

大成标普 500 等权重指数证券投资基金

2021 年年度报告

2021 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：2022 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2022 年 03 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所(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 2021 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	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 过去三年基金的利润分配情况	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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	10
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.10 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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
§ 6 审计报告	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
7.4 报表附注	21

§ 8 投资组合报告	43
8.1 期末基金资产组合情况	43
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	43
8.3 期末按行业分类的权益投资组合	43
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	44
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动	93
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	94
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	95
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	95
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	95
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	95
8.11 投资组合报告附注	95
§ 9 基金份额持有人信息	96
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	96
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	96
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	96
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	96
§ 10 开放式基金份额变动	96
§ 11 重大事件揭示	97
11.1 基金份额持有人大会决议	97
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	97
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	97
11.4 基金投资策略的改变	97
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	97
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	97
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	98
11.8 其他重大事件	98
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	101
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	101
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	101
§ 13 备查文件目录	101
13.1 备查文件目录	101
13.2 存放地点	101
13.3 查阅方式	101

§ 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	168,582,964.25 份
基金合同存续期	不定期

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）
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	赵冰
	联系电话	0755-83183388
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn
客户服务电话	4008885558	95566
传真	0755-83199588	010-66594942
注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518040	100818
法定代表人	吴庆斌	刘连舸

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		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

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	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	大成基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 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	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	21,808,738.98	5,584,537.97	5,615,278.53
本期利润	60,436,126.60	4,806,772.16	43,451,252.78
加权平均基金份额本期利润	0.3922	0.0374	0.4319
本期加权平均净值利润率	17.92%	2.13%	23.62%
本期基金份额净值增长率	22.67%	0.78%	26.98%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	108,719,563.02	62,650,677.05	70,433,834.44
期末可供	0.6449	0.5571	0.5765

分配基金份额利润			
期末基金资产净值	393,391,795.17	220,063,390.01	244,379,635.95
期末基金份额净值	2.334	1.957	2.000
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	184.38%	131.82%	130.02%

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。

4、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。截至本报告期末，本基金美元份额无份额持有人。

3.2 基金净值表现

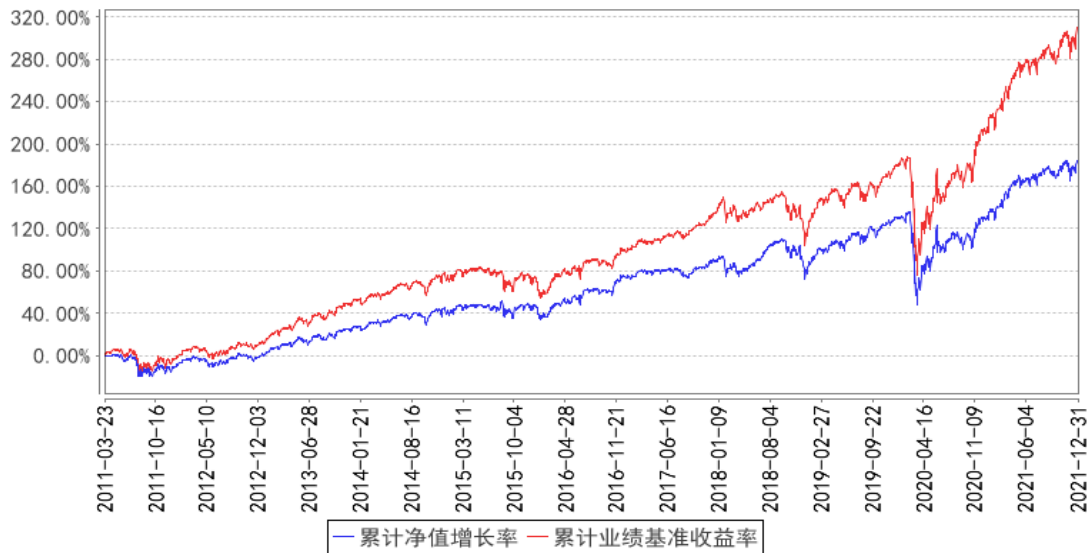
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	6.24%	0.90%	9.01%	0.95%	-2.77%	-0.05%
过去六个月	6.04%	0.82%	8.76%	0.85%	-2.72%	-0.03%
过去一年	22.67%	0.86%	29.63%	0.88%	-6.96%	-0.02%

过去三年	56.99%	1.51%	89.03%	1.58%	-32.04%	-0.07%
过去五年	64.29%	1.27%	107.59%	1.32%	-43.30%	-0.05%
自基金合同生效起至今	184.38%	1.13%	309.75%	1.19%	-125.37%	-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

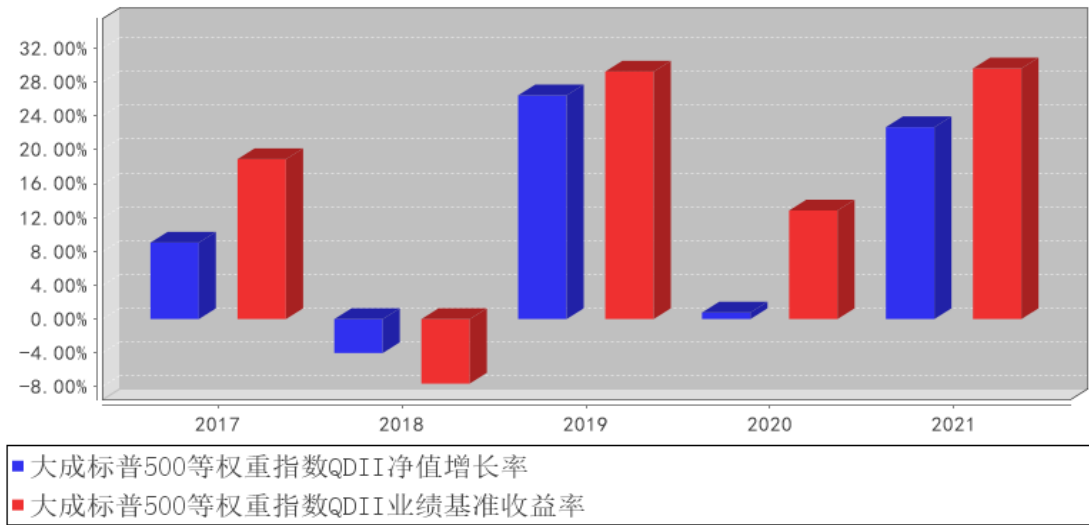


注：1、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

2、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

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
2021 年	0.558	2,964,070.69	3,177,393.59	6,141,464.28	-
2020 年	0.580	2,487,553.99	4,779,031.88	7,266,585.87	-
2019 年	0.577	2,826,145.96	3,203,063.51	6,029,209.47	-
合计	1.7150	8,277,770.64	11,159,488.98	19,437,259.62	-

§ 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经中国证监会证监基金字[1999]10号文批准，于1999年4月12日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本为2亿元人民币，注册地为深圳。目前公司由三家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。公司业务资质齐全，是全国同时具有境内、境外社保基金管理人资格和基本养老保险基金管理人资格的四家基金公司之一，全面涵盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理、私募股权投资等业务，旗下大成国际资产管理公司具备QFII、RQFII等资格。

