Syste ms Inc	铿腾电 子科技 有限公司	CDNS US	纳斯达 克证券 交易所	美国	589	1,294,069.70	0.17

466	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	203	1,293,236.50	0.17
467	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	5,697	1,292,990.85	0.17
468	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	666	1,289,150.38	0.17
469	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	195	1,279,182.21	0.17
470	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	431	1,278,593.97	0.17
471	CDW Corp/DE	特拉华 CDW 公司	CDW US	纳斯达克证券交易所	美国	1,333	1,276,110.97	0.17
472	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	13,543	1,275,559.91	0.17
473	Ares Management Corp	阿瑞斯管理公司	ARES US	美国纽约证券交易所	美国	1,118	1,270,120.61	0.17
474	Intel Corp	英特尔公司	INTC US	纳斯达克证券交易所	美国	4,888	1,267,764.98	0.17
475	Best Buy Co Inc	百思买	BBY US	美国纽约证券交易所	美国	2,689	1,265,006.66	0.17

476	Carvana Co	Carvana 公司	CVNA US	美国纽约证券交易所	美国	426	1,263,641.32	0.17
477	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	275	1,263,298.52	0.17
478	Eaton Corp PLC	伊顿公共有限公司	ETN US	美国纽约证券交易所	美国	564	1,262,651.10	0.17
479	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	383	1,261,916.17	0.17
480	KKR & Co Inc	KKR & Co 股份有限公司	KKR US	美国纽约证券交易所	美国	1,408	1,261,612.24	0.17
481	Datadog Inc	数据狗	DDOG US	纳斯达克证券交易所	美国	1,318	1,259,805.70	0.17
482	Phillips 66	菲利普 66	PSX US	美国纽约证券交易所	美国	1,386	1,257,096.94	0.17
483	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	1,669	1,256,279.99	0.17
484	ServiceNow Inc	ServiceNow 公司	NOW US	美国纽约证券交易所	美国	1,165	1,254,404.28	0.17
485	Dell Technologies Inc	戴尔科技公司	DELL US	美国纽约证券交易所	美国	1,417	1,253,740.83	0.17
486	Zebra Technologies Corp	斑马技术公司	ZBRA US	纳斯达克证券交易所	美国	734	1,252,742.18	0.17

487	Oracle Corp	甲骨文	ORCL US	美国 纽约 证券 交易所	美国	893	1,223,395.18	0.16
488	Brown-Forman Corp	百富门公司	BF/B US	美国 纽约 证券 交易所	美国	6,562	1,201,965.00	0.16
489	Lennar Corp	莱纳公司	LEN US	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,660	1,199,450.66	0.16
490	HP Inc	惠普	HPQ US	美国 纽约 证券 交易所	美国	7,611	1,191,895.26	0.16
491	Marathon Petroleum Corp	马拉松石油公司	MPC US	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,042	1,191,103.68	0.16
492	Super Micro Computer Inc	超微电脑	SMCI US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	5,712	1,175,146.76	0.16
493	Broadcom Inc	博通股份有限公司	AVGO US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	482	1,172,545.82	0.16
494	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	1,469	1,167,792.24	0.16
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	724	1,150,792.81	0.16
496	Generac Holdings Inc	Generac 控股公司	GNRC US	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,167	1,118,589.87	0.15
497	News Corp	新闻集团	NWSA US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	5,668	1,040,600.91	0.14
498	Lamb	蓝威斯	LW US	美国 纽	美国	3,380	995,195.14	0.13

	Weston Holdings Inc	顿控股股份有限公司		约 证 券 交 易 所				
499	Fox Corp	福克斯公司	FOXA US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,705	875,678.48	0.12
500	Alpha bet Inc	谷歌公司	GOOGL US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	345	759,004.97	0.10
501	Alpha bet Inc	谷歌公司	GOOG US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	276	608,755.93	0.08
502	Fox Corp	福克斯公司	FOX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,214	554,045.30	0.07
503	News Corp	新闻集团	NWS US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,833	381,746.71	0.05

8.4.2 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无。

#### 8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Trade Desk Inc/The	TTD US	2,975,062.99	0.36
2	Omnicom Group Inc	OMC US	2,637,461.96	0.32
3	Coinbase Global Inc	COIN US	2,599,659.77	0.31
4	Chevron Corp	CVX US	2,564,445.56	0.31
5	Expand Energy Corp	EXE US	2,514,274.81	0.30
6	Williams-Sonoma Inc	WSM US	2,263,370.60	0.27
7	DoorDash Inc	DASH US	2,175,946.46	0.26
8	AppLovin Corp	APP US	2,163,216.30	0.26
9	TKO Group Holdings Inc	TKO US	2,139,756.49	0.26
10	Fiserv Inc	FISV US	2,102,306.63	0.25
11	Block Inc	XYZ US	2,083,931.71	0.25
12	Datadog Inc	DDOG US	2,036,079.46	0.24
13	Capital One	COF US	2,005,125.68	0.24

	Financial Corp			
14	Lululemon Athletica Inc	LULU US	1,988,355.43	0.24
15	Robinhood Markets Inc	HOOD US	1,953,239.87	0.23
16	DuPont de Nemours Inc	DD US	1,930,074.48	0.23
17	EMCOR Group Inc	EME US	1,750,136.47	0.21
18	Interactive Brokers Group Inc	IBKR US	1,741,599.37	0.21
19	Alexandria Real Estate Equities Inc	ARE US	1,667,909.62	0.20
20	Paramount Skydance Corp	PSKY US	1,602,330.17	0.19

