

嘉实美国成长股票型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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 2024 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
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.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	39
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	39
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	40

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	79
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	80
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	80
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	80
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	80
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	80
7.11 投资组合报告附注.....	82
§8 基金份额持有人信息.....	82
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	82
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	83
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	83
§9 开放式基金份额变动.....	84
§10 重大事件揭示.....	84
10.1 基金份额持有人大会决议.....	84
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	84
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	84
10.4 基金投资策略的改变.....	84
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	85
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	85
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	85
10.8 其他重大事件.....	88
§11 备查文件目录.....	89
11.1 备查文件目录.....	89
11.2 存放地点.....	89
11.3 查阅方式.....	89

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实美国成长股票型证券投资基金	
基金简称	嘉实美国成长股票（QDII）	
基金主代码	000043	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 6 月 14 日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	837,250,162.27 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币	嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇
下属分级基金的交易代码	000043	000044
报告期末下属分级基金的份额总额	832,749,191.89 份	4,500,970.38 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司	
信息披露 负责人	姓名	胡勇钦	许俊
	联系电话	(010)65215588	010-66596688
	电子邮箱	service@jsfund.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话	400-600-8800	95566	
传真	(010)65215588	010-66594942	
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 1806A 单元	北京西城区复兴门内大街 1 号	
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街 21 号 北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层	北京西城区复兴门内大街 1 号	
邮政编码	100020	100818	
法定代表人	经雷	葛海蛟	

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币	嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇
本期已实现收益	-5,775,036.11	-120,729.20
本期利润	438,792,254.45	21,607,639.73
加权平均基金份额本期利润	0.7547	4.8875
本期加权平均净值利润率	18.00%	19.31%

本期基金份额净值增长率	21.79%	21.04%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利润	667,534,851.66	25,423,851.96
期末可供分配基金份额利润	0.8016	5.6485
期末基金资产净值	3,770,921,141.51	124,373,571.37
期末基金份额净值	4.528	3.877
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	352.80%	287.70%

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

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

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

（4）嘉实美国成长股票(QDII)美元现汇的期末基金份额净值为美元。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	5.01%	0.83%	6.34%	0.68%	-1.33%	0.15%
过去三个月	7.22%	1.04%	7.73%	0.93%	-0.51%	0.11%
过去六个月	21.79%	1.02%	19.20%	0.91%	2.59%	0.11%
过去一年	29.89%	0.98%	30.71%	0.88%	-0.82%	0.10%
过去三年	48.85%	1.28%	32.82%	1.26%	16.03%	0.02%

自基金合同生效起 至今	352.80%	1.18%	360.77%	1.15%	-7.97%	0.03%
----------------	---------	-------	---------	-------	--------	-------

嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	4.73%	0.83%	6.34%	0.68%	-1.61%	0.15%
过去三个月	6.75%	1.04%	7.73%	0.93%	-0.98%	0.11%
过去六个月	21.04%	1.03%	19.20%	0.91%	1.84%	0.12%
过去一年	31.69%	0.98%	30.71%	0.88%	0.98%	0.10%
过去三年	35.04%	1.25%	32.82%	1.26%	2.22%	-0.01%
自基金合同生效起 至今	287.70%	1.16%	360.77%	1.15%	-73.07%	0.01%

注：本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

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

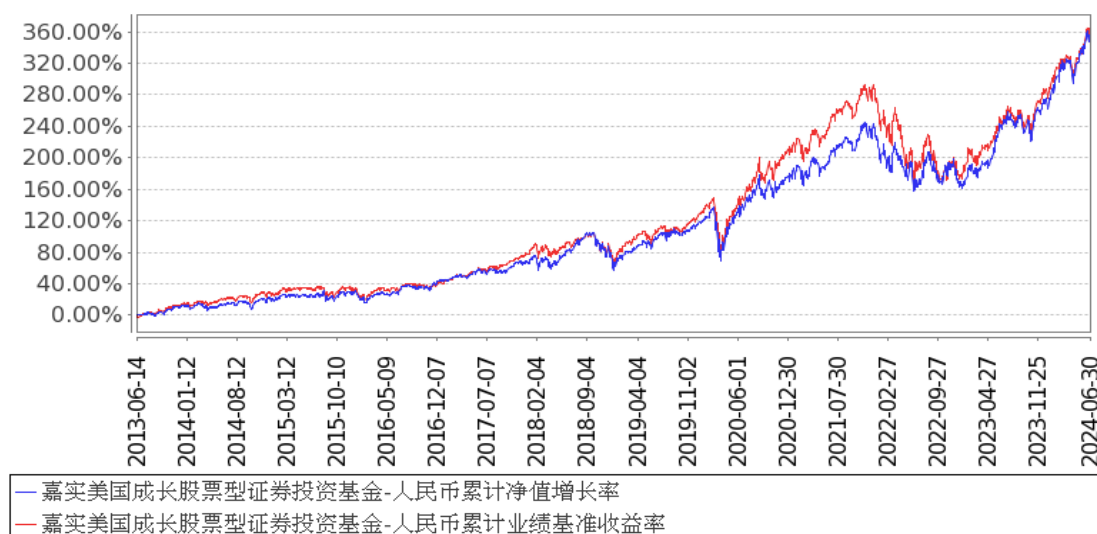
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

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

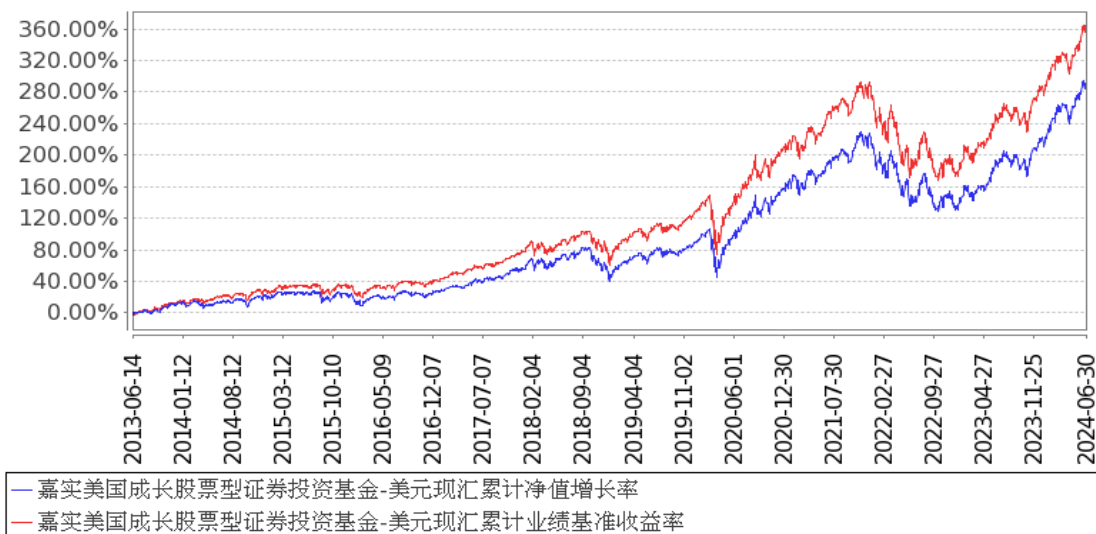
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

（2013年06月14日至2024年06月30日）



嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2013年06月14日至2024年06月30日)



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

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5 号文批准，于 1999 年 3 月 25 日成立，是中国第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，总部设在北京并设北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII 和特定资产管理业务等资格。

截止 2024 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 351 只公募基金，覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF、基础设施基金等不同类别。同时，还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张自力	本基金、嘉实全球	2013 年 6 月 14 日	-	28 年	曾任美国世纪投资管理公司（American Century Investments）资深副总经理，研

	价值股票 (QDII) 基金经理				究部总监暨基金经理，负责直接管理、支持公司旗下近二百亿美元的多项大型公募基金和对冲基金类产品。2012年2月加入嘉实基金管理有限公司，曾任定量投资部负责人、人工智能投资部负责人，现任股票投研人工智能投资总监，博士后科研工作站导师。博士研究生，毕业于美国德州大学奥斯汀分校和中国科学技术大学，具有基金从业资格。美国国籍。
--	------------------------	--	--	--	---

注：（1）首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，此后的非首任基金经理的“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期。

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的，合计 9 次，均为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年上半年，美股市场持续上行，大盘权重股表现强劲并屡创新高。本基金基准内涉及指数罗素 1000 成长指数上涨 20.62%，纳斯达克 100 指数上涨 16.98%，标普 500 上涨 14.48%，不断刷新指数的历史新高。

美股在上半年表现出较为明显的结构性特征，大盘占优、成长占优。市值维度上，大盘指数罗素 1000 上涨 13.44%，大幅领先小盘指数罗素 2000 的 1.02%，大盘之内的风格维度上，罗素 1000 成长上涨 20.26%，也大幅领先罗素 1000 价值的 5.46%。美股市场内的结构性特征，受到诸多因素推动，包括最近几个季度持续强劲的企业盈利对成长板块估值的消化、AI 产业趋势继续对科技成长风格以及核心龙头股票的催化、较稳定的宏观经济指标对美联储货币政策施展空间以及投资者预期的推动。相比于美联储加息期间价值风格的走强而言，报告期内成长风格显著占优。

本基金以大盘成长股为投资方向，在组合构建过程严格依据基金合同明确的风格进行管理，以合同明确的基准指数为基础，建立分散化的投资组合。在行业上，主要配置于信息技术、生物医药、非必需消费品等行业，并以高科技行业内的龙头企业为主要配置。本组合不持有受俄乌冲突直接影响的上市公司资产，不持有潜在可能受中东局势影响及在全球各类风险事件中受影响的上市公司股票。

本报告期间，本基金运作主要包括应对净申赎造成的仓位波动和实现对美国成长股的筛选与投资过程。本基金资金运作流程较长，单向包括从人民币申购、确认、换汇和掉汇等一系列步骤，涉及国内外券商和银行的多个环节，在市场大幅震荡背景下，申赎的随机性和资金流程会影响仓位水平并影响投资业绩，报告期内实现了流动性的稳健管理。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币基金份额净值为 4.528 元，本报告期基金份额净值增长率为 21.79%；截至本报告期末嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇基金份额净值为 3.877 美元，本报告期基金份额净值增长率为 21.04%；业绩比较基准收益率为 19.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美股的核心驱动力，是企业盈利能力的积极态势。美股在 2023 年 3 季度、4 季度以及 2024 年 1 季度的几次财务披露中，都保持了强劲的盈利水平和盈利成长态势，由此构成了更广泛的选股机会。今年以来的美股市场结构，如我们之前几次季报内的展望一致，逐步从龙头领衔上涨的状态，进入有更广泛企业盈利增长为基础的扩散性的上行阶段，有更大范围的 ALPHA 挖掘机会。也如之前的展望一致，RLG 对 NDX 继续领先。

除企业盈利外，美联储的政策也是全部资本市场的基础环境和核心催化。在大选年内，美联储一般都会保持平稳可预见的货币政策推出过程，不会有过于突然的政策转向。在当前持续多期的宏观指标下，美联储已有较为充足的条件转入降息政策，预估在 2024 年下半年或有 1-2 次降息，首次降息有较大概率在大选之前进行。在利率等金融条件进入更加宽松的环境时，企业融资约束

边际放松，相对利好对利率更为敏感的成长股和小盘股。从历史规律来看，加息停止后，对利率更为敏感的资产往往表现领先，小盘股占优将开启美股市场的扩散牛行情，被动指数将难以跑赢主动权益基金。市场将面临扩散性牛市的潜在时机，而降息预期加强以及政策推出等时刻会出现的市场快速结构性调整是潜在的波动和风险。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照《企业会计准则》及中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于基金资产估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求，履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，研究、指导基金估值业务。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，具备投研、风险管理、基金估值运作、法律合规等方面的专业胜任能力。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制，与估值相关的机构包括基金投资市场的证券交易场所以及境内相关机构等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购

赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实美国成长股票型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	272,228,370.38	112,543,778.61
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	3,636,780,136.59	1,391,179,240.32
其中：股票投资		3,620,256,165.87	1,339,895,575.80
基金投资		16,523,970.72	51,283,664.52
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		569,924.31	699,842.80
应收申购款		96,282,838.97	10,678,975.43
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		4,005,861,270.25	1,515,101,837.16