历经22年的发展，大成基金形成了以长期投资能力为核心竞争优势，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。目前已形成权益、固定收益、量化投资、商品期货、境外投资、大类资产配置等六大投资团队，全面覆盖各类投资领域。

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	-	18年	英国曼彻斯特大学商学院金融学硕士。2003年4月至2004年6月就职于国信证券研究部，任研究员。2004年6月至2005年9月就职于华西证券研究部，任高级研究员。2005年9月加入大成基金管理有限公司，曾担任金融工程师、境外市场研究员及基金经理助理，现任国际业务部基金经理。2011年8月26日起任大成标普500等权重指数型证券投资基金基金经理。2014年11月13日起任大成纳斯达克100指数证券投资基金基金经理。2016年12月2日起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。具有基金从业资格。国籍：中国

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

无。

4.3 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》、《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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合间连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 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，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大，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。

4.4.2.1 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。

4.4.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在 4 笔同日反向交易，原因为流动性需要或合规比例调整。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5% 的情形；主动投资组合间债券交易存在 11 笔同

日反向交易，原因为流动性需要或合规比例调整。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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年，总体上来看，全球经济状况要好于 2020 年，其根本原因是新冠疫苗得以在发达国家广泛接种，因此新冠病毒对经济的拖累明显减弱，使得以美国为首的发达国家的宏观经济出现了报复性反弹。

2021 年，为了推动经济的恢复，美国政府推出了多项经济刺激政策，这些政策有一部分已经对经济增长起到了较好的短期刺激作用，另外一部分有望在未来较长的时间内对美国经济产生长期的积极作用。与此同时，美联储也基本保持了宽松的货币政策，一定程度上促进了经济的繁荣。

在上述两种因素的叠加作用下，2021 年美国宏观经济获得了较为快速的增长，其全年 GDP 同比增速为 5.5%，其四个季度的 GDP 环比增速折年率分别为 6.3%、6.7%、2.3%及 6.9%。宏观经济的各个分项指标也基本上都有较好的表现，消费快速增长、失业率持续下降、PMI 指标也持续保持在较高的水平区间。

在 2021 年，美国还遭遇了 Delta 变异病毒疫情及 Omicron 变异病毒疫情。这两轮疫情虽然较为严重，但是其对经济的负面影响程度却显著小于 2020 年的新冠疫情，影响时间也相对较短。

在宏观经济持续向好的同时，受宽松的货币政策推动，美国的通胀水平也在不断提升，4 季度以来的 CPI 同比增速都超过了 6%。为了应对不断提高的通胀率，美联储的货币政策立场也迅速转为鹰派，这也导致了年末美股市场的震荡。

在良好的宏观经济环境下，美国企业盈利也取得了高速增长，而美股上市公司盈利的超预期增长也是全年美股得以持续上行并屡创新高的核心动力。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 2.334 元；本报告期基金份额净值增长率为 22.67%，业绩比较基准收益率为 29.63%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年，新冠疫情可能还会出现反复，但是其对经济的影响程度及时间长度有望得到控制。因此，总体来看，美国宏观经济仍然有望保持较好的增长速度，上市公司盈利水平也有望继续提升。

2022 年，美联储的货币政策可能会成为市场关注的焦点。美联储将从 2022 年 3 月起停止量化宽松政策，并在年内择机进行缩表，同时市场预期年内美联储将会有 3-4 次的加息行为。这些

货币政策有可能在短期引起美股市场的波动，但是，从长期来看，美股上市公司盈利的变动才是决定美股走势的最关键因素。

本基金为被动型指数基金，其投资目标就是要复制指数的收益率。本基金将坚持被动型的指数化投资理念，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。

4.7 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。

4.8 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。估值委员会由股票投资部、研究部、固定收益总部、权益专户投资部、指数与期货投资部、大类资产配置部、交易管理部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部指定人员组成。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，估值委员会成员中包括五名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、权益专户投资部、指数与期货投资部、大类资产配置部、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，并负责与托管行沟通估值调整事项；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，并与托管银行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行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同业市场的估值数据，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。

4.9 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 等权重指数证券投资基金已分配利润 6,141,464.28 元（每十份基金份额分红 0.5580 元），符合基金合同规定的分红比例。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本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 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>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了大成标普 500 等权重指数证券投资基金(以下简称“大成标普 500 等权重指数 QDII 基金”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</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 QDII 基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	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。

	<p>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。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> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于大成标普 500 等权重指数 QDII 基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>大成标普 500 等权重指数 QDII 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 QDII 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 QDII 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 QDII 基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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>(一) 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>(二) 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>(三) 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>(四) 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 QDII 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</p>

	<p>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 QDII 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、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	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张振波 赵钰
会计师事务所的地址	上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
审计报告日期	2022 年 3 月 28 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：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	25,789,733.91	14,491,186.45
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	371,193,451.91	208,686,583.77
其中：股票投资		371,193,451.91	208,686,583.77
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	499.87	423.34
应收股利		381,084.98	253,532.40
应收申购款		1,015,822.23	856,800.52
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	196,351.92
资产总计		398,380,592.90	224,484,878.40
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			

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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		4,499,883.43	3,992,648.84
应付管理人报酬		328,450.39	187,436.06
应付托管费		82,112.59	46,858.97
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	78,351.32	194,544.52
负债合计		4,988,797.73	4,421,488.39
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	168,582,964.25	112,448,859.42
未分配利润	7.4.7.10	224,808,830.92	107,614,530.59
所有者权益合计		393,391,795.17	220,063,390.01
负债和所有者权益总计		398,380,592.90	224,484,878.40

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.334 元，基金份额总额 168,582,964.25 份。

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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		65,148,658.01	8,129,633.68
1. 利息收入		36,772.58	46,096.21
其中：存款利息收入	7.4.7.11	36,772.58	46,096.21
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填		26,728,338.39	9,302,664.30

列)			
其中：股票投资收益	7.4.7.12	21,149,765.98	4,748,763.64
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收 益	7.4.7.14.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	5,578,572.41	4,553,900.66
3. 公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	7.4.7.18	38,627,387.62	-777,765.81
4. 汇兑收益（损失以“-”号 填列）		-566,803.32	-883,299.28
5. 其他收入（损失以“-”号 填列）	7.4.7.19	322,962.74	441,938.26
减：二、费用		4,712,531.41	3,322,861.52
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,356,787.70	2,265,819.16
2. 托管费	7.4.10.2.2	839,197.00	566,454.83
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	88,271.10	84,403.98
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支 出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.21	428,275.61	406,183.55
三、利润总额（亏损总额以“-” 号填列）		60,436,126.60	4,806,772.16
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		60,436,126.60	4,806,772.16

7.3 所有者权益（基金净值）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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者 权益（基金净值）	112,448,859.42	107,614,530.59	220,063,390.01
二、本期经营活 动产生的基金净	-	60,436,126.60	60,436,126.60