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。

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Western Digital Corp	WDC US	4,198,020.98	0.50
2	Capital One Financial Corp	COF US	3,785,317.61	0.45
3	Seagate Technology Holdings PLC	STX US	3,516,369.20	0.42
4	Warner Bros Discovery Inc	WBD US	3,351,496.41	0.40
5	Palantir Technologies Inc	PLTR US	2,923,560.52	0.35
6	Chevron Corp	CVX US	2,760,436.05	0.33
7	Micron Technology Inc	MU US	2,673,294.27	0.32
8	Synopsys Inc	SNPS US	2,506,362.45	0.30
9	GE Vernova Inc	GEV US	2,488,959.67	0.30
10	Teradyne Inc	TER US	2,481,238.43	0.30
11	Newmont Corp	NEM US	2,451,221.59	0.29
12	Omnicom Group Inc	OMC US	2,435,187.72	0.29
13	Broadcom Inc	AVGO US	2,361,978.80	0.28
14	Hess Corporation	HES US	2,308,393.89	0.28
15	Intel Corp	INTC US	2,294,020.42	0.28
16	Amphenol Corp	APH US	2,276,653.73	0.27

17	Albemarle Corp	ALB US	2,265,419.57	0.27
18	Advanced Micro Devices Inc	AMD US	2,260,814.35	0.27
19	Lam Research Corp	LRCX US	2,251,881.18	0.27
20	Dollar Tree Inc	DLTR US	2,216,459.77	0.27

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。

### 8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	432,558,478.59
卖出收入（成交）总额	554,844,826.54

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。

### 8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

无。

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

无。

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

无。

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

无。

### 8.11 投资组合报告附注

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

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。

#### 8.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

#### 8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	725,547.95
4	应收利息	-
5	应收申购款	683,910.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,409,458.03

#### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

##### 8.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 8.11.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
大成标普 500 等权 重指 数 (QDII)A	130,912	1,737.52	768,824.74	0.34	226,693,352.42	99.66
大成标普 500 等权 重指 数 (QDII)C	152,233	326.51	923,475.88	1.86	48,782,440.66	98.14
合计	283,145	978.89	1,692,300.62	0.61	275,475,793.08	99.39

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。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	大成标普 500 等权重指数 (QDII)A	61,264.82	0.0269
	大成标普 500 等权重指数 (QDII)C	1,018.47	0.0020
	合计	62,283.29	0.0225

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）。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	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	0~10
	大成标普 500 等权重指数 (QDII)C	0
	合计	0~10

### 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无。

## § 10 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	285,403,996.15	36,580,649.22

额总额		
本报告期基金总申购份额	227,725,712.90	125,439,816.80
减：本报告期基金总赎回份额	285,667,531.89	112,314,549.48
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	227,462,177.16	49,705,916.54

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）。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

无。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 一、基金管理人的重大人事变动

2025 年 9 月 26 日，公司召开大成基金管理有限公司 2025 年第一次临时股东会，审议通过《关于公司董事会换届的议案》，选举吴庆斌先生、杨红女士、林昌先生、宋立志先生担任公司第九届董事会董事；选举杨飞先生、王亚坤先生、谢丹夏先生、江涛女士担任公司第九届董事会独立董事，杨晓帆、胡维翊不再担任公司独立董事；推举谭晓冈先生担任公司第九届董事会专职董事。第九届董事会董事任期为三年，自本次股东会决议生效之日起计算。

#### 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。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 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，本年度应支付的审计费用为 55,000.00 元。

## 11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

### 11.6.1 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。

### 11.6.2 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。

### 11.6.3 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。

### 11.6.4 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
Morgan Stanley	1	664,145,744.92	68.78	245,879.23	77.41	-
CLSA Limited	1	301,504,839.93	31.22	71,770.48	22.59	-
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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	大成基金管理有限公司关于提请投资者持续完善身份信息公告	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 12 月 31 日
2	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 11 月 13 日
3	大成基金管理有限公司旗下 200 只公募基金 2025 年第 3 季度报告提示性公告	规定报刊	2025 年 10 月 28 日
4	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2025 年第 3 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 10 月 28 日
5	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 10 月 27 日
6	大成基金管理有限公司旗下 193 只公募基金 2025 年中期报告提示性公告	规定报刊	2025 年 8 月 29 日
7	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2025 年中期报告	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 8 月 29 日
8	大成基金管理有限公司旗下 194 只公募基金 2025 年第 2 季度报告提示性公告	规定报刊	2025 年 7 月 22 日
9	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2025 年第 2 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 7 月 21 日
10	大成基金管理有限公司关于再次提请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
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 6 月 30 日
12	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	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本	2025 年 6 月 30 日

	要更新	公司网站	
13	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
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 6 月 30 日
15	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
16	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
17	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
18	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
19	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
20	大成基金管理有限公司旗下 188 只公募基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2025 年 4 月 22 日
21	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
22	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
23	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
24	大成基金管理有限公司旗下 184 只公募基金 2024 年年度报告提示性公告	规定报刊	2025 年 3 月 31 日
25	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
26	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
27	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	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本	2025 年 3 月 21 日

	要更新	公司网站	
28	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
29	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
30	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
31	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
32	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
33	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
34	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
35	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
36	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
37	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
38	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
39	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
40	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
41	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
42	大成基金管理有限公司旗下 184 只公	规定报刊	2025 年 1 月 22 日

	募基金 2024 年 4 季度报告提示性公告		
43	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
44	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
45	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
46	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	2025 年 1 月 4 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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。

### 13.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

### 13.3 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 3 月 31 日