负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		13,756,560.86	2,985,757.94
应付赎回款		90,210,962.10	18,222,142.55
应付管理人报酬		5,171,810.05	2,238,657.55
应付托管费		1,005,629.74	435,294.54
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	123,123.40
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	421,594.62	269,398.49
负债合计		110,566,557.37	24,274,374.47
净 资 产：			
实收基金	6.4.7.10	860,475,950.60	401,200,270.43
未分配利润	6.4.7.12	3,034,818,762.28	1,089,627,192.26
净资产合计		3,895,294,712.88	1,490,827,462.69
负债和净资产总计		4,005,861,270.25	1,515,101,837.16

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币基金份额净值 4.528 元，基金份额总额 832,749,191.89 份，嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇基金份额净值 3.877 美元，基金份额总额 4,500,970.38 份，基金份额总额合计为 837,250,162.27 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实美国成长股票型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		487,616,809.93	354,491,569.88
1. 利息收入		146,757.30	71,382.33
其中：存款利息收入	6.4.7.13	146,757.30	71,382.33
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）		51,690,656.65	47,019,859.81
其中：股票投资收益	6.4.7.14	43,862,349.02	42,408,682.78
基金投资收益	6.4.7.15	-49,181.94	-777,489.81
债券投资收益	6.4.7.16	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.17	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	7,877,489.57	5,388,666.84
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	466,295,659.49	304,201,092.96
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-31,842,489.91	2,680,799.00
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	1,326,226.40	518,435.78
减：二、营业总支出		27,216,915.75	13,758,761.28
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	22,665,577.98	11,426,938.24
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,407,195.74	2,221,904.63
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		2,543.11	-
8. 其他费用	6.4.7.24	141,598.92	109,918.41
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		460,399,894.18	340,732,808.60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		460,399,894.18	340,732,808.60
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		460,399,894.18	340,732,808.60

6.3 净资产变动表

会计主体：嘉实美国成长股票型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	401,200,270.43	-	1,089,627,192.26	1,490,827,462.69
二、本期期初净资产	401,200,270.43	-	1,089,627,192.26	1,490,827,462.69
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	459,275,680.17	-	1,945,191,570.02	2,404,467,250.19
（一）、综合收益总额	-	-	460,399,894.18	460,399,894.18
（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）	459,275,680.17	-	1,484,791,675.84	1,944,067,356.01
其中：1. 基金申购款	709,805,257.05	-	2,279,849,840.27	2,989,655,097.32
2. 基金赎回款	-250,529,576.88	-	-795,058,164.43	-1,045,587,741.31
（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）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	860,475,950.60	-	3,034,818,762.28	3,895,294,712.88
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	474,111,355.85	-	794,956,460.33	1,269,067,816.18
二、本期期初净资产	474,111,355.85	-	794,956,460.33	1,269,067,816.18
三、本期增减变动	-80,245,317.53	-	183,222,160.98	102,976,843.45

动额(减少以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	340,732,808.60	340,732,808.60
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-80,245,317.53	-	-157,510,647.62	-237,755,965.15
其中：1. 基金申购款	106,490,440.74	-	212,255,638.41	318,746,079.15
2. 基金赎回款	-186,735,758.27	-	-369,766,286.03	-556,502,044.30
(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)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	393,866,038.32	-	978,178,621.31	1,372,044,659.63

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

经雷

梁凯

李袁

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《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》、《嘉实美国成长股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	272,228,370.38
等于：本金	272,220,521.35
加：应计利息	7,849.03
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	272,228,370.38

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	2,695,441,583.26	-	3,620,256,165.87	924,814,582.61
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	13,808,106.57	-	16,523,970.72	2,715,864.15
其他	-	-	-	-
合计	2,709,249,689.83	-	3,636,780,136.59	927,530,446.76

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	312,693.10
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	108,901.52
合计	421,594.62

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	373,719,810.71	373,719,810.71
本期申购	705,345,928.57	705,345,928.57
本期赎回（以“-”号填列）	-246,316,547.39	-246,316,547.39
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	832,749,191.89	832,749,191.89

嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,460,681.52	27,480,459.72
本期申购	723,887.05	4,459,328.48
本期赎回（以“-”号填列）	-683,598.19	-4,213,029.49
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	4,500,970.38	27,726,758.71

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	300,978,556.95	714,922,143.80	1,015,900,700.75
本期期初	300,978,556.95	714,922,143.80	1,015,900,700.75
本期利润	-5,775,036.11	444,567,290.56	438,792,254.45
本期基金份额交易产生的变动数	372,331,330.82	1,111,147,663.60	1,483,478,994.42
其中：基金申购款	571,871,595.92	1,694,015,604.38	2,265,887,200.30
基金赎回款	-199,540,265.10	-582,867,940.78	-782,408,205.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	667,534,851.66	2,270,637,097.96	2,938,171,949.62

嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	25,302,250.25	48,424,241.26	73,726,491.51
本期期初	25,302,250.25	48,424,241.26	73,726,491.51
本期利润	-120,729.20	21,728,368.93	21,607,639.73
本期基金份额交易产生的变动数	242,330.91	1,070,350.51	1,312,681.42
其中：基金申购款	4,136,211.33	9,826,428.64	13,962,639.97
基金赎回款	-3,893,880.42	-8,756,078.13	-12,649,958.55

本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,423,851.96	71,222,960.70	96,646,812.66

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入		140,778.08
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		5,979.22
合计		146,757.30

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		43,862,349.02
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		43,862,349.02

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额		979,361,054.95
减：卖出股票成本总额		934,386,336.81
减：交易费用		1,112,369.12
买卖股票差价收入		43,862,349.02

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出/赎回基金成交总额		39,873,539.15
减：卖出/赎回基金成本总额		39,863,905.99
减：买卖基金差价收入应缴纳增		27,291.82

值税额	
减：交易费用	31,523.28
基金投资收益	-49,181.94

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	7,748,741.32
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	128,748.25
合计	7,877,489.57

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	466,295,659.49
股票投资	467,737,185.84
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-1,441,526.35
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	466,295,659.49

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	1,326,226.40
合计	1,326,226.40

6.4.7.23 信用减值损失

无。

6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	49,229.18
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	32,697.40
合计	141,598.92

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	22,665,577.98	11,426,938.24
其中：应支付销售机构的客户维护费	8,333,201.46	4,372,419.95
应支付基金管理人的净管理费	14,332,376.52	7,054,518.29

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

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,407,195.74	2,221,904.63

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司_活期	272,228,370.38	140,778.08	141,109,942.75	71,026.52

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本期（2024年1月1日至2024年6月30日），本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时

变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	272,228,370.38	-	-	-	272,228,370.38
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	3,636,780,136.59	3,636,780,136.59
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	569,924.31	569,924.31
应收申购款	-	-	-	96,282,838.97	96,282,838.97
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	272,228,370.38	-	-	3,733,632,899.87	4,005,861,270.25
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	13,756,560.86	13,756,560.86
应付赎回款	-	-	-	90,210,962.10	90,210,962.10
应付管理人报酬	-	-	-	5,171,810.05	5,171,810.05
应付托管费	-	-	-	1,005,629.74	1,005,629.74
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	421,594.62	421,594.62
负债总计	-	-	-	110,566,557.37	110,566,557.37
利率敏感度缺口	272,228,370.38	-	-	3,623,066,342.50	3,895,294,712.88
上年度末 2023 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	112,543,778.61	-	-	-	112,543,778.61
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	1,391,179,240.32	1,391,179,240.32
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	699,842.80	699,842.80
应收申购款	-	-	-	10,678,975.43	10,678,975.43
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	112,543,778.61	-	-	1,402,558,058.55	1,515,101,837.16
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	2,985,757.94	2,985,757.94

应付赎回款	-	-	-	18,222,142.55	18,222,142.55
应付管理人报酬	-	-	-	2,238,657.55	2,238,657.55
应付托管费	-	-	-	435,294.54	435,294.54
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	123,123.40	123,123.40
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	269,398.49	269,398.49
负债总计	-	-	-	24,274,374.47	24,274,374.47
利率敏感度缺口	112,543,778.61	-	-	1,378,283,684.08	1,490,827,462.69

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	市场利率上升25个基点	-	-
	市场利率下降25个基点	-	-

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			合计
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	
以外币计价的资产				

货币资金	134,084,938.15	-	-	134,084,938.15
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	3,636,780,136.59	-	-	3,636,780,136.59
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	569,924.31	-	-	569,924.31
应收申购款	289,557.04	-	-	289,557.04
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	3,771,724,556.09	-	-	3,771,724,556.09
以外币计价的负债				
应付清算款	13,756,560.86	-	-	13,756,560.86
衍生金融负债	-	-	-	-
应付赎回款	812,958.71	-	-	812,958.71
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
其他负债	2,492.53	-	-	2,492.53
负债合计	14,572,012.10	-	-	14,572,012.10

	2.10			
资产负债表外 汇风险敞口净 额	3,757,152 ,543.99	-	-	3,757,152,543.99
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民 币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的 资产				
货币资金	56,639,34 2.05	-	-	56,639,342.05
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资 产	1,391,179 ,240.32	-	-	1,391,179,240.32
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	699,842.8 0	-	-	699,842.80
应收申购款	133,266.8 1	-	-	133,266.81
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	1,448,651 ,691.98	-	-	1,448,651,691.98
以外币计价的 负债				
应付清算款	2,985,757 .94	-	-	2,985,757.94
衍生金融负债	-	-	-	-
应付赎回款	437,202.6	-	-	437,202.61

	1			
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
其他负债	658.48	-	-	658.48
负债合计	3,423,619.03	-	-	3,423,619.03
资产负债表外汇风险敞口净额	1,445,228,072.95	-	-	1,445,228,072.95

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	所有外币相对人民币升值5%	187,857,627.20	72,261,403.65
所有外币相对人民币贬值5%	-187,857,627.20	-72,261,403.65	

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	3,620,256,165.87	92.94	1,339,895,575.80	89.88
交易性金融资产—基金投资	16,523,970.72	0.42	51,283,664.52	3.44
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	3,636,780,136.59	93.36	1,391,179,240.32	93.32

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准以外的其他市场变量保持不变		
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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	214,128,181.08	76,281,452.50
	业绩比较基准下降 5%	-214,128,181.08	-76,281,452.50

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	3,636,780,136.59	1,391,179,240.32
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	3,636,780,136.59	1,391,179,240.32

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,620,256,165.87	90.37
	其中：普通股	3,509,401,102.14	87.61
	存托凭证	98,780,764.03	2.47
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	12,074,299.70	0.30
2	基金投资	16,523,970.72	0.41

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	272,228,370.38	6.80
8	其他各项资产	96,852,763.28	2.42
9	合计	4,005,861,270.25	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
美国	3,620,256,165.87	92.94
合计	3,620,256,165.87	92.94

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
信息技术	1,646,884,003.25	42.28
非必需消费品	458,911,114.44	11.78
通信服务	498,842,296.15	12.81
医疗保健	314,885,525.76	8.08
工业	247,972,644.77	6.37
金融	205,726,568.69	5.28
必需消费品	108,620,404.89	2.79
能源	47,601,176.04	1.22
原材料	27,458,450.91	0.70
公用事业	51,279,681.27	1.32
房地产	-	-
房地产信托数据中心类	978,517.84	0.03
房地产信托特殊类	4,807,454.00	0.12
房地产信托工业类	4,882.86	0.00
房地产信托零售类	3,395,921.63	0.09
房地产信托医疗保健类	2,887,523.37	0.07
合计	3,620,256,165.87	92.94