值变动数（本期净利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	56,134,104.83	62,899,638.01	119,033,742.84
其中：1. 基金申购款	183,558,840.42	211,130,499.36	394,689,339.78
2. 基金赎回款	-127,424,735.59	-148,230,861.35	-275,655,596.94
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-6,141,464.28	-6,141,464.28
五、期末所有者权益（基金净值）	168,582,964.25	224,808,830.92	393,391,795.17
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	122,182,590.21	122,197,045.74	244,379,635.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	4,806,772.16	4,806,772.16
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-9,733,730.79	-12,122,701.44	-21,856,432.23
其中：1. 基金申购款	201,071,418.43	137,521,082.67	338,592,501.10
2. 基金赎回款	-210,805,149.22	-149,643,784.11	-360,448,933.33
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-7,266,585.87	-7,266,585.87

五、期末所有者 权益(基金净值)	112,448,859.42	107,614,530.59	220,063,390.01
---------------------	----------------	----------------	----------------

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

温智敏

刘亚林

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《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）。

本财务报表由本基金的基金管理人大成基金管理有限公司于 2022 年 3 月 28 日批准报出。

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》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年度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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值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

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类

应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。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。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

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于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资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

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且 2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

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认列。

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基金净值比例计算的金额。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基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,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股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,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在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他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所有者权益转出。

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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 14 号—收入》，本基金于 2021 年 1 月 1 日起执行。本基金在编制 2021 年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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[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。

(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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	25,789,733.91	14,491,186.45
定期存款	-	-
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	-	-
合计	25,789,733.91	14,491,186.45

注：于本期末，活期存款中包括的外币余额为美元活期存款 3,365,108.52 元，折合人民币 21,454,922.39 元(上年度末：活期存款中包括的外币余额为美元活期存款 1,039,070.10 元，折合人民币 6,779,828.50 元)。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	300,349,015.67	371,193,451.91	70,844,436.24
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	300,349,015.67	371,193,451.91	70,844,436.24
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	176,469,535.15	208,686,583.77	32,217,048.62
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	176,469,535.15	208,686,583.77	32,217,048.62

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

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。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	499.87	423.34
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	-	-
合计	499.87	423.34

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
其他应收款	-	-
待摊费用	-	196,351.92
合计	-	196,351.92

7.4.7.7 应付交易费用

无。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	14,859.35	12,366.83
应付证券出借违约金	-	-
其他	3,491.97	2,177.69

预提费用	60,000.00	180,000.00
合计	78,351.32	194,544.52

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	112,448,859.42	112,448,859.42
本期申购	183,558,840.42	183,558,840.42
本期赎回（以“-”号填列）	-127,424,735.59	-127,424,735.59
- 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	168,582,964.25	168,582,964.25

注：注：申购含红利再投份额(如有)。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	62,650,677.05	44,963,853.54	107,614,530.59
本期利润	21,808,738.98	38,627,387.62	60,436,126.60
本期基金份额交易产生的变动数	30,401,611.27	32,498,026.74	62,899,638.01
其中：基金申购款	102,438,213.52	108,692,285.84	211,130,499.36
基金赎回款	-72,036,602.25	-76,194,259.10	-148,230,861.35
本期已分配利润	-6,141,464.28	-	-6,141,464.28
本期末	108,719,563.02	116,089,267.90	224,808,830.92

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
	活期存款利息收入	33,147.80
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	3,624.78	83.64
合计	36,772.58	46,096.21

7.4.7.12 股票投资收益

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	97,440,671.03	147,869,045.25
减：卖出股票成本总额	76,290,905.05	143,120,281.61
买卖股票差价收入	21,149,765.98	4,748,763.64

7.4.7.13 基金投资收益

无。

7.4.7.14 债券投资收益

无。

7.4.7.15 贵金属投资收益

无。

7.4.7.16 衍生工具收益

无。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	5,578,572.41	4,553,900.66
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	5,578,572.41	4,553,900.66

7.4.7.18 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
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	38,627,387.62	-777,765.81
股票投资	38,627,387.62	-777,765.81
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	38,627,387.62	-777,765.81

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
基金赎回费收入	322,962.74	441,938.26
合计	322,962.74	441,938.26

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	88,271.10	84,403.98
银行间市场交易费用	-	-
合计	88,271.10	84,403.98

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	232,829.74	211,630.16
银行划款手续费	13,486.96	12,425.31
其他	1,958.91	2,128.08
合计	428,275.61	406,183.55

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数数据使用费及标的指数许可使用费，其中标的指数数据使用费按每年 8,400 美元收取，按年支付；标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按年支付，标的指数许可使用费的收取下限为每年 25,000.00

美元。

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 2022 年 1 月 18 日宣告 2021 年度第 1 次分红，向截至 2022 年 1 月 20 日止在本基金注册登记人大成基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.6460 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、基金销售机构、注册登记机构
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（“中国银行（香港）有限公司”）	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
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,356,787.70	2,265,819.16
其中：支付销售机构的客户维护费	1,134,836.60	917,176.36

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

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.00\% / \text{当年天数}。$$

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
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	839,197.00	566,454.83

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

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

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

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固有资金投资本基金的情况

无。

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 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	4,335,222.05	33,147.80	7,711,770.39	46,012.57
中银香港	21,454,511.86	-	6,779,416.06	-

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，存放于基金托管人的银行存款按银行同业利率计息，存放于境外资产托管人的银行存款不计息。

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

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	2021年01	-	2021年1月	0.5580	2,964,070.69	3,177,393.59	6,141,464.28	-

	月 18 日		15 日					
合计	-	-	-	0.5580	2,964,070.69	3,177,393.59	6,141,464.28	-

7.4.12 期末(2021 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及境外次托管人中银香港，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在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，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。

于本期末，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 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,335,222.05	-	-	21,454,511.86	25,789,733.91
交易性金融资产	-	-	-	371,193,451.91	371,193,451.91
应收利息	-	-	-	499.87	499.87
应收股利	-	-	-	381,084.98	381,084.98
应收申购款	-	-	-	1,015,822.23	1,015,822.23
资产总计	4,335,222.05	-	-	394,045,370.85	398,380,592.90
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,499,883.43	4,499,883.43
应付管理人报酬	-	-	-	328,450.39	328,450.39
应付托管费	-	-	-	82,112.59	82,112.59

其他负债	-	-	-	78,351.32	78,351.32
负债总计	-	-	-	4,988,797.73	4,988,797.73
利率敏感度缺口	4,335,222.05	-	-	-389,056,573.12	393,391,795.17
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,711,770.39	-	-	6,779,416.06	14,491,186.45
交易性金融资产	-	-	-	-208,686,583.77	208,686,583.77
应收利息	-	-	-	423.34	423.34
应收股利	-	-	-	253,532.40	253,532.40
应收申购款	-	-	-	856,800.52	856,800.52
其他资产	-	-	-	196,351.92	196,351.92
资产总计	7,711,770.39	-	-	-216,773,108.01	224,484,878.40
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,992,648.84	3,992,648.84
应付管理人报酬	-	-	-	187,436.06	187,436.06
应付托管费	-	-	-	46,858.97	46,858.97
其他负债	-	-	-	194,544.52	194,544.52
负债总计	-	-	-	4,421,488.39	4,421,488.39
利率敏感度缺口	7,711,770.39	-	-	-212,351,619.62	220,063,390.01

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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（上年度末：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（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 2021 年 12 月 31 日			合计
	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	
以外币计价的 资产				

银行存款	21,454,922.39	-	-	21,454,922.39
交易性金融资产	371,193,451.91	-	-	371,193,451.91
应收股利	381,084.98	-	-	381,084.98
资产合计	393,029,459.28	-	-	393,029,459.28
以外币计价的负债				
其他负债	3,491.97	-	-	3,491.97
负债合计	3,491.97	-	-	3,491.97
资产负债表外 汇风险敞口净额	393,025,967.31	-	-	393,025,967.31
	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
项目	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
银行存款	6,779,828.50	-	-	6,779,828.50
交易性金融资产	208,686,583.77	-	-	208,686,583.77
应收股利	253,532.40	-	-	253,532.40
应收利息	1.83	-	-	1.83
资产合计	215,719,946.50	-	-	215,719,946.50
以外币计价的 负债				
其他负债	2,177.69	-	-	2,177.69

负债合计	2,177.69	-	-	2,177.69
资产负债表外 外汇风险敞口净 额	215,717,7 68.81	-	-	215,717,768.81

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		
	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（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月 31日）
分析	美元相对人民币升值 5%	19,651,298.37	10,785,888.44
	美元相对人民币贬值 5%	-19,651,298.37	-10,785,888.44

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 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 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	371,193,451.91	94.36	208,686,583.77	94.83
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	371,193,451.91	94.36	208,686,583.77	94.83

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		
	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 (2021 年 12 月 31 日)	上年度末 (2020 年 12 月 31 日)
分析	业绩比较基准上升 5%	18,714,551.54	10,417,531.48
	业绩比较基准下降 5%	-18,714,551.54	-10,417,531.48

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本期末，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中属于第一层次的余额为 371,193,451.91 元，无属于第二或第三层次的余额（上年度末：第一层次 208,686,583.77 元，无第二或第三层次）。

(ii) 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，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股票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，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（上年度末：同）。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”）相关衔接规定，以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021 年的比较数据将不作重述。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外，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	371,193,451.91	93.18
	其中：普通股	371,193,451.91	93.18
	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	25,789,733.91	6.47
8	其他各项资产	1,397,407.08	0.35
9	合计	398,380,592.90	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	371,193,451.91	94.36
合计	371,193,451.91	94.36

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 (%)
金融	49,231,870.56	12.51
通信服务	17,088,316.94	4.34
房地产	22,212,520.03	5.65
能源	14,845,010.23	3.77
公用事业	21,167,892.13	5.38
非日常生活消费品	43,654,837.14	11.10

工业	52,468,642.80	13.34
日常消费品	24,238,382.27	6.16
信息技术	56,062,441.67	14.25
医疗保健	48,726,841.09	12.39
原材料	20,955,927.65	5.33
合计	370,652,682.51	94.22

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

8.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
金融	-	-
通信服务	-	-
房地产	-	-
能源	-	-
公用事业	-	-
非日常生活消费品	-	-
工业	540,769.40	0.14
日常消费品	-	-
信息技术	-	-
医疗保健	-	-
原材料	-	-
合计	540,769.40	0.14

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	CERNER CORP	塞纳公司	CERN UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,486	879,877.33	0.22
2	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	CF 工业控股股份有限公司	CF UN	美国纽约证券交易所	美国	1,906	860,124.52	0.22
3	ABIOMED INC	Abiomed 股份有限公司	ABMD UQ	纳斯达克证券交易所	美国	371	849,575.22	0.22

		司						
4	ELI LILLY & CO	礼来	LLY UN	美国纽约证券交易所	美国	479	843,564.91	0.21
5	CITRI X SYSTE MS INC	思杰系统	CTXS UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,393	840,086.91	0.21
6	ARIST A NETWO RKS INC	Arista 网络股份有限公司	ANET UN	美国纽约证券交易所	美国	905	829,438.72	0.21
7	ACTIV ISION BLIZZ ARD INC	动视暴雪股份有限公司	ATVI UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,938	822,051.77	0.21
8	SBA COMMU NICAT IONS CORP	SBA 通信公司	SBAC UQ	纳斯达克证券交易所	美国	331	820,970.96	0.21
9	COGNI ZANT TECH SOLUT IONS- A	高知特 科技公司	CTSH UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,451	820,761.20	0.21
10	PUBLI C STORA GE	公共存 储公司	PSA UN	美国纽约证券交易所	美国	342	816,724.11	0.21
11	FORTI NET INC	飞塔股 份有限 公司	FTNT UQ	纳斯达克证券交易所	美国	356	815,747.86	0.21
12	INCYT E CORP	因赛特 公司	INCY UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,736	812,407.00	0.21
13	PFIZE R INC	辉瑞制 药	PFE UN	美国纽约证券交易所	美国	2,151	809,819.42	0.21
14	AMERI SOURC	美源伯 根	ABC UN	美国纽约证券交易所	美国	951	805,750.70	0.20

	EBERGEN CORP			交易所				
15	PROGRESSIVE CORP	前进保险公司	PGR UN	美国纽约证券交易所	美国	1,231	805,647.16	0.20
16	IRON MOUNTAIN INC	美国铁山公司	IRM UN	美国纽约证券交易所	美国	2,412	804,740.60	0.20
17	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	亿滋国际	MDLZ UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,903	804,536.39	0.20
18	DOLLAR GENERAL CORP	达乐公司	DG UN	美国纽约证券交易所	美国	535	804,416.01	0.20
19	LAMB WESTON HOLDINGS INC	蓝威斯顿控股股份有限公司	LW UN	美国纽约证券交易所	美国	1,990	804,142.81	0.20
20	LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	Live Nation 娱乐公司	LYV UN	美国纽约证券交易所	美国	1,053	803,552.23	0.20
21	NRG ENERGY INC	NRG 能源股份有限公司	NRG UN	美国纽约证券交易所	美国	2,922	802,571.59	0.20
22	BIO-TECHNE	BIO-TECHNE	TECH UQ	纳斯达克证券交易所	美国	243	801,512.33	0.20
23	BRISTOL-MYERS	百时美施贵宝公司	BMY UN	美国纽约证券交易所	美国	2,015	801,012.66	0.20