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代 码	所在证 券市场	所属 国家 (地 区)	数量 (股)	公允价值	占基 金资 产净 值比 例(%)
1	NVIDIA Corp	英伟达	NVDA UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	389,335	342,788,004.24	8.80
2	Microsoft Corp	微软	MSFT UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	99,037	315,464,859.70	8.10
3	Apple Inc	苹果公 司	AAPL UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	190,693	286,239,082.34	7.35
4	Alphabet Inc	Alphab et 公司	GOOGL UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	178,150	231,264,820.35	5.94
4	Alphabet Inc	Alphab et 公司	GOOG UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	31,193	40,775,416.48	1.05
5	Amazon.com Inc	亚马逊 公司	AMZN UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	168,672	232,304,203.56	5.96
6	Meta Platforms Inc	Meta 平 台股份 有限公司	META UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	42,519	152,790,967.61	3.92
7	Eli Lilly & Co	礼来	LLY UN	纽约证 券交易 所	美国	17,120	110,466,152.59	2.84
8	Broadcom Inc	博通股 份有限 公司	AVGO UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	8,779	100,451,874.48	2.58
9	Tesla Inc	特斯拉 公司	TSLA UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	40,792	57,526,966.30	1.48
10	Costco Wholesale Corp	开市客	COST UW	纳斯达克 证券 交易所	美国	9,251	56,039,863.48	1.44
11	Taiwan Semiconductor	台湾集 成电路 制造股	TSM UN	纽约证 券交易 所	美国	36,624	45,366,482.37	1.16

	Manufacturing Co Ltd	份有限公司						
12	Netflix Inc	奈飞公司	NFLX UW	纳斯达克证券交易所	美国	9,410	45,259,604.32	1.16
13	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM UW	纳斯达克证券交易所	美国	28,522	40,487,436.04	1.04
14	Vertiv Holdings Co	维谛技术	VRT UN	纽约证券交易所	美国	59,445	36,675,607.83	0.94
15	Applied Materials Inc	应用材料	AMAT UW	纳斯达克证券交易所	美国	18,271	30,729,145.88	0.79
16	Dell Technologies Inc	戴尔科技公司	DELL UN	纽约证券交易所	美国	28,602	28,111,675.57	0.72
17	AbbVie Inc	艾伯维公司	ABBV UN	纽约证券交易所	美国	19,254	23,535,872.72	0.60
18	Lam Research Corp	泛林集团	LRCX UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,074	23,328,502.94	0.60
19	Adobe Inc	奥多比	ADBE UW	纳斯达克证券交易所	美国	5,446	21,561,925.58	0.55
20	Intuitive Surgical Inc	直觉外科手术公司	ISRG UW	纳斯达克证券交易所	美国	6,553	20,775,349.29	0.53
21	KLA Corp	KLA 公司	KLAC UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,525	20,713,315.48	0.53
22	Super Micro Computer Inc	Super Micro Computer 股份有限公司	SMCI UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,508	20,484,417.28	0.53
23	Novo Nordisk A/S	诺和诺德公司	NVO UN	纽约证券交易所	美国	19,716	20,056,681.28	0.51
24	Progressive	前进保险公司	PGR UN	纽约证券交易所	美国	13,450	19,910,137.60	0.51

	Corp/The			所				
25	Arista Networks Inc	Arista 网络股份有限公司	ANET UN	纽约证券交易所	美国	7,826	19,547,789.56	0.50
26	General Electric Co	通用电气	GE UN	纽约证券交易所	美国	16,066	18,201,932.86	0.47
27	NRG Energy Inc	NRG 能源股份有限公司	NRG UN	纽约证券交易所	美国	32,741	18,167,740.19	0.47
28	Booking Holdings Inc	Booking 控股股份有限公司	BKNG UW	纳斯达克证券交易所	美国	619	17,476,114.47	0.45
29	Constellation Energy Corp	美国联合能源公司	CEG UW	纳斯达克证券交易所	美国	11,956	17,064,610.33	0.44
30	ASML Holding NV	阿斯麦控股公司	ASML UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,330	16,982,885.74	0.44
31	Visa Inc	维萨公司	V UN	纽约证券交易所	美国	8,827	16,511,531.95	0.42
32	Micron Technology Inc	美光科技股份有限公司	MU UW	纳斯达克证券交易所	美国	17,542	16,443,660.37	0.42
33	Chipotle Mexican Grill Inc	Chipotle Mexican Grill 股份有限公司	CMG UN	纽约证券交易所	美国	36,450	16,274,707.03	0.42
34	NetApp Inc	美国网络存储技术有限公司	NTAP UW	纳斯达克证券交易所	美国	17,584	16,140,913.47	0.41
35	Oracle Corp	甲骨文	ORCL UN	纽约证券交易所	美国	15,505	15,602,746.00	0.40
36	TJX Cos	TJX 公	TJX UN	纽约证	美国	19,639	15,409,951.09	0.40

	Inc/The	司		券交易 所				
37	Uber Technolog ies Inc	优步技 术股份 有限公 司	UBER UN	纽约证 券交易 所	美国	29,709	15,388,543.76	0.40
38	Mastercar d Inc	万事达 股份有 限公司	MA UN	纽约证 券交易 所	美国	4,709	14,805,374.25	0.38
39	Vistra Corp	Vistra 公司	VST UN	纽约证 券交易 所	美国	22,800	13,970,979.62	0.36
40	Vertex Pharmaceu ticals Inc	福泰制 药	VRTX UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,155	13,879,668.21	0.36
41	Salesforc e Inc	Salesf orce 股 份有限 公司	CRM UN	纽约证 券交易 所	美国	7,388	13,537,034.47	0.35
42	EMCOR Group Inc	埃姆科 集团公 司	EME UN	纽约证 券交易 所	美国	5,090	13,243,427.41	0.34
43	Home Depot Inc/The	家得宝	HD UN	纽约证 券交易 所	美国	5,203	12,764,674.08	0.33
44	ServiceNo w Inc	Servic eNow 公 司	NOW UN	纽约证 券交易 所	美国	2,219	12,440,689.82	0.32
45	Autodesk Inc	欧特克	ADSK UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	6,803	11,997,271.87	0.31
46	Synopsys Inc	新思科 技公司	SNPS UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,819	11,955,022.70	0.31
47	Eaton Corp PLC	伊顿	ETN UN	纽约证 券交易 所	美国	5,325	11,899,288.35	0.31
48	Walmart Inc	沃尔玛 股份有 限公司	WMT UN	纽约证 券交易 所	美国	23,615	11,395,551.16	0.29
49	Hewlett Packard Enterpris	慧与	HPE UN	纽约证 券交易 所	美国	75,120	11,333,681.62	0.29

	e Co							
50	Palo Alto Networks Inc	Palo Alto Networks 股份有限公司	PANW UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,423	10,686,217.76	0.27
51	CrowdStrike Holdings Inc	CrowdStrike 控股股份有限公司	CRWD UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,891	10,626,003.85	0.27
52	Cirrus Logic Inc	Cirrus Logic 股份有限公司	CRUS UW	纳斯达克证券交易所	美国	11,679	10,625,639.32	0.27
53	Amphenol Corp	安费诺公司	APH UN	纽约证券交易所	美国	22,102	10,611,888.87	0.27
54	UnitedHealth Group Inc	联合健康集团	UNH UN	纽约证券交易所	美国	2,764	10,031,645.48	0.26
55	Caterpillar Inc	卡特彼勒	CAT UN	纽约证券交易所	美国	4,097	9,726,020.22	0.25
56	Merck & Co Inc	默克	MRK UN	纽约证券交易所	美国	10,896	9,613,517.26	0.25
57	DaVita Inc	DaVita 股份有限公司	DVA UN	纽约证券交易所	美国	9,701	9,580,326.12	0.25
58	GoDaddy Inc	GoDaddy 股份有限公司	GDDY UN	纽约证券交易所	美国	9,264	9,224,027.95	0.24
59	JPMorgan Chase & Co	摩根大通	JPM UN	纽约证券交易所	美国	6,326	9,118,717.51	0.23
60	Advanced Micro Devices Inc	AMD 公司	AMD UW	纳斯达克证券交易所	美国	7,799	9,015,942.14	0.23
61	Spotify Technology S.A.	Spotify 科技	SPOT UN	纽约证券交易所	美国	4,025	9,001,182.25	0.23

	y SA	股份有 限公司		所				
62	Trane Technolog ies PLC	特灵科 技公共 有限公司	TT UN	纽约证 券交易 所	美国	3,635	8,521,233.61	0.22
63	Celestica Inc	天弘股 份有限 公司	CLS UN	纽约证 券交易 所	美国	20,821	8,507,032.60	0.22
64	Goldman Sachs Group Inc/The	高盛	GS UN	纽约证 券交易 所	美国	2,617	8,436,145.96	0.22
65	Cadence Design Systems Inc	Cadenc e 设计 系统股 份有限 公司	CDNS UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,742	8,207,226.44	0.21
66	Universal Health Services Inc	Univer sal 保 健服务 股份有 限公司	UHS UN	纽约证 券交易 所	美国	6,055	7,980,242.50	0.20
67	Monolithi c Power Systems Inc	芯源系 统有限 公司	MPWR UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,362	7,975,802.57	0.20
68	Motorola Solutions Inc	摩托罗 拉解决 方案股 份有限 公司	MSI UN	纽约证 券交易 所	美国	2,892	7,956,762.90	0.20
69	SkyWest Inc	SkyWes t 股份 有限公 司	SKYW UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	13,451	7,867,442.50	0.20
70	Apollo Global Managem ent Inc	阿波罗 全球管 理股份 有限公 司	APO UN	纽约证 券交易 所	美国	9,279	7,807,919.18	0.20
71	AppLovin Corp	AppLov in 公司	APP UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	13,130	7,787,301.85	0.20
72	McKesson	McKess	MCK UN	纽约证	美国	1,859	7,737,783.13	0.20

	Corp	on 公司		券交易 所				
73	American Express Co	美国运通	AXP UN	纽约证 券交易 所	美国	4,560	7,524,960.06	0.19
74	Berkshire Hathaway Inc	伯克希 尔哈撒 韦公司	BRK/B UN	纽约证 券交易 所	美国	2,591	7,511,781.18	0.19
75	GE Vernova Inc	通用电 气 Vernov a 股份 有限公 司	GEV UN	纽约证 券交易 所	美国	6,139	7,503,806.94	0.19
76	Boston Scientific Corp	波士顿 科学	BSX UN	纽约证 券交易 所	美国	13,526	7,423,540.42	0.19
77	Wingstop Inc	Wingst op 股份 有限公 司	WING UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,431	7,322,690.50	0.19
78	Howmet Aerospace Inc	Howmet 航空航 天股份 有限公 司	HWM UN	纽约证 券交易 所	美国	12,795	7,078,878.33	0.18
79	Ecolab Inc	艺康集 团	ECL UN	纽约证 券交易 所	美国	4,155	7,047,621.25	0.18
80	SAP SE	SAP 公 司	SAP UN	纽约证 券交易 所	美国	4,713	6,775,158.20	0.17
81	Weatherford International PLC	威德福 国际公 共有限 公司	WFRD UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	7,670	6,693,429.98	0.17
82	Wells Fargo & Co	富国银 行	WFC UN	纽约证 券交易 所	美国	15,675	6,634,610.72	0.17
83	NU Holdings Ltd/Cayman Islands	NU 控股 有限公 司/开 曼群岛	NU UN	纽约证 券交易 所	美国	72,103	6,623,702.58	0.17
84	Diamondba	Diamon	FANG UW	纳斯达	美国	4,640	6,619,953.39	0.17

	ock Energy Inc	dback 能源股份有限公司		克证券交易所				
85	KKR & Co Inc	KKR & Co 有限公司	KKR UN	纽约证券交易所	美国	8,775	6,581,464.39	0.17
86	Pure Storage Inc	Pure 储存股份有限公司	PSTG UN	纽约证券交易所	美国	14,265	6,527,832.73	0.17
87	Palantir Technologies Inc	Palantir 科技股份有限公司	PLTR UN	纽约证券交易所	美国	35,992	6,497,342.21	0.17
88	LPL Financial Holdings Inc	LPL 金融控股公司	LPLA UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,203	6,375,620.31	0.16
89	Crocs Inc	卡骆驰股份有限公司	CROX UW	纳斯达克证券交易所	美国	6,120	6,365,321.38	0.16
90	Trade Desk Inc/The	Trade Desk 股份有限公司	TTD UQ	纳斯达克证券交易所	美国	8,933	6,218,034.01	0.16
91	Royal Caribbean Cruises Ltd	皇家加勒比国际游轮有限公司	RCL UN	纽约证券交易所	美国	5,469	6,214,018.48	0.16
92	Sprouts Farmers Market Inc	Sprouts Farmers Market 股份有限公司	SFM UW	纳斯达克证券交易所	美国	10,416	6,210,311.76	0.16
93	Amgen Inc	安进公司	AMGN UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,677	5,961,059.70	0.15
94	Arch Capital Group Ltd	阿契资本集团	ACGL UW	纳斯达克证券交易所	美国	8,290	5,960,699.44	0.15
95	ARM	ARM	ARM UW	纳斯达克	美国	5,082	5,926,054.22	0.15