	SQUIB B CO							
24	CISCO SYSTE MS INC	思科-T	CSCO UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,973	797,147.46	0.20
25	ARCHE R-DAN IELS- MIDLA ND CO	Archer -Danie ls-Mid land 公司	ADM UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,847	795,934.29	0.20
26	PAYCH EX INC	Payche x 公司	PAYX UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	914	795,438.71	0.20
27	PPG INDUS TRIES INC	PPG 工 业	PPG UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	723	794,884.79	0.20
28	ATMOS ENERG Y CORP	美国阿 特摩斯 能源公 司	ATO UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,188	793,562.72	0.20
29	REALT Y INCOM E CORP	Realty Income 公司	O UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,738	793,286.40	0.20
30	WESTE RN DIGIT AL CORP	西部数 据公司	WDC UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,908	793,268.93	0.20
31	WATER S CORP	沃特世 公司	WAT UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	333	791,070.08	0.20
32	CIGNA CORP	信诺集 团	CI UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	540	790,588.08	0.20
33	BAXTE R INTER NATIO NAL INC	百特	BAX UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,444	790,286.89	0.20
34	ACCEN TURE	埃森哲 公司	ACN UN	美 国 纽 约 证 券	美国	299	790,270.88	0.20

	PLC-C L A			交易所				
35	METTL ER-TO LEDO INTER NATIO NAL	梅特勒 -托利 多国际 股份有 限公	MTD UN	美国纽 约证券 交易所	美国	73	789,925.83	0.20
36	ALLST ATE CORP	全州保 险	ALL UN	美国纽 约证券 交易所	美国	1,051	788,356.26	0.20
37	MICRO N TECHN OLOGY INC	美光科 技股份 有限公 司	MU UQ	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,327	788,100.60	0.20
38	QUEST DIAGN OSTIC S INC	Quest Diagno stics 股份有 限公	DGX UN	美国纽 约证券 交易所	美国	714	787,584.74	0.20
39	FREEP ORT-M CMORA N INC	自由港 迈克墨 伦股份 有限公 司	FCX UN	美国纽 约证券 交易所	美国	2,960	787,531.56	0.20
40	WEST PHARM ACEUT ICAL SERVI CES	西氏医 药服务 公司	WST UN	美国纽 约证券 交易所	美国	263	786,440.24	0.20
41	EXTRA SPACE STORA GE INC	额外空 间仓储 公司	EXR UN	美国纽 约证券 交易所	美国	544	786,385.98	0.20
42	BERKS HIRE HATHA WAY INC-C L B	伯克希 尔哈撒 韦公司	BRK/B UN	美国纽 约证券 交易所	美国	412	785,409.73	0.20
43	PUBLI C	公共服 务企业	PEG UN	美国纽 约证券	美国	1,844	784,530.65	0.20

	SERVICE ENTERPRISE GP	集团		交易所				
44	KIMBERLY-C LARK CORP	金佰利	KMB UN	美国纽约证券交易所	美国	860	783,644.94	0.20
45	EXPEDIA GROUP INC	亿客行集团股份有限公司	EXPE UQ	纳斯达克证券交易所	美国	680	783,507.22	0.20
46	COLGATE-PALMOLIVE CO	高露洁棕榄	CL UN	美国纽约证券交易所	美国	1,436	781,330.81	0.20
47	ABBVIE INC	艾伯维生物制药公司	ABBV UN	美国纽约证券交易所	美国	905	781,259.15	0.20
48	CROWNCASTLE INTL CORP	冠城国际公司	CCI UN	美国纽约证券交易所	美国	587	781,216.94	0.20
49	IDEX LABORATORIES INC	爱德士股份有限公司	IDXX UQ	纳斯达克证券交易所	美国	186	780,854.68	0.20
50	AT&T INC	美国电话电报公司	T UN	美国纽约证券交易所	美国	4,972	779,819.52	0.20
51	EASTMAN CHEMICAL CO	伊士曼化工	EMN UN	美国纽约证券交易所	美国	1,010	778,594.75	0.20
52	DAVITA INC	DaVita 股份有限公司	DVA UN	美国纽约证券交易所	美国	1,073	778,246.51	0.20
53	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	慧与	HPE UN	美国纽约证券交易所	美国	7,732	777,412.31	0.20

54	GLOBA L PAYME NTS INC	环汇有 限公司	GPN UN	美国纽 约证券 交易所	美国	902	777,404.15	0.20
55	KIMCO REALT Y CORP	Kimco 房地产 公司	KIM UN	美国纽 约证券 交易所	美国	4,946	777,318.33	0.20
56	LABOR ATORY CRP OF AMER HLDGS	美国实 验控股	LH UN	美国纽 约证券 交易所	美国	388	777,283.77	0.20
57	ANTHE M INC	Anthem 股份有 限公司	ANTM UN	美国纽 约证券 交易所	美国	263	777,268.09	0.20
58	DOMIN O'S PIZZA INC	达美乐 披萨公 司	DPZ UN	美国纽 约证券 交易所	美国	216	777,167.74	0.20
59	MONST ER BEVER AGE CORP	怪兽饮 料公司	MNST UQ	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,268	776,424.59	0.20
60	ROLLI NS INC	Rollin s 公司	ROL UN	美国纽 约证券 交易所	美国	3,559	776,263.09	0.20
61	TAKE- TWO INTER ACTIV E SOFTW RE	Take-T wo 互 动软件 股份有 限公司	TTWO UQ	纳斯达 克证券 交易所	美国	685	776,166.24	0.20
62	AMERI CAN TOWER CORP	美国发 射塔公 司	AMT UN	美国纽 约证券 交易所	美国	416	775,795.18	0.20
63	CHURC H & DWIGH T CO INC	切迟杜 威股份 有限公司	CHD UN	美国纽 约证券 交易所	美国	1,187	775,715.48	0.20

64	EXELON CORP	Exelon 公司	EXC UQ	纳斯达克证券交易所	美国	2,106	775,556.47	0.20
65	AMERICAN WATER WORKS CO INC	美国自来水股份有限公司	AWK UN	美国纽约证券交易所	美国	644	775,449.87	0.20
66	MGM RESORTS INTERNATIONAL	美高梅国际酒店集团	MGM UN	美国纽约证券交易所	美国	2,710	775,443.24	0.20
67	NEXTERA ENERGY INC	新纪元能源公司	NEE UN	美国纽约证券交易所	美国	1,302	774,996.43	0.20
68	MOSAIC CO/THRE	Mosaic 公司	MOS UN	美国纽约证券交易所	美国	3,091	774,299.37	0.20
69	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	布罗德里奇金融解决方案股份有限公司	BR UN	美国纽约证券交易所	美国	664	773,962.03	0.20
70	CELANESE CORP	塞拉尼斯公司	CE UN	美国纽约证券交易所	美国	722	773,623.10	0.20
71	NORTON LIFELOCK INC	诺顿 LifeLock 股份有限公司	NLOK UQ	纳斯达克证券交易所	美国	4,670	773,542.00	0.20
72	HILTON WORLDWIDE HLDGS INC	希尔顿全球控股股份有限公司	HLT UN	美国纽约证券交易所	美国	777	772,761.81	0.20
73	ESSEX	埃塞克	ESS UN	美国纽	美国	344	772,525.21	0.20