	Holdings PLC	Holdings PLC		克证券交易所				
96	Verisk Analytics Inc	Verisk 分析公司	VRSK UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,011	5,784,218.14	0.15
97	Intuit Inc	Intuit 股份有限公司	INTU UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,205	5,643,984.09	0.14
98	DuPont de Nemours Inc	杜邦公司	DD UN	纽约证券交易所	美国	9,828	5,637,695.91	0.14
99	Hilton Worldwide Holdings Inc	希尔顿全球控股股份有限公司	HLT UN	纽约证券交易所	美国	3,617	5,624,680.09	0.14
100	NXP Semiconductors NV	恩智浦半导体公司	NXPI UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,915	5,590,243.03	0.14
101	Targa Resources Corp	Targa 资源公司	TRGP UN	纽约证券交易所	美国	6,058	5,559,967.60	0.14
102	Seagate Technology Holdings PLC	Seagate Technology 控股公共有限公司	STX UW	纳斯达克证券交易所	美国	7,508	5,525,772.65	0.14
103	Leidos Holdings Inc	Leidos 控股公司	LDOS UN	纽约证券交易所	美国	5,177	5,382,307.31	0.14
104	Amkor Technology Inc	安靠技术公司	AMKR UW	纳斯达克证券交易所	美国	18,792	5,359,751.56	0.14
105	Dick's Sporting Goods Inc	迪克体育用品股份有限公司	DKS UN	纽约证券交易所	美国	3,494	5,349,988.27	0.14
106	FTAI Aviation Ltd	FTAI Aviation Ltd	FTAI UW	纳斯达克证券交易所	美国	7,268	5,347,064.43	0.14
107	Murphy USA Inc	Murphy 美国股	MUSA UN	纽约证券交易所	美国	1,561	5,222,711.89	0.13

		份有限公司		所				
108	Western Digital Corp	西部数据公司	WDC UN	纳斯达克证券交易所	美国	9,406	5,079,217.76	0.13
109	3M Co	3M 公司	MMM UN	纽约证券交易所	美国	6,904	5,028,098.23	0.13
110	Corebridge Financial Inc	Corebridge Financial Inc	CRBG UN	纽约证券交易所	美国	24,202	5,022,699.53	0.13
111	Booz Allen Hamilton Holding Corp	博思艾伦咨询控股公司	BAH UN	纽约证券交易所	美国	4,537	4,976,247.48	0.13
112	Onto Innovation Inc	Onto 创新股份有限公司	ONTO UN	纽约证券交易所	美国	3,147	4,924,300.37	0.13
113	Domino's Pizza Inc	达美乐披萨公司	DPZ UN	纽约证券交易所	美国	1,333	4,905,147.60	0.13
114	Tenet Healthcare Corp	Tenet 医疗保健公司	THC UN	纽约证券交易所	美国	5,133	4,866,485.42	0.12
115	Freshpet Inc	Freshpet 公司	FRPT UQ	纳斯达克证券交易所	美国	5,258	4,848,594.52	0.12
116	Teradyne Inc	泰瑞达	TER UN	纳斯达克证券交易所	美国	4,454	4,707,134.95	0.12
117	Valero Energy Corp	Valero 能源	VLO UN	纽约证券交易所	美国	4,179	4,668,766.97	0.12
118	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	BJ's 批发俱乐部控股有限公司	BJ UN	纽约证券交易所	美国	7,391	4,626,899.87	0.12
119	Cintas Corp	Cintas 公司	CTAS UN	纳斯达克证券交易所	美国	925	4,616,317.00	0.12

120	Blackstone Inc	黑石集团股份有限公司	BX UN	纽约证券交易所	美国	5,165	4,557,068.34	0.12
121	Southern Copper Corp	南方铜业公司	SCCO UN	纽约证券交易所	美国	5,927	4,550,996.17	0.12
122	Coca-Cola Consolidated Inc	可口可乐装瓶有限公司	COKE UW	纳斯达克证券交易所	美国	586	4,531,290.71	0.12
123	Deckers Outdoor Corp	德克斯户外用品公司	DECK UN	纽约证券交易所	美国	652	4,497,747.71	0.12
124	Fair Isaac Corp	费埃哲公司	FICO UN	纽约证券交易所	美国	401	4,254,362.22	0.11
125	Kimberly-Clark Corp	金佰利	KMB UN	纽约证券交易所	美国	4,263	4,198,729.99	0.11
126	T-Mobile US Inc	T-Mobile US 股份有限公司	TMUS UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,285	4,124,644.76	0.11
127	CommVault Systems Inc	CommVault 系统公司	CVLT UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,616	3,999,325.83	0.10
128	Medpace Holdings Inc	Medpace 控股股份有限公司	MEDP UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,350	3,962,482.98	0.10
129	Copart Inc	Copart 股份有限公司	CPRT UW	纳斯达克证券交易所	美国	10,156	3,920,088.93	0.10
130	Charles Schwab Corp/The	嘉信理财	SCHW UN	纽约证券交易所	美国	7,414	3,893,639.24	0.10
131	HEICO Corp	海科航空公司	HEI/A UN	纽约证券交易所	美国	3,049	3,857,440.94	0.10
132	International Business Machines	国际商业机器	IBM UN	纽约证券交易所	美国	3,043	3,750,741.12	0.10

	Corp							
133	Comfort Systems USA Inc	美国舒适系统公司	FIX UN	纽约证券交易所	美国	1,727	3,743,103.97	0.10
134	Pinterest Inc	Pinterest 股份有限公司	PINS UN	纽约证券交易所	美国	11,903	3,738,471.34	0.10
135	WW Grainger Inc	固安捷股份有限公司	GWW UN	纽约证券交易所	美国	581	3,735,878.82	0.10
136	HCA Healthcare Inc	HCA 医疗保健有限公司	HCA UN	纽约证券交易所	美国	1,630	3,732,208.24	0.10
137	Gilead Sciences Inc	吉利德科学	GILD UN	纳斯达克证券交易所	美国	7,602	3,717,148.02	0.10
138	Iron Mountain Inc	美国铁山公司	IRM UN	纽约证券交易所	美国	5,709	3,646,360.09	0.09
139	Marriott International Inc/MD	万豪国际	MAR UN	纳斯达克证券交易所	美国	2,043	3,520,183.87	0.09
140	HubSpot Inc	HubSpot 公司	HUBS UN	纽约证券交易所	美国	820	3,446,718.61	0.09
141	Simon Property Group Inc	西蒙房地产集团公司	SPG UN	纽约证券交易所	美国	3,139	3,395,921.63	0.09
142	Dycom Industries Inc	戴康工业公司	DY UN	纽约证券交易所	美国	2,809	3,378,437.02	0.09
143	Waste Management Inc	废品管理	WM UN	纽约证券交易所	美国	2,213	3,364,714.94	0.09
144	Fabrinet	Fabrinet 公司	FN UN	纽约证券交易所	美国	1,910	3,332,127.50	0.09
145	Manhattan Associates Inc	曼哈顿联合软件公司	MANH UN	纳斯达克证券交易所	美国	1,876	3,298,081.21	0.08
14	Corning	康宁公	GLW UN	纽约证	美国	11,815	3,271,292.07	0.08

6	Inc	司		券交易 所				
14 7	Ralph Lauren Corp	拉夫劳 伦	RL UN	纽约证 券交易 所	美国	2,602	3,246,301.02	0.08
14 8	Manulife Financial Corp	宏利金 融	MFC UN	纽约证 券交易 所	美国	16,608	3,150,793.63	0.08
14 9	Texas Roadho use Inc	Texas Roadho use 股 份有限 公司	TXRH UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,572	3,147,466.55	0.08
15 0	Natera Inc	Natera 股份有 限公司	NTRA UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,054	3,128,719.79	0.08
15 1	Lowe's Cos Inc	劳氏	LOW UN	纽约证 券交易 所	美国	1,991	3,128,208.09	0.08
15 2	Allstate Corp/The	好事达 保险公 司	ALL UN	纽约证 券交易 所	美国	2,737	3,114,336.20	0.08
15 3	Brink's Co/The	Brink's 公司	BCO UN	纽约证 券交易 所	美国	4,263	3,111,070.56	0.08
15 4	Hims & Hers Health Inc	Hims & Hers Health Inc	HIMS UN	纽约证 券交易 所	美国	21,539	3,099,248.69	0.08
15 5	Tencent Holdings Ltd	腾讯控 股有限 公司	TCEHY UV	纽约证 券交易 所	美国	9,144	3,086,330.87	0.08
15 6	Pennant Group Inc/The	Pennan t Group Inc/Th e	PNTG UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	18,449	3,049,075.31	0.08
15 7	MasTec Inc	MasTec 股份有 限公司	MTZ UN	纽约证 券交易 所	美国	3,894	2,969,160.72	0.08
15 8	Pilgrim's Pride Corp	Pilgri m's Pride 公司	PPC UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	10,793	2,960,633.57	0.08
15	elf	elf	ELF UN	纽约证	美国	1,963	2,947,953.50	0.08

9	Beauty Inc	Beauty 股份有限公司		券交易所				
160	Ross Stores Inc	罗斯百货股份有限公司	ROST UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,829	2,929,900.74	0.08
161	Wix.com Ltd	Wix.com 有限公司	WIX UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,568	2,911,239.08	0.07
162	Blue Owl Capital Inc	蓝猫头鹰资本公司	OWL UN	纽约证券交易所	美国	22,899	2,896,739.53	0.07
163	Chubb Ltd	邱博保险集团	CB UN	纽约证券交易所	美国	1,561	2,837,748.37	0.07
164	Toll Brothers Inc	托尔兄弟公司	TOL UN	纽约证券交易所	美国	3,456	2,836,908.83	0.07
165	TransDigm Group Inc	TransDigm 集团公司	TDG UN	纽约证券交易所	美国	310	2,822,633.99	0.07
166	Brown & Brown Inc	Brown & Brown 股份有限公司	BRO UN	纽约证券交易所	美国	4,411	2,810,720.91	0.07
167	Toast Inc	Toast 股份有限公司	TOST UN	纽约证券交易所	美国	15,241	2,799,126.03	0.07
168	Synchrony Financial	同步金融公司	SYF UN	纽约证券交易所	美国	8,138	2,736,920.83	0.07
169	Quanta Services Inc	Quanta 服务股份有限公司	PWR UN	纽约证券交易所	美国	1,509	2,732,570.56	0.07
170	Tetra Tech Inc	Tetra 科技股份有限公司	TTEK UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,873	2,729,500.54	0.07
171	Tractor Supply Co	拖拉机供应公司	TSCO UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,410	2,713,172.76	0.07
17	Bank of	美国银	BAC UN	纽约证	美国	9,527	2,700,264.63	0.07

2	America Corp	行公司		券交易所				
173	United Therapeutics Corp	联合治疗公司	UTHR UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,180	2,678,885.73	0.07
174	RadNet Inc	RadNet 股份有限公司	RDNT UQ	纳斯达克证券交易所	美国	6,367	2,673,573.69	0.07
175	Schlumberger NV	斯伦贝谢公众有限公司	SLB UN	纽约证券交易所	美国	7,944	2,671,109.82	0.07
176	O'Reilly Automotive Inc	O'Reilly 汽车股份有限公司	ORLY UW	纳斯达克证券交易所	美国	348	2,619,162.29	0.07
177	Skechers USA Inc	斯凯奇美国公司	SKX UN	纽约证券交易所	美国	5,235	2,578,784.12	0.07
178	Coca-Cola Co/The	可口可乐	KO UN	纽约证券交易所	美国	5,638	2,557,514.18	0.07
179	Welltower Inc	Welltower Inc	WELL UN	纽约证券交易所	美国	3,440	2,555,813.02	0.07
180	Advanced Drainage Systems Inc	先进排水系统公司	WMS UN	纽约证券交易所	美国	2,228	2,546,754.28	0.07
181	AutoZone Inc	AutoZone 股份有限公司	AZO UN	纽约证券交易所	美国	118	2,492,696.65	0.06
182	Citigroup Inc	花旗集团	C UN	纽约证券交易所	美国	5,428	2,454,903.80	0.06
183	HealthEquity Inc	Health equity 有限公司	HQY UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,988	2,449,948.68	0.06
184	KB Home	KB 家居	KBH UN	纽约证券交易所	美国	4,873	2,437,273.95	0.06
18	Prudential	保德信	PRU UN	纽约证	美国	2,918	2,437,083.52	0.06