	PROPE RTY TRUST INC	斯房地 产信托 公司		约 证 券 交 易 所				
74	MCCOR MICK & CO-NO N VTG SHRS	味好美 股份有 限公司 /马里 兰州	MKC UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,254	772,409.30	0.20
75	MCKES SON CORP	McKess on 公 司	MCK UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	487	771,801.37	0.20
76	DUKE REALT Y CORP	杜克房 地产公 司	DRE UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,844	771,715.75	0.20
77	Viatr is Inc	Viatri s Inc	VTRS UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	8,942	771,365.72	0.20
78	CONST ELLAT ION BRAND S INC-A	星座公 司	STZ UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	482	771,252.74	0.20
79	NISOU RCE INC	NiSour ce 公 司	NI UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	4,380	771,024.88	0.20
80	PINNA CLE WEST CAPIT AL	Pinnac le 西 部资本	PNW UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,713	770,953.92	0.20
81	MARKE TAXES S HOLDI NGS INC	Market Axess 控股公 司	MKTX UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	294	770,907.44	0.20
82	ABBOT T LABOR ATORI ES	雅培制 药	ABT UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	859	770,794.46	0.20
83	CONAG	康尼格	CAG UN	美 国 纽	美国	3,540	770,764.75	0.20

	RA BRAND S INC	拉品牌股份有限公司		约 证 券 交 易 所				
84	F5 INC	F5 股份有限公司	FFIV UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	494	770,737.59	0.20
85	CDW CORP/DE	特拉华 CDW 公司	CDW UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	590	770,313.35	0.20
86	PACKAGING CORP OF AMERICA	美国包装公司	PKG UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	886	769,093.68	0.20
87	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	查特通信公司	CHTR UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	185	769,001.55	0.20
88	CARDINAL HEALTH INC	康德乐公司	CAH UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,342	768,842.99	0.20
89	HORMEL FOODS CORP	荷美尔食品有限公司	HRL UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,469	768,347.66	0.20
90	VALERO ENERGY CORP	Valero 能源	VLO UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,603	767,642.76	0.20
91	NEWMONT CORP	纽蒙公司	NEM UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,941	767,511.99	0.20
92	Host Hotels & Resorts Inc	豪斯特酒店及度假村	HST UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	6,920	767,244.09	0.20
93	Signature Bank	Signature Bank	SBNY UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	372	767,193.34	0.20

94	Organon & Co	Organon & Co	OGN UN	美国纽约证券交易所	美国	3,951	767,047.40	0.19
95	STERIS PLC	STERIS PLC	STE UN	美国纽约证券交易所	美国	494	766,643.11	0.19
96	Penn National Gaming Inc	Penn 国家博彩股份有限公司	PENN UQ	纳斯达克证券交易所	美国	2,319	766,615.12	0.19
97	MID-AMERICA APARTMENT COMM	Mid-America Apartment Commun	MAA UN	美国纽约证券交易所	美国	524	766,528.48	0.19
98	ROBERT HALF INTL INC	罗致恒富国际公司	RHI UN	美国纽约证券交易所	美国	1,077	765,766.45	0.19
99	DIGITAL REALTY TRUST INC	数字房地产信托有限公司	DLR UN	美国纽约证券交易所	美国	679	765,687.97	0.19
100	PROLOGIS INC	安博	PLD UN	美国纽约证券交易所	美国	713	765,343.36	0.19
101	VENTAS INC	Ventas 公司	VTR UN	美国纽约证券交易所	美国	2,348	765,273.74	0.19
102	SOUTHERN CO/TH E	南方公司	SO UN	美国纽约证券交易所	美国	1,748	764,305.14	0.19
103	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	江森自控国际有限公司	JCI UN	美国纽约证券交易所	美国	1,474	764,133.64	0.19

104	AKAMA I TECHN OLOGI ES INC	阿卡迈 技术公 司	AKAM UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,024	764,121.01	0.19
105	PHILI P MORRI S INTER NATIO NAL	菲利普 莫里斯 国际集 团公司	PM UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,261	763,776.98	0.19
106	MARSH & MCLEN NAN COS	Marsh & McLenn an 股 份有限 公司	MMC UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	689	763,566.46	0.19
107	HCA HEALT HCARE INC	HCA 医 疗保健 有限公 司	HCA UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	466	763,328.90	0.19
108	CMS ENERG Y CORP	CMS 能 源	CMS UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,840	763,120.28	0.19
109	VERTE X PHARM ACEUT ICALS INC	福泰制 药	VRTX UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	545	763,056.53	0.19
110	NUCOR CORP	纽柯公 司	NUE UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,048	762,719.89	0.19
111	IQVIA HOLDI NGS INC	IQVIA 控股股 份有限 公司	IQV UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	424	762,708.16	0.19
112	JOHNS ON & JOHNS ON	强生	JNJ UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	699	762,393.01	0.19
113	ZOETI S INC	硕腾股 份有限	ZTS UN	美 国 纽 约 证 券	美国	490	762,372.41	0.19

		公司		交易所				
114	MERCK & CO. INC.	默克	MRK UN	美国纽约证券交易所	美国	1,560	762,268.49	0.19
115	AMEREN CORPORATION	Ameren 公司	AEE UN	美国纽约证券交易所	美国	1,343	762,153.92	0.19
116	LINCOLN NATIONAL CORP	林肯国民	LNC UN	美国纽约证券交易所	美国	1,751	762,044.45	0.19
117	ROPER TECHNOLOGIES INC	儒博技术公司	ROP UN	美国纽约证券交易所	美国	243	762,036.29	0.19
118	WASTE MANAGEMENT INC	废品管理	WM UN	美国纽约证券交易所	美国	716	761,898.70	0.19
119	EVERGY INC	Evergy 股份有限公司	EVRG UN	美国纽约证券交易所	美国	1,741	761,577.43	0.19
120	LOEWS CORP	罗斯	L UN	美国纽约证券交易所	美国	2,068	761,562.57	0.19
121	Charles River Laboratories International Inc.	查里斯河实验室国际有限公司	CRL UN	美国纽约证券交易所	美国	317	761,508.89	0.19
122	PROCTER & GAMBLE CO/THE	宝洁	PG UN	美国纽约证券交易所	美国	730	761,344.01	0.19

123	KRAFT HEINZ CO/TH E	卡夫亨 氏公司	KHC UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	3,325	761,051.37	0.19
124	Caesa rs Ente rtainm ent, Inc.	凯撒娱 乐集团	CZR UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,276	760,903.33	0.19
125	ALTRI A GROUP INC	高特利	MO UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,518	760,799.66	0.19
126	CENTE RPOIN T ENERG Y INC	中点能 源	CNP UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	4,274	760,540.29	0.19
127	ALEXA NDRIA REAL ESTAT E EQUIT IES INC	亚历山 大房地 产股份 有限公司	ARE UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	535	760,516.45	0.19
128	JUNIP ER NETWO RKS INC	瞻博网 络股份 有限公司	JNPR UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,340	760,438.66	0.19
129	EXPED ITORS INTL WASH INC	华盛顿 康捷国 际物流 公司	EXPD UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	888	760,299.16	0.19
130	FEDEX CORP	联邦快 递	FDX UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	461	760,194.09	0.19
131	CENTE NE CORP	Centen e 公司	CNC UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,447	760,192.56	0.19
132	FIRST	第一能	FE UN	美 国 纽	美国	2,866	759,963.93	0.19