5	1 Financial Inc	金融集 团		券交易 所				
18 6	Emerson Electric Co	艾默生 电气	EMR UN	纽约证 券交易 所	美国	3,049	2,393,734.19	0.06
18 7	Freeport- McMoRan Inc	自由港 迈克墨 伦股份 有限公司	FCX UN	纽约证 券交易 所	美国	6,834	2,367,041.19	0.06
18 8	Zeta Global Holdings Corp	Zeta Global Holdin gs Corp	ZETA UN	纽约证 券交易 所	美国	18,399	2,314,373.78	0.06
18 9	Encompass Health Corp	南方保 健公司	EHC UN	纽约证 券交易 所	美国	3,761	2,299,506.13	0.06
19 0	Guidewire Software Inc	Guidew ire 软 件公司	GWRE UN	纽约证 券交易 所	美国	2,303	2,263,191.38	0.06
19 1	RTX Corp	RTX 公 司	RTX UN	纽约证 券交易 所	美国	3,156	2,257,990.03	0.06
19 2	Sterling Infrastru cture Inc	Sterli ng 基础 设施股 份有限 公司	STRL UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,667	2,249,309.16	0.06
19 3	Thermo Fisher Scientifi c Inc	Thermo Fisher Scienti fic 公 司	TMO UN	纽约证 券交易 所	美国	568	2,238,556.39	0.06
19 4	MicroStra tegy Inc	微策略 公司	MSTR UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	226	2,218,647.53	0.06
19 5	Accenture PLC	埃森哲 公司	ACN UN	纽约证 券交易 所	美国	1,020	2,205,589.24	0.06
19 6	Carlisle Cos Inc	卡莱股 份有限 公司	CSL UN	纽约证 券交易 所	美国	761	2,197,654.33	0.06
19	Fiserv	Fiserv	FI UN	纽约证	美国	2,066	2,194,460.31	0.06

7	Inc	公司		券交易所				
198	Marathon Oil Corp	Marathon 石油公司	MRO UN	纽约证券交易所	美国	10,704	2,187,098.61	0.06
199	Hartford Financial Services Group Inc/The	哈特福德金融服务	HIG UN	纽约证券交易所	美国	3,046	2,182,545.73	0.06
200	Williams-Sonoma Inc	Williams-Sonoma 股份有限公司	WSM UN	纽约证券交易所	美国	1,083	2,179,423.26	0.06
201	Flex Ltd	伟创力国际有限公司	FLEX UW	纳斯达克证券交易所	美国	10,341	2,173,361.06	0.06
202	PulteGroup Inc	Pulte 集团公司	PHM UN	纽约证券交易所	美国	2,756	2,162,524.83	0.06
203	Fidelity National Information Services Inc	繁德信息技术有限公司	FIS UN	纽约证券交易所	美国	3,978	2,136,486.93	0.05
204	Crane Co	Crane Co	CR UN	纽约证券交易所	美国	2,048	2,116,082.61	0.05
205	Kroger Co/The	克罗格公司	KR UN	纽约证券交易所	美国	5,946	2,115,831.32	0.05
206	Pfizer Inc	辉瑞制药	PFE UN	纽约证券交易所	美国	10,445	2,082,815.14	0.05
207	Edwards Lifesciences Corp	爱德华生命科学公司	EW UN	纽约证券交易所	美国	3,154	2,076,286.14	0.05
208	Equitable Holdings Inc	Equitable 控股股份有限公司	EQH UN	纽约证券交易所	美国	6,894	2,007,540.02	0.05

209	NVR Inc	NVR 股份有限公司	NVR UN	纽约证券交易所	美国	36	1,946,957.38	0.05
210	Allison Transmission Holdings Inc	艾里逊变速箱控股公司	ALSN UN	纽约证券交易所	美国	3,571	1,931,640.03	0.05
211	Zscaler Inc	Zscaler 股份有限公司	ZS UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,410	1,931,276.57	0.05
212	Nova Ltd	Nova 有限公司	NVMI UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,154	1,928,851.46	0.05
213	Williams Cos Inc/The	威廉姆斯公司	WMB UN	纽约证券交易所	美国	6,140	1,859,738.46	0.05
214	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	西屋制动公司	WAB UN	纽约证券交易所	美国	1,648	1,856,291.94	0.05
215	Smartsheet Inc	Smartsheet 股份有限公司	SMAR UN	纽约证券交易所	美国	5,825	1,829,919.93	0.05
216	Cigna Group/The	信诺集团	CI UN	纽约证券交易所	美国	775	1,825,827.36	0.05
217	Packaging Corp of America	美国包装公司	PKG UN	纽约证券交易所	美国	1,401	1,822,797.12	0.05
218	General Motors Co	通用汽车公司	GM UN	纽约证券交易所	美国	5,475	1,812,833.43	0.05
219	Procter & Gamble Co/The	宝洁	PG UN	纽约证券交易所	美国	1,521	1,787,710.17	0.05
220	ResMed Inc	瑞思迈股份有限公司	RMD UN	纽约证券交易所	美国	1,306	1,781,660.95	0.05
221	Organon & Co	Organon & Co	OGN UN	纽约证券交易所	美国	11,897	1,755,102.07	0.05

				所				
22 2	nVent Electric PLC	nVent Electr ic PLC	NVT UN	纽约证 券交易 所	美国	3,174	1,732,953.69	0.04
22 3	Ovintiv Inc	Ovinti v 股份 有限公 司	OVV UN	纽约证 券交易 所	美国	5,004	1,671,501.71	0.04
22 4	Stifel Financial Corp	斯迪富 融资公 司	SF UN	纽约证 券交易 所	美国	2,767	1,659,425.85	0.04
22 5	BGC Group Inc	BGC Group Inc	BGC UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	27,655	1,635,860.73	0.04
22 6	Catalent Inc	康泰伦 特股份 有限公 司	CTLT UN	纽约证 券交易 所	美国	4,061	1,627,404.99	0.04
22 7	Banco Latinoame ricano de Comercio Exterior SA	拉美出 口银行	BLX UN	纽约证 券交易 所	美国	7,687	1,625,432.72	0.04
22 8	Western Union Co/The	西联汇 款	WU UN	纽约证 券交易 所	美国	18,589	1,618,906.64	0.04
22 9	ONEOK Inc	Oneok 股份有 限公司	OKE UN	纽约证 券交易 所	美国	2,763	1,605,829.46	0.04
23 0	Mettler-T oledo Internati onal Inc	梅特勒 -托利 多国际 股份有 限公司	MTD UN	纽约证 券交易 所	美国	159	1,583,694.76	0.04
23 1	HP Inc	惠普	HPQ UN	纽约证 券交易 所	美国	6,324	1,578,347.31	0.04
23 2	H&R Block Inc	H&R Block 股份有 限公司	HRB UN	纽约证 券交易 所	美国	4,043	1,562,564.37	0.04
23 3	Lantheus Holdings	Lanthe us 控股	LNTH UQ	纳斯达 克证券	美国	2,721	1,556,985.51	0.04

	Inc	股份有 限公司		交易所				
23 4	Federal Signal Corp	联邦信 号公司	FSS UN	纽约证 券交易 所	美国	2,570	1,532,489.34	0.04
23 5	Kinder Morgan Inc	特拉华 州金德 摩根公 司	KMI UN	纽约证 券交易 所	美国	10,784	1,527,117.02	0.04
23 6	Expedia Group Inc	亿客行 集团股 份有限 公司	EXPE UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,692	1,519,256.16	0.04
23 7	Entergy Corp	Enterg y 公司	ETR UN	纽约证 券交易 所	美国	1,970	1,502,258.17	0.04
23 8	Garmin Ltd	佳明有 限公司	GRMN UN	纽约证 券交易 所	美国	1,291	1,498,977.85	0.04
23 9	DT Midstream Inc	DT Midstr eam Inc	DTM UN	纽约证 券交易 所	美国	2,901	1,468,534.37	0.04
24 0	Cabot Corp	卡博特 公司	CBT UN	纽约证 券交易 所	美国	2,225	1,457,111.68	0.04
24 1	Reinsuran ce Group of America Inc	RGA 美 国再保 险公司	RGA UN	纽约证 券交易 所	美国	996	1,457,066.56	0.04
24 2	Insulet Corp	Insule t 股份 有限公 司	PODD UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	991	1,425,244.55	0.04
24 3	Gap Inc/The	Gap 股 份有限 公司	GPS UN	纽约证 券交易 所	美国	8,329	1,418,089.31	0.04
24 4	Ensign Group Inc/The	Ensign 集团股 份有限 公司	ENSG UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,608	1,417,474.34	0.04
24 5	Interacti ve Brokers	盈透证 券集团 股份有	IBKR UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,609	1,405,856.80	0.04

	Group Inc	限公司						
24 6	Marathon Petroleum Corp	马拉松 石油公 司	MPC UN	纽约证 券交易 所	美国	1,131	1,398,320.07	0.04
24 7	Casey's General Stores Inc	凯西杂 货公司	CASY UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	514	1,397,721.13	0.04
24 8	Discover Financial Services	Discover 金融 服务公 司	DFS UN	纽约证 券交易 所	美国	1,493	1,391,859.27	0.04
24 9	CACI Internati onal Inc	CACI 国际公 司	CACI UN	纽约证 券交易 所	美国	450	1,379,452.72	0.04
25 0	Vulcan Materials Co	Vulcan 材料	VMC UN	纽约证 券交易 所	美国	777	1,377,071.37	0.04
25 1	Capital One Financial Corp	第一资 本金融	COF UN	纽约证 券交易 所	美国	1,373	1,354,746.60	0.03
25 2	T Rowe Price Group Inc	普徠仕	TROW UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,644	1,351,024.91	0.03
25 3	Tradeweb Markets Inc	Tradeweb Market s 股份 有限公司	TW UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,749	1,321,265.96	0.03
25 4	American Internati onal Group Inc	美国国 际集团	AIG UN	纽约证 券交易 所	美国	2,497	1,321,146.80	0.03
25 5	Best Buy Co Inc	百思买	BBY UN	纽约证 券交易 所	美国	2,190	1,315,572.36	0.03
25 6	Affirm Holdings Inc	Affirm 控股股 份有限 公司	AFRM UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	6,109	1,315,271.54	0.03
25 7	First Citizens	第一公 民银行	FCNCA UW	纳斯达 克证券	美国	109	1,307,863.94	0.03

	BancShare s Inc/NC	(北卡)		交易所				
25 8	Korn Ferry	光辉国 际	KFY UN	纽约证 券交易 所	美国	2,650	1,268,007.38	0.03
25 9	Cloudflar e Inc	Cloudf lare 股 份有限 公司	NET UN	纽约证 券交易 所	美国	2,148	1,267,991.99	0.03
26 0	Regeneron Pharmaceu ticals Inc	再生元 制药股 份有限 公司	REGN UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	157	1,176,005.45	0.03
26 1	Lamar Advertisi ng Co	拉马尔 广告公 司	LAMR UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,363	1,161,093.91	0.03
26 2	Frontline PLC	Frontl ine 公 共有限 公司	FRO UN	纽约证 券交易 所	美国	6,171	1,132,911.48	0.03
26 3	Coherent Corp	相干公 司	COHR UN	纽约证 券交易 所	美国	2,154	1,112,342.68	0.03
26 4	Westrock Co	WestRo ck 公司	WRK UN	纽约证 券交易 所	美国	3,070	1,099,652.41	0.03
26 5	Griffon Corp	Griffo n 公司	GFF UN	纽约证 券交易 所	美国	2,398	1,091,371.64	0.03
26 6	Fifth Third Bancorp	五三银 行	FITB UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,135	1,075,335.41	0.03
26 7	Builders FirstSour ce Inc	Builde rs FirstS ource 股份有 限公司	BLDR UN	纽约证 券交易 所	美国	1,075	1,060,401.92	0.03
26 8	Incyte Corp	因赛特 公司	INCY UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,443	1,055,441.02	0.03
26 9	Ares Managemen t Corp	阿瑞斯 管理有 限合伙	ARES UN	纽约证 券交易 所	美国	1,106	1,050,545.05	0.03

		企业						
27 0	Texas Pacific Land Corp	德克萨 斯州太 平洋土 地公司	TPL UN	纽约证 券交易 所	美国	200	1,046,599.09	0.03
27 1	FormFacto r Inc	Formfa ctor 股 份有限 公司	FORM UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,416	1,042,226.65	0.03
27 2	Halliburt on Co	哈利伯 顿	HAL UN	纽约证 券交易 所	美国	4,290	1,032,788.77	0.03
27 3	Elevance Health Inc	Elevan ce 健康 股份有 限公司	ELV UN	纽约证 券交易 所	美国	262	1,011,772.70	0.03
27 4	FedEx Corp	联邦快 递	FDX UN	纽约证 券交易 所	美国	462	987,247.67	0.03
27 5	Digital Realty Trust Inc	数字房 地产信 托有限 公司	DLR UN	纽约证 券交易 所	美国	903	978,517.84	0.03
27 6	Macy's Inc	梅西百 货股份 有限公司	M UN	纽约证 券交易 所	美国	7,133	976,040.92	0.03
27 7	Gartner Inc	Gartne r 公司	IT UN	纽约证 券交易 所	美国	298	953,707.52	0.02
27 8	Union Pacific Corp	联合太 平洋	UNP UN	纽约证 券交易 所	美国	586	944,930.72	0.02
27 9	API Group Corp	API 集 团公司	APG UN	纽约证 券交易 所	美国	3,492	936,489.74	0.02
28 0	Barrett Business Services Inc	Barret t Busine ss Servic es 股份 有限公司	BBSI UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,988	931,378.40	0.02

281	Stryker Corp	史赛克	SYK UN	纽约证券交易所	美国	382	926,309.39	0.02
282	Marsh & McLennan Cos Inc	Marsh & McLennan 股份有限公司	MMC UN	纽约证券交易所	美国	609	914,571.41	0.02
283	Wintrust Financial Corp	Wintrust 金融公司	WTFC UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,302	914,547.47	0.02
284	General Dynamics Corp	通用动力	GD UN	纽约证券交易所	美国	442	913,954.23	0.02
285	Archrock Inc	Archrock 有限公司	AROC UN	纽约证券交易所	美国	6,312	909,583.79	0.02
286	Juniper Networks Inc	瞻博网络股份有限公司	JNPR UN	纽约证券交易所	美国	3,446	895,419.42	0.02
287	Airbnb Inc	爱彼迎股份有限公司	ABNB UW	纳斯达克证券交易所	美国	808	873,154.44	0.02
288	Applied Industrial Technologies Inc	应用工业技术公司	AIT UN	纽约证券交易所	美国	630	871,037.50	0.02
289	Benchmark Electronics Inc	基准电子有限公司	BHE UN	纽约证券交易所	美国	3,062	861,106.44	0.02
290	Woodward Inc	伍德沃德公司	WWD UW	纳斯达克证券交易所	美国	691	858,755.03	0.02
291	Xylem Inc/NY	赛莱默公司	XYL UN	纽约证券交易所	美国	871	841,915.47	0.02
292	BellRing Brands Inc	BellRing Brands Inc	BRBR UN	纽约证券交易所	美国	2,061	839,291.45	0.02
293	TechnipFMC PLC	TechnipFMC 公	FTI UN	纽约证券交易所	美国	4,442	827,836.97	0.02

		共有限公司		所				
294	Altair Engineering Inc	Altair Engineering 股份有限公司	ALTR UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,180	824,815.92	0.02
295	Generac Holdings Inc	Generac 控股公司	GNRC UN	纽约证券交易所	美国	864	814,151.95	0.02
296	Ingersoll Rand Inc	英格索兰股份有限公司	IR UN	纽约证券交易所	美国	1,231	796,947.57	0.02
297	Eastman Chemical Co	伊士曼化工	EMN UN	纽约证券交易所	美国	1,134	791,773.08	0.02
298	M&T Bank Corp	M&T 银行	MTB UN	纽约证券交易所	美国	723	779,909.10	0.02
299	Cheniere Energy Inc	Cheniere 能源股份有限公司	LNG UN	纽约证券交易所	美国	623	776,244.57	0.02
300	Exxon Mobil Corp	埃克森美孚石油公司	XOM UN	纽约证券交易所	美国	939	770,390.55	0.02
301	Analog Devices Inc	亚德诺半导体	ADI UW	纳斯达克证券交易所	美国	469	762,952.02	0.02
302	Zoetis Inc	硕腾股份有限公司	ZTS UN	纽约证券交易所	美国	615	759,833.76	0.02
303	ACM Research Inc	ACM Research Inc	ACMR UQ	纳斯达克证券交易所	美国	4,621	759,433.66	0.02
304	DR Horton Inc	霍顿房屋公司	DHI UN	纽约证券交易所	美国	749	752,280.56	0.02
305	Taylor Morrison Home Corp	Taylor Morrison 房屋公司	TMHC UN	纽约证券交易所	美国	1,895	748,733.06	0.02
30	ChampionX	Champi	CHX UW	纳斯达克	美国	3,163	748,622.09	0.02

6	Corp	onx 公司		克证券 交易所				
30 7	Alarm.com Holdings Inc	Alarm.com 控 股股份 有限公司	ALRM UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,640	742,652.47	0.02
30 8	MercadoLi bre Inc	Mercad oLibre 股份有 限公司	MELI UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	63	737,867.54	0.02
30 9	Abercromb ie & Fitch Co	阿贝 克隆比 & 费奇 公司	ANF UN	纽约证 券交易 所	美国	572	724,970.02	0.02
31 0	Hubbell Inc	哈贝 尔公 司	HUBB UN	纽约证 券交易 所	美国	276	718,897.99	0.02
31 1	Maplebear Inc	Maple bear Inc	CART UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,132	717,401.36	0.02
31 2	Appfolio Inc	Appfol io 股份 有限公司	APPF UQ	纳斯达 克证券 交易所	美国	404	704,172.60	0.02
31 3	Guardant Health Inc	Guard ant Health 股份有 限公司	GH UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,331	685,593.03	0.02
31 4	Starbucks Corp	星巴 克	SBUX UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,231	682,985.12	0.02
31 5	Lennox Internati onal Inc	雷诺 士国 际有 限公 司	LII UN	纽约证 券交易 所	美国	178	678,659.79	0.02
31 6	Cars.com Inc	Cars.c om 股份 有限公司	CARS UN	纽约证 券交易 所	美国	4,761	668,434.69	0.02
31 7	AT&T Inc	美国电 话电报 公司	T UN	纽约证 券交易 所	美国	4,864	662,443.47	0.02
31	Elastic	Elasti	ESTC UN	纽约证	美国	816	662,440.05	0.02

8	NV	c 公共 有限责任 公司		券交易 所				
31 9	Bright Horizons Family Solutions Inc	光明地 平线家 庭解决 方案股 份有限 公司	BFAM UN	纽约证 券交易 所	美国	843	661,348.80	0.02
32 0	Newmont Corp	纽蒙黄 金公司	NEM UN	纽约证 券交易 所	美国	2,172	648,122.88	0.02
32 1	Burlingto n Stores Inc	伯灵顿 商店股 份有限 公司	BURL UN	纽约证 券交易 所	美国	378	646,543.30	0.02
32 2	Moody's Corp	穆迪	MCO UN	纽约证 券交易 所	美国	212	635,975.39	0.02
32 3	MKS Instrumen ts Inc	MKS Instru ments 股份有 限公司	MKSI UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	680	632,819.93	0.02
32 4	HNI Corp	HNI 公 司	HNI UN	纽约证 券交易 所	美国	1,968	631,429.92	0.02
32 5	Globus Medical Inc	Globus 医疗公 司	GMED UN	纽约证 券交易 所	美国	1,292	630,643.98	0.02
32 6	DoorDash Inc	DoorDa sh 股份 有限公 司	DASH UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	809	627,179.92	0.02
32 7	Carvana Co	Carvan a 公司	CVNA UN	纽约证 券交易 所	美国	675	619,219.14	0.02
32 8	Lincoln National Corp	林肯国 民	LNC UN	纽约证 券交易 所	美国	2,759	611,514.36	0.02
32 9	ICON PLC	ICON 公 共有限 公司	ICLR UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	273	609,892.37	0.02
33	Doximity	Doximi	DOCS UN	纽约证	美国	3,036	605,185.91	0.02

0	Inc	ty Inc		券交易所				
331	Kirby Corp	Kirby 公司	KEX UN	纽约证券交易所	美国	705	601,570.69	0.02
332	Occidental Petroleum Corp	西方石油	OXY UN	纽约证券交易所	美国	1,313	589,802.49	0.02
333	Entegris Inc	Entegris 股份有限公司	ENTG UW	纳斯达克证券交易所	美国	609	587,665.95	0.02
334	Tencent Music Entertainment Group	腾讯音乐娱乐集团	TME UN	纽约证券交易所	美国	5,864	587,171.35	0.02
335	Integer Holdings Corp	Integer 控股公司	ITGR UN	纽约证券交易所	美国	700	577,648.52	0.01
336	Public Service Enterprise Group Inc	公共服务企业集团	PEG UN	纽约证券交易所	美国	1,093	574,092.96	0.01
337	TopBuild Corp	TopBuild 公司	BLD UN	纽约证券交易所	美国	206	565,622.90	0.01
338	XPO Inc	XPO 股份有限公司	XPO UN	纽约证券交易所	美国	739	559,060.76	0.01
339	Parker-Hannifin Corp	派克汉尼汾公司	PH UN	纽约证券交易所	美国	155	558,745.04	0.01
340	Phillips 66	Phillips 66	PSX UN	纽约证券交易所	美国	554	557,374.06	0.01
341	Zebra Technologies Corp	斑马技术公司	ZBRA UW	纳斯达克证券交易所	美国	249	548,218.90	0.01
342	Vontier Corp	Vontier Corp	VNT UN	纽约证券交易所	美国	2,006	546,120.98	0.01

343	SPX Technologies Inc	SPX 公司	SPXC UN	纽约证券交易所	美国	529	535,878.77	0.01
344	IES Holdings Inc	IES 控股公司	IESC UQ	纳斯达克证券交易所	美国	534	530,249.74	0.01
345	Lennar Corp	Lennar 公司	LEN UN	纽约证券交易所	美国	495	528,706.29	0.01
346	RxSight Inc	RxSight Inc	RXST UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,210	518,871.66	0.01
347	Patrick Industries Inc	Patrick 工业股份有限公司	PATK UW	纳斯达克证券交易所	美国	670	518,321.47	0.01
348	Performance Food Group Co	Performance 食品集团公司	PFGC UN	纽约证券交易所	美国	1,089	513,085.34	0.01
349	Light & Wonder Inc	Light & Wonder Inc	LNW UW	纳斯达克证券交易所	美国	682	509,766.89	0.01
350	Delta Air Lines Inc	达美航空有限公司	DAL UN	纽约证券交易所	美国	1,503	508,157.37	0.01
351	Elanco Animal Health Inc	Elanco 动物健康股份有限公司	ELAN UN	纽约证券交易所	美国	4,895	503,400.45	0.01
352	Target Corp	塔吉特公司	TGT UN	纽约证券交易所	美国	468	493,764.09	0.01
353	Oshkosh Corp	豪士科集团公司	OSK UN	纽约证券交易所	美国	639	492,745.53	0.01
354	Citizens Financial Group Inc	公民金融集团股份有限公司	CFG UN	纽约证券交易所	美国	1,912	490,960.69	0.01
355	Dow Inc	陶氏公司	DOW UN	纽约证券交易所	美国	1,277	482,804.00	0.01