	ENERGY CORP	源		约 证 券 交 易 所				
133	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	国际香料	IFF UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	791	759,754.87	0.19
134	HUNTINGTON BANCSHARES INC	杭庭顿银行	HBAN UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	7,725	759,470.20	0.19
135	BROADCOM INC	博通股份有限公司	AVGO UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	179	759,399.36	0.19
136	ELECTRONIC ARTS INC	电子艺界	EA UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	903	759,382.21	0.19
137	SEAGATE TECHNOLOGY	希捷科技公司	STX UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,054	759,224.22	0.19
138	ENTERGY CORP	Entergy 公司	ETR UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,057	759,161.29	0.19
139	SIMON PROPERTY GROUP INC	西蒙房地产集团公司	SPG UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	745	758,890.96	0.19
140	PVH CORP	PVH 公司	PVH UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,116	758,844.74	0.19
141	UNITEDHEALTH GROUP INC	联合健康	UNH UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	237	758,754.08	0.19
142	COOPER COS INC/THE	库柏股份有限公司	COO UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	284	758,574.16	0.19
143	DENTS	登士柏	XRAY	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,131	757,997.35	0.19

	PLY SIRON A INC	西诺德 公司	UQ	克 证 券 交 易 所				
144	RAYTH EON TECHN OLOGI ES CORP	雷神技 术公司	RTX UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,381	757,744.68	0.19
145	PERKI NELME R INC	珀金埃 尔默	PKI UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	591	757,601.86	0.19
146	CBRE GROUP INC - A	世邦魏 理仕	CBRE UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,095	757,550.79	0.19
147	CATAL ENT INC	康泰伦 特股份 有限公司	CTLT UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	928	757,508.65	0.19
148	FEDER AL REALT Y INVS TRUST	联邦房 地产投 资信托 公司	FRT UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	871	757,016.95	0.19
149	KLA CORP	KLA 公 司	KLAC UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	276	756,861.64	0.19
150	BROWN & BROWN INC	布朗保 险经纪	BRO UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,689	756,814.21	0.19
151	EDWAR DS LIFES CIENC ES CORP	爱德华 生命科学 公司	EW UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	915	755,764.32	0.19
152	FIDEL ITY NATIO NAL INFO SERV	繁德信 息技术 有限公司	FIS UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,086	755,755.71	0.19

153	CARNIVAL CORP	嘉年华公司	CCL UN	美国纽约证券交易所	美国	5,890	755,563.80	0.19
154	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	哈特福德金融服务	HIG UN	美国纽约证券交易所	美国	1,716	755,346.01	0.19
155	DXC TECHNOLOGY CO	DXC 技术公司	DXC UN	美国纽约证券交易所	美国	3,680	755,260.32	0.19
156	NASDAQ INC	纳斯达克股份有限公司	NDAQ UQ	纳斯达克证券交易所	美国	564	755,173.87	0.19
157	NORTHROP GRUMMAN CORP	诺斯洛普格鲁门公司	NOC UN	美国纽约证券交易所	美国	306	755,159.71	0.19
158	CVS HEALTH CORP	CVS 保健公司	CVS UN	美国纽约证券交易所	美国	1,148	755,059.36	0.19
159	SEMPRA ENERGY	桑普拉能源	SRE UN	美国纽约证券交易所	美国	895	754,822.95	0.19
160	TYLER TECHNOLOGIES INC	Tyler 科技公司	TYL UN	美国纽约证券交易所	美国	220	754,557.72	0.19
161	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	PNC 财务服务	PNC UN	美国纽约证券交易所	美国	590	754,288.66	0.19
162	EQUITY RESIDENTIAL	公寓物业权益信托	EQR UN	美国纽约证券交易所	美国	1,307	754,140.11	0.19

163	GAP INC/T HE	Gap 公 司	GPS UN	美国纽 约证券 交易所	美国	6,700	753,958.40	0.19
164	MASTE RCARD INC - A	万事达 股份有 限公司	MA UN	美国纽 约证券 交易所	美国	329	753,711.54	0.19
165	AFLAC INC	家庭人 寿保险	AFL UN	美国纽 约证券 交易所	美国	2,024	753,488.90	0.19
166	YUM! BRAND S INC	百胜全 球餐饮	YUM UN	美国纽 约证券 交易所	美国	851	753,415.58	0.19
167	SCHWA B (CHAR LES) CORP	嘉信理 财	SCHW UN	美国纽 约证券 交易所	美国	1,405	753,355.90	0.19
168	GENER AL MILLS INC	通用磨 坊	GIS UN	美国纽 约证券 交易所	美国	1,753	753,079.45	0.19
169	AUTOM ATIC DATA PROCE SSING	ADP 公 司	ADP UQ	纳斯达 克证券 交易所	美国	479	753,045.53	0.19
170	Facts et Resea rch Sytem s Inc	辉盛研 究系统	FDS UN	美国纽 约证券 交易所	美国	243	752,972.91	0.19
171	GENUI NE PARTS CO	原配部 件	GPC UN	美国纽 约证券 交易所	美国	842	752,641.18	0.19
172	HENRY SCHEI N INC	亨利香 恩公司	HSIC UQ	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,522	752,336.81	0.19
173	ECOLA B INC	艺康集 团	ECL UN	美国纽 约证券 交易所	美国	503	752,324.76	0.19
174	COMCA	康卡斯	CMCSA	纳斯达	美国	2,344	752,163.77	0.19

	ST CORP- CLASS A	特	UQ	克 证 券 交 易 所				
175	INGER SOLL- RAND INC	英格索 兰股份 有限公 司	IR UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,905	751,454.98	0.19
176	METLI FE INC	大都会 集团	MET UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,886	751,415.39	0.19
177	BOSTO N PROPE RTIES INC	波士顿 地产公 司	BXP UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,023	751,243.25	0.19
178	COCA- COLA CO/TH E	可口可 乐	KO UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,990	751,235.34	0.19
179	AMPHE NOL CORP- CL A	安费诺 公司	APH UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,347	751,112.42	0.19
180	DOW INC	Dow Inc	DOW UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,077	751,104.90	0.19
181	LINDE PLC	Linde PLC	LIN UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	340	750,969.48	0.19
182	TRANE TECHN OLOGI ES PLC	特灵科 技公共 有限公 司	TT UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	583	750,952.20	0.19
183	VERIS IGN INC	威瑞信 股份有 限公司	VRSN UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	464	750,882.00	0.19
184	WELLT OWER INC	Wellto wer 股 份有限 公司	WELL UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,373	750,816.52	0.19
185	KELLO GG CO	家乐氏	K UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,827	750,390.18	0.19