356	IDEXX Laboratories Inc	爱德士股份有限公司	IDXX UW	纳斯达克证券交易所	美国	139	482,632.60	0.01
357	Moderna Inc	莫德纳公司	MRNA UW	纳斯达克证券交易所	美国	566	479,010.05	0.01
358	Assurant Inc	安信龙集团	AIZ UN	纽约证券交易所	美国	388	459,714.23	0.01
359	Chevron Corp	雪佛龙	CVX UN	纽约证券交易所	美国	396	441,450.53	0.01
360	Okta Inc	Okta Inc	OKTA UW	纳斯达克证券交易所	美国	658	438,977.95	0.01
361	Regions Financial Corp	地区金融公司	RF UN	纽约证券交易所	美国	3,057	436,604.02	0.01
362	Chegg Inc	Chegg 股份有限公司	CHGG UN	纽约证券交易所	美国	19,294	434,514.15	0.01
363	DraftKings Inc	DraftKings 股份有限公司	DKNG UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,591	432,799.66	0.01
364	Kinsale Capital Group Inc	Kinsale 资本集团股份有限公司	KNSL UN	纽约证券交易所	美国	157	431,092.72	0.01
365	Broadridge Financial Solutions Inc	布罗德里奇金融解决方案股份有限公司	BR UN	纽约证券交易所	美国	307	431,021.74	0.01
366	Carlyle Group Inc/The	凯雷投资集团	CG UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,500	429,211.53	0.01
367	United Airlines Holdings Inc	美国联合航空控股股份有限公司	UAL UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,232	427,245.39	0.01

368	Evercore Inc	Evercore 股份有限公司	EVR UN	纽约证券交易所	美国	285	423,350.09	0.01
369	Nurix Therapeutics Inc	Nurix Therapeutics Inc	NRIX UQ	纳斯达克证券交易所	美国	2,825	420,180.09	0.01
370	PayPal Holdings Inc	Paypal 控股股份有限公司	PYPL UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,008	416,876.75	0.01
371	Travel + Leisure Co	Travel + Leisure 公司	TNL UN	纽约证券交易所	美国	1,290	413,526.87	0.01
372	Cboe Global Markets Inc	Cboe 环球市场公司	CBOE UF	芝加哥期权交易所	美国	339	410,862.44	0.01
373	NEXTracker Inc	NEXTracker Inc	NXT UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,192	398,252.43	0.01
374	Zions Bancorp NA	锡安银行	ZION UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,271	392,852.52	0.01
375	Mohawk Industries Inc	Mohawk 工业股份有限公司	MHK UN	纽约证券交易所	美国	479	387,766.41	0.01
376	Armstrong World Industries Inc	阿姆斯壮世界工业有限公司	AWI UN	纽约证券交易所	美国	475	383,343.45	0.01
377	Houlihan Lokey Inc	华利安股份有限公司	HLI UN	纽约证券交易所	美国	381	366,186.81	0.01
378	Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc	Ollie's 折扣商店控股股份有限公司	OLLI UQ	纳斯达克证券交易所	美国	521	364,511.38	0.01
379	Wynn Resorts	永利渡假村有	WYNN UW	纳斯达克证券交易所	美国	559	356,557.37	0.01

	Ltd	限公司		交易所				
380	TPG Inc	TPG Inc	TPG UN	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,182	349,169.73	0.01
381	Everest Group Ltd	Everest 集团有 限公司	EG UN	纽约证 券交易 所	美国	128	347,578.03	0.01
382	Cava Group Inc	Cava Group Inc	CAVA UN	纽约证 券交易 所	美国	521	344,386.57	0.01
383	STERIS PLC	思泰瑞 医疗公 共有限 公司	STE UN	纽约证 券交易 所	美国	216	337,957.42	0.01
384	CBIZ Inc	CBIZ 公司	CBZ UN	纽约证 券交易 所	美国	635	335,340.88	0.01
385	Ventas Inc	Ventas 公司	VTR UN	纽约证 券交易 所	美国	908	331,710.35	0.01
386	Charter Communica tions Inc	Charter 通信 公司	CHTR UN	纳斯达 克证券 交易所	美国	155	330,247.36	0.01
387	National HealthCare Corp	国家卫 生保健 公司	NHC UN	纽约证 券交易 所	美国	422	326,014.04	0.01
388	GE HealthCare Technologies Inc	GE Health Care Technologies Inc	GEHC UN	纳斯达 克证券 交易所	美国	581	322,641.07	0.01
389	PROCEPT BioRobotics Corp	PROCEPT BioRobotics Corp	PRCT UN	纳斯达 克证券 交易所	美国	725	315,647.75	0.01
390	Virtu Financial Inc	Virtu 金融股 份有限 公司	VIRT UN	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,898	303,673.66	0.01
391	Primerica Inc	Primerica 股	PRI UN	纽约证 券交易	美国	179	301,804.44	0.01

		份有限公司		所				
39 2	CH Robinson Worldwide Inc	罗宾逊 全球物 流有限 公司	CHRW UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	474	297,678.45	0.01
39 3	Pathward Financial Inc	Pathwa rd金融 股份有 限公司	CASH UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	729	293,905.88	0.01
39 4	Principal Financial Group Inc	信安金 融	PFG UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	506	282,903.31	0.01
39 5	Kyndryl Holdings Inc	Kyndry l Holdin gs Inc	KD UN	纽约证 券交易 所	美国	1,502	281,634.17	0.01
39 6	Tidewater Inc	美国潮 水公司	TDW UN	纽约证 券交易 所	美国	412	279,559.56	0.01
39 7	Walt Disney Co/The	华特迪 士尼公 司	DIS UN	纽约证 券交易 所	美国	390	275,971.79	0.01
39 8	Antero Resources Corp	Antero 资源公 司	AR UN	纽约证 券交易 所	美国	1,177	273,708.39	0.01
39 9	MDU Resources Group Inc	MDU 资 源集团 股份有 限公司	MDU UN	纽约证 券交易 所	美国	1,518	271,543.91	0.01
40 0	Ford Motor Co	福特汽 车	F UN	纽约证 券交易 所	美国	3,021	269,986.99	0.01
40 1	Danaher Corp	丹纳赫	DHR UN	纽约证 券交易 所	美国	148	263,533.39	0.01
40 2	Morningst ar Inc	晨星公 司	MORN UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	124	261,449.51	0.01
40 3	Kemper Corp	Kemper 公司	KMPR UN	纽约证 券交易 所	美国	603	254,968.33	0.01
40 4	Automatic Data	ADP 公 司	ADP UW	纳斯达 克证券	美国	141	239,854.52	0.01

	Processin g Inc			交易所				
40 5	Enphase Energy Inc	Enphas e 能源 股份有 限公司	ENPH UQ	纳斯达 克证券 交易所	美国	337	239,476.66	0.01
40 6	Antero Midstream Corp	Antero 中游公 司	AM UN	纽约证 券交易 所	美国	2,261	237,515.86	0.01
40 7	Badger Meter Inc	Badger Meter 公司	BMI UN	纽约证 券交易 所	美国	177	235,070.01	0.01
40 8	First Solar Inc	福思第 一太阳 能公司	FSLR UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	145	232,987.21	0.01
40 9	Hyatt Hotels Corp	凯悦酒 店集团	H UN	纽约证 券交易 所	美国	211	228,450.43	0.01
41 0	Chemed Corp	Chemed 公司	CHE UN	纽约证 券交易 所	美国	57	220,410.97	0.01
41 1	Acuity Brands Inc	Acuity Brands 股份有 限公司	AYI UN	纽约证 券交易 所	美国	125	215,086.82	0.01
41 2	Ingredion Inc	宜瑞安 公司	INGR UN	纽约证 券交易 所	美国	253	206,813.32	0.01
41 3	Renaissan ceRe Holdings Ltd	复兴再 保险控 股公司	RNR UN	纽约证 券交易 所	美国	113	179,998.95	0.00
41 4	United Rentals Inc	联合租 赁公司	URI UN	纽约证 券交易 所	美国	39	179,755.50	0.00
41 5	Nuvalent Inc	Nuvalent Inc	NUVL UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	306	165,435.55	0.00
41 6	Textron Inc	德事隆	TXT UN	纽约证 券交易 所	美国	262	160,319.65	0.00
41 7	Artivion Inc	Artivion 股份有 限公	AORT UN	纽约证 券交易 所	美国	873	159,586.51	0.00

		司						
418	Ferrari NV	法拉利	RACE UN	纽约证券交易所	美国	52	151,339.31	0.00
419	Ferguson PLC	Ferguson 公共有限公司	FERG UN	纽约证券交易所	美国	108	149,051.32	0.00
420	eBay Inc	eBay 公司	EBAY UW	纳斯达克证券交易所	美国	389	148,929.31	0.00
421	Valvoline Inc	胜牌股份有限公司	VVV UN	纽约证券交易所	美国	456	140,392.26	0.00
422	CDW Corp/DE	特拉华 CDW 公司	CDW UW	纳斯达克证券交易所	美国	84	134,002.08	0.00
423	McDonald's Corp	麦当劳	MCD UN	纽约证券交易所	美国	70	127,133.56	0.00
424	Herc Holdings Inc	Herc 控股公司	HRI UN	纽约证券交易所	美国	131	124,440.98	0.00
425	Eagle Materials Inc	鹰牌材料有限公司	EXP UN	纽约证券交易所	美国	79	122,433.72	0.00
426	Installed Building Products Inc	Installed Building Products 股份有限公司	IBP UN	纽约证券交易所	美国	83	121,664.74	0.00
427	Intercontinental Exchange Inc	洲际交易所 (ICE)	ICE UN	纽约证券交易所	美国	111	108,290.23	0.00
428	Axon Enterprise Inc	Axon Enterprise 股份有限公司	AXON UW	纳斯达克证券交易所	美国	48	100,655.50	0.00
42	Clorox	高乐氏	CLX UN	纽约证	美国	98	95,314.25	0.00

9	Co/The	公司		券交易所				
430	Expeditors International of Washington Inc	华盛顿康捷国际物流公司	EXPD UN	纽约证券交易所	美国	104	92,492.75	0.00
431	Coinbase Global Inc	Coinbase 全球股份有限公司	COIN UW	纳斯达克证券交易所	美国	56	88,692.17	0.00
432	Six Flags Entertainment Corp/DE	六旗娱乐公司	SIX UN	纽约证券交易所	美国	337	79,593.39	0.00
433	Fortinet Inc	Fortinet 股份有限公司	FTNT UW	纳斯达克证券交易所	美国	183	78,604.40	0.00
434	Avantor Inc	Avantor 股份有限公司	AVTR UN	纽约证券交易所	美国	520	78,565.84	0.00
435	Floor & Decor Holdings Inc	Floor&Decor 控股股份有限公司	FND UN	纽约证券交易所	美国	110	77,932.27	0.00
436	Signet Jewelers Ltd	英国西格尼珠宝有限公司	SIG UN	纽约证券交易所	美国	119	75,971.83	0.00
437	FNB Corp/PA	FNB/宾州	FNB UN	纽约证券交易所	美国	778	75,850.82	0.00
438	Sysco Corp	Sysco 公司	SYU UN	纽约证券交易所	美国	138	70,211.95	0.00
439	IQVIA Holdings Inc	艾昆纬	IQV UN	纽约证券交易所	美国	46	69,316.97	0.00
440	iRobot Corp	iRobot 公司	IRBT UW	纳斯达克证券交易所	美国	995	64,600.52	0.00

44 1	Inter Parfums Inc	Inter Parfum s 股份 有限公 司	IPAR UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	78	64,499.96	0.00
44 2	Apellis Pharmaceu ticals Inc	Apelli s 制药 公司	APLS UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	230	62,878.33	0.00
44 3	AeroViron ment Inc	AeroVi ronmen t 股份 有限公 司	AVAV UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	48	62,314.46	0.00
44 4	NIKE Inc	耐克公 司	NKE UN	纽约证 券交易 所	美国	114	61,234.75	0.00
44 5	Crane NXT Co	Crane NXT Co	CXT UN	纽约证 券交易 所	美国	138	60,406.47	0.00
44 6	Phoenix Motor Inc	Phoeni x Motor Inc	PEV UR	纳斯达 克证券 交易所	美国	23,185	55,535.45	0.00
44 7	Snap-on Inc	实耐宝	SNA UN	纽约证 券交易 所	美国	29	54,023.35	0.00
44 8	Travelers Cos Inc/The	旅行家 集团	TRV UN	纽约证 券交易 所	美国	35	50,720.72	0.00
44 9	KeyCorp	KeyCor p 公司	KEY UN	纽约证 券交易 所	美国	461	46,686.31	0.00
45 0	Equitrans Midstream Corp	Equitr ans Midstr eam 公 司	ETRN UN	纽约证 券交易 所	美国	491	45,420.38	0.00
45 1	Avnet Inc	安富利 股份有 限公司	AVT UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	116	42,567.24	0.00
45 2	Albemarle Corp	雅保公 司	ALB UN	纽约证 券交易 所	美国	53	36,079.85	0.00
45	Arcosa	Arcosa	ACA UN	纽约证	美国	57	33,883.44	0.00

3	Inc	Inc		券交易所				
454	Solventum Corp	Solventum 公司	SOLV UN	纽约证券交易所	美国	87	32,787.27	0.00
455	Science Applications International Corp	科学应用国际公司	SAIC UW	纳斯达克证券交易所	美国	37	30,996.95	0.00
456	Victoria's Secret & Co	维多利亚的秘密	VSCO UN	纽约证券交易所	美国	246	30,978.92	0.00
457	Paramount Global	派拉蒙全球	PARA UW	纳斯达克证券交易所	美国	407	30,137.31	0.00
458	Paycom Software Inc	Paycom 软件股份有限公司	PAYC UN	纽约证券交易所	美国	28	28,543.69	0.00
459	Global Payments Inc	环汇有限公司	GPN UN	纽约证券交易所	美国	35	24,120.65	0.00
460	Red Rock Resorts Inc	红岩赌场度假村股份有限公司	RRR UW	纳斯达克证券交易所	美国	61	23,879.98	0.00
461	Shake Shack Inc	Shake Shack 股份有限公司	SHAK UN	纽约证券交易所	美国	32	20,525.18	0.00
462	ON Semiconductor Corp	安森美半导体公司	ON UW	纳斯达克证券交易所	美国	40	19,541.69	0.00
463	QIAGEN NV	德国 QIAGEN 公共有限公司	QGEN UN	纽约证券交易所	美国	62	18,156.09	0.00
464	BILL Holdings Inc	Bill 控股股份有限公司	BILL UN	纽约证券交易所	美国	47	17,625.57	0.00
46	L3Harris	L3Harr	LHX UN	纽约证	美国	11	17,605.90	0.00

5	Technologies Inc	is Technologies 股份有限公司		券交易所				
466	AMC Networks Inc	AMC 网络公司	AMCX UW	纳斯达克证券交易所	美国	210	14,457.43	0.00
467	Crown Holdings Inc	Crown 控股股份有限公司	CCK UN	纽约证券交易所	美国	27	14,314.39	0.00
468	News Corp	新闻集团	NWS UW	纳斯达克证券交易所	美国	69	13,960.76	0.00
469	Assured Guaranty Ltd	美国保证担保有限公司	AGO UN	纽约证券交易所	美国	25	13,745.82	0.00
470	Plug Power Inc	普拉格动力公司	PLUG UR	纳斯达克证券交易所	美国	471	7,821.16	0.00
471	STAG Industrial Inc	STAG 实业公司	STAG UN	纽约证券交易所	美国	19	4,882.86	0.00
472	Berry Global Group Inc	Berry 全球集团股份有限公司	BERY UN	纽约证券交易所	美国	7	2,935.89	0.00
473	Atlassian Corp	Atlassian Corp	TEAM UW	纳斯达克证券交易所	美国	2	2,521.18	0.00
474	MarketAxess Holdings Inc	MarketAxess 控股公司	MKTX UW	纳斯达克证券交易所	美国	1	1,429.14	0.00
475	Conagra Brands Inc	康尼格拉品牌股份有限公司	CAG UN	纽约证券交易所	美国	7	1,417.81	0.00
476	Peloton Interactive Inc	派乐腾	PTON UW	纳斯达克证券交易所	美国	25	602.21	0.00

47 7	Under Armour Inc	安德玛股份有限公司	UAA UN	纽约证券交易所	美国	8	380.29	0.00
---------	------------------	-----------	--------	---------	----	---	--------	------

注：本表所使用的证券代码为彭博代码。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Microsoft Corp	MSFT UW	136,906,513.70	9.18
2	Alphabet Inc	GOOGL UW	96,351,492.46	6.46
2	Alphabet Inc	GOOG UW	39,947,683.08	2.68
3	Apple Inc	AAPL UW	129,323,678.36	8.67
4	Amazon.com Inc	AMZN UW	110,004,944.88	7.38
5	Meta Platforms Inc	META UW	76,687,436.07	5.14
6	Broadcom Inc	AVGO UW	52,362,565.14	3.51
7	Eli Lilly & Co	LLY UN	51,008,969.64	3.42
8	NVIDIA Corp	NVDA UW	48,182,133.25	3.23
9	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	TSM UN	36,504,115.07	2.45
10	Tesla Inc	TSLA UW	36,388,088.53	2.44
11	Costco Wholesale Corp	COST UW	34,931,665.48	2.34
12	AbbVie Inc	ABBV UN	31,703,493.41	2.13
13	QUALCOMM Inc	QCOM UW	30,172,205.81	2.02
14	General Electric Co	GE UN	29,300,628.85	1.97
15	Netflix Inc	NFLX UW	28,669,252.92	1.92
16	Vertiv Holdings Co	VRT UN	25,929,556.80	1.74
17	Dell Technologies Inc	DELL UN	23,564,791.31	1.58
18	Mastercard Inc	MA UN	21,550,686.96	1.45
19	ASML Holding NV	ASML UW	19,770,983.69	1.33
20	Adobe Inc	ADBE UW	18,589,541.10	1.25

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Advanced Micro Devices Inc	AMD UW	22,281,026.77	1.49
2	General Electric Co	GE UN	21,377,276.28	1.43

3	Mastercard Inc	MA UN	17,962,551.26	1.20
4	UnitedHealth Group Inc	UNH UN	14,353,515.12	0.96
5	Home Depot Inc/The	HD UN	14,117,461.07	0.95
6	Tesla Inc	TSLA UW	12,912,349.45	0.87
7	Adobe Inc	ADBE UW	12,241,657.96	0.82
8	Intuit Inc	INTU UW	12,223,170.44	0.82
9	Visa Inc	V UN	12,173,074.39	0.82
10	Salesforce Inc	CRM UN	10,952,690.23	0.73
11	ServiceNow Inc	NOW UN	10,059,770.01	0.67
12	AbbVie Inc	ABBV UN	9,135,627.39	0.61
13	NVIDIA Corp	NVDA UW	8,852,895.44	0.59
14	Palo Alto Networks Inc	PANW UW	8,621,608.52	0.58
15	Caterpillar Inc	CAT UN	8,401,012.56	0.56
16	Marathon Petroleum Corp	MPC UN	8,388,202.29	0.56
17	Walt Disney Co/The	DIS UN	7,655,035.90	0.51
18	Toyota Motor Corp	TM UN	7,451,460.42	0.50
19	Uber Technologies Inc	UBER UN	7,203,525.11	0.48
20	Cigna Group/The	CI UN	6,860,511.41	0.46

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	2,747,010,323.12
卖出收入（成交）总额	979,361,054.95

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

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

无。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

无。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	Technology Select Sector SPDR Fund	ETF	交易型开放式	SSgA Funds Management Inc	3,935,614.45	0.10
2	iMGP DBi Managed Futures Strategy ETF	ETF	交易型开放式	iM Global Partner Fund Management LLC	2,244,290.33	0.06
3	Invesco QQQ Trust Series 1	ETF	交易型开放式	Invesco Capital Management LLC	1,908,717.32	0.05
4	iShares Russell 1000 Value ETF	ETF	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	1,638,818.07	0.04
5	SPDR Gold Shares	ETF	交易型开放式	State Street Global Advisors Inc	1,339,259.28	0.03
6	Global X Robotics & Artificial Intelligence ETF	ETF	交易型开放式	Global X Management Co LLC	1,189,452.23	0.03
7	Invesco Golden Dragon China ETF	ETF	交易型开放式	Invesco Capital Management LLC	881,022.14	0.02
8	iShares Russell 2000 Growth ETF	ETF	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	731,560.53	0.02
9	iShares 20+ Year Treasury Bond ETF	ETF	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	717,545.18	0.02
10	Invesco KBW Bank	ETF	交易型开放式	Invesco Capital	663,433.81	0.02

	ETF			Management LLC		
--	-----	--	--	-------------------	--	--

7.11 投资组合报告附注

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

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

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	569,924.31
4	应收利息	-
5	应收申购款	96,282,838.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	96,852,763.28

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)

嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币	261,710	3,181.95	78,667,107.75	9.45	754,082,084.14	90.55
嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇	642	7,010.86	-	-	4,500,970.38	100.00
合计	262,215	3,192.99	78,667,107.75	9.40	758,583,054.52	90.60

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

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币	410,633.70	0.05
	嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇	130.06	0.00
	合计	410,763.76	0.05

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币	0~10
	嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币	0
	嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇	0

	合计		0
--	----	--	---

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实美国成长股票型证券投资基金 -人民币	嘉实美国成长股票型证券投资基金 -美元现汇
基金合同生效日 (2013年6月14日) 基金份额总额	430,245,997.74	7,592,329.66
本报告期期初基金份额总额	373,719,810.71	4,460,681.52
本报告期基金总申购份额	705,345,928.57	723,887.05
减：本报告期基金总赎回份额	246,316,547.39	683,598.19
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	832,749,191.89	4,500,970.38

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

本报告期内，基金管理人无重大人事变动情况。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
野村证券 NOMURA	-	3,535,106,775.76	95.44	1,058,135.83	96.29	-
招商证券 (香港)有限公司 China Merchants Securities (HK) Co., Ltd.	-	116,159,788.22	3.14	31,539.82	2.87	新增
瑞银集团 Union Bank of Switzerland	-	52,903,155.40	1.43	9,247.66	0.84	-
Wolfe Research Securities	-	-	-	-	-	-
德意志银行股份有限公司 Deutsche Bank	-	-	-	-	-	-

花旗环球 金融亚洲 有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited	-	-	-	-	-	-
金贝塔证 券有限公 司 iGoldenbe ta Sec urities Company Limited	-	-	-	-	-	-
麦格理资 本证券股 份有限公 司 Macquarie Secur ities Gr oup	-	-	-	-	-	-
瑞士信贷 （香港）有 限公司 Credit S uisse （Hong Ko ng） Limi ted	-	-	-	-	-	-
中信证券 国际有限 公司 CITIC Se curities Inter national Company Limited	-	-	-	-	-	-
麦格理银 行有限公 司香港分 行	-	-	-	-	-	-

Macquaire Bank Limited Hong K ong Bran ch.						
---	--	--	--	--	--	--

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

2. 交易单元的选择标准和程序

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
野村证券 NOMURA	-	-	-	-	-	-	46,419,277.68	10.0
招商证券（香港）有限公司 China Merchants Securities (HK) Co., Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-

瑞银集团 Union Bank of Switzerland	-	-	-	-	-	-	-	-
Wolfe Research Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
德意志银行股份有限公司 Deutsche Bank	-	-	-	-	-	-	-	-
花旗环球金融亚洲有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
金贝塔证券有限公司 iGoldenbeta Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
麦格理资本证券股份有限公司 Macquarie Securities Group	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞士信贷（香港）有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券国际有限公司 CITIC Securities International Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
麦格理银行有限公司香港分行 Macquarie Bank Limited Hong Kong Branch.	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于嘉实美国成长股票（QDII）2024年1月15日暂停申购、赎回及定投业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024年1月11日
2	关于嘉实美国成长股票（QDII）2024年2月19日暂停申购、赎回及定投业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024年2月7日
3	嘉实美国成长股票型证券投资基金暂停大额申购（含定期定额投资）业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024年3月23日
4	关于嘉实美国成长股票（QDII）2024年3月29日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024年3月27日
5	关于嘉实美国成长股票（QDII）2024年5月27日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024年5月23日
6	关于嘉实美国成长股票（QDII）2024年6月19日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024年6月17日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

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

11.2 存放地点

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

11.3 查阅方式

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

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

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

嘉实基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日