186	CLOROX COMPANY	高乐氏公司	CLX UN	美国纽约证券交易所	美国	675	750,375.26	0.19
187	GARTNER INC	高德纳咨询股份有限公司	IT UN	美国纽约证券交易所	美国	352	750,296.46	0.19
188	SEALD AIR CORP	希悦尔包装	SEE UN	美国纽约证券交易所	美国	1,744	750,213.83	0.19
189	TYSON FOODS INC-CL A	泰森食品公司	TSN UN	美国纽约证券交易所	美国	1,350	750,203.12	0.19
190	HERSHEY CO/TH E	好时食品	HSY UN	美国纽约证券交易所	美国	608	749,972.06	0.19
191	DTE ENERGY COMPANY	DTE 能源	DTE UN	美国纽约证券交易所	美国	984	749,956.76	0.19
192	LKQ CORP	LKQ 公司	LKQ UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,959	749,774.48	0.19
193	SYSCO CORP	Sysco 公司	SYU UN	美国纽约证券交易所	美国	1,497	749,714.42	0.19
194	TERADYNE INC	泰瑞达	TER UQ	纳斯达克证券交易所	美国	719	749,642.50	0.19
195	GENERAL DYNAMICS CORP	通用动力	GD UN	美国纽约证券交易所	美国	564	749,636.19	0.19
196	BOOKING HOLDINGS INC	Booking 控股股份有限公司	BKNG UQ	纳斯达克证券交易所	美国	49	749,541.76	0.19
197	VERIZ	Verizo	VZ UN	美国纽	美国	2,262	749,358.46	0.19

	ON COMMUNICATIONS INC	n 通信 股份有限公司		约 证 券 交 易 所				
198	JPMORGAN CHASE & CO	摩根大通	JPM UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	742	749,117.33	0.19
199	DANAHER CORP	丹纳赫	DHR UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	357	748,867.85	0.19
200	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	Thermo Fisher Scientific 公司	TMO UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	176	748,725.48	0.19
201	AUTOZONE INC	AutoZone 公 司	AZO UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	56	748,493.41	0.19
202	KROGER CO	克罗格公 司	KR UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,593	748,246.92	0.19
203	WILLIS TOWERS WATSON PLC	韦莱韬 睿惠悦 公共有 限公司	WLTW UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	494	747,997.51	0.19
204	ALLIANT ENERGY CORP	Alliant 能 源公司	LNT UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,908	747,772.44	0.19
205	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	O'Reilly 汽 车股份 有限公司	ORLY UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	166	747,449.96	0.19
206	CONSOLIDATED EDISON	联合爱 迪生	ED UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,374	747,421.27	0.19

	N INC							
207	BOSTON SCIENTIFIC CORP	波士顿科学	BSX UN	美国纽约证券交易所	美国	2,758	746,975.99	0.19
208	BIOGEN INC	百健	BIIB UQ	纳斯达克证券交易所	美国	488	746,473.08	0.19
209	TRANS DIGM GROUP INC	TransDigm 集团公司	TDG UN	美国纽约证券交易所	美国	184	746,438.39	0.19
210	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	美国国际集团	AIG UN	美国纽约证券交易所	美国	2,059	746,433.42	0.19
211	IPG PHOTONICS CORP	IPG 光子公司	IPGP UQ	纳斯达克证券交易所	美国	680	746,308.84	0.19
212	COPART INC	Copart 股份有限公司	CPRT UQ	纳斯达克证券交易所	美国	772	746,279.77	0.19
213	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	Healthpeak 物业股份有限公司	PEAK UN	美国纽约证券交易所	美国	3,242	745,981.00	0.19
214	AMERICAN ELECTRIC POWER	美国电力	AEP UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,315	745,928.53	0.19
215	AVALONBAY COMMUNITIES INC	Avalon Bay 社区股份有限公司	AVB UN	美国纽约证券交易所	美国	463	745,632.82	0.19
216	NETAPP INC	网域存储技术	NTAP UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,271	745,442.32	0.19

217	APPLIED MATERIALS INC	应用材料	AMATUQ	纳斯达克证券交易所	美国	743	745,437.15	0.19
218	AMETEK INC	阿美特克股份有限公司	AME UN	美国纽约证券交易所	美国	795	745,298.93	0.19
219	FIRST REPUBLIC BANK/CA	第一共和银行/加州旧金山	FRC UN	美国纽约证券交易所	美国	566	745,221.53	0.19
220	REPUBLIC SERVICES INC	公共服务公司	RSG UN	美国纽约证券交易所	美国	838	745,058.56	0.19
221	TRAVELERS COS INC/THE	St Paul Travelers	TRV UN	美国纽约证券交易所	美国	747	745,021.01	0.19
222	COMERICA INC	Comerica 公司	CMA UN	美国纽约证券交易所	美国	1,343	744,943.16	0.19
223	SERVICENOW INC	ServiceNow 公司	NOW UN	美国纽约证券交易所	美国	180	744,935.51	0.19
224	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	空气产品公司	APD UN	美国纽约证券交易所	美国	384	744,910.27	0.19
225	WEYERHAEUSER CO	惠好	WY UN	美国纽约证券交易所	美国	2,837	744,858.11	0.19
226	REGENCY CENTERS CORP	Regency Centers 公司	REG UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,550	744,633.94	0.19

227	PACCAR INC	帕卡	PCAR UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,323	744,477.61	0.19
228	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	Raymond James 金融股份有限公司	RJF UN	美国纽约证券交易所	美国	1,163	744,459.89	0.19
229	PEPSICO INC	百事可乐	PEP UQ	纳斯达克证券交易所	美国	672	744,255.35	0.19
230	HUNT (JB) TRANSPORT SERVICES INC	JB Hunt 运输服务股份有限公司	JBHT UQ	纳斯达克证券交易所	美国	571	744,123.25	0.19
231	NORFOLK SOUTHERN CORP	诺福克南方	NSC UN	美国纽约证券交易所	美国	392	744,058.98	0.19
232	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	国际商业机器	IBM UN	美国纽约证券交易所	美国	873	743,949.70	0.19
233	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	Walgreens Boots Alliance 公司	WBA UQ	纳斯达克证券交易所	美国	2,237	743,928.92	0.19
234	UDR INC	UDR 公司	UDR UN	美国纽约证券交易所	美国	1,945	743,920.18	0.19
235	C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	罗宾逊全球物流有限公司	CHRW UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,084	743,858.78	0.19

236	MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	万豪国际	MAR UQ	纳斯达克证券交易所	美国	706	743,785.59	0.19
237	STRYKER CORP	史赛克	SYK UN	美国纽约证券交易所	美国	436	743,375.51	0.19
238	SMITH (A.O.) CORP	AO 史密斯公司	AOS UN	美国纽约证券交易所	美国	1,358	743,306.52	0.19
239	WEC ENERGY GROUP INC	WEC 能源集团股份有限公司	WEC UN	美国纽约证券交易所	美国	1,201	743,285.93	0.19
240	DOLLAR TREE INC	Dollar Tree 公司	DLTR UQ	纳斯达克证券交易所	美国	829	742,712.18	0.19
241	LYONDELLBASEL INDUSTRIES NV-CL A	利安德巴塞尔工业公司	LYB UN	美国纽约证券交易所	美国	1,263	742,682.91	0.19
242	BECTON DICKINSON AND CO	碧迪	BDX UN	美国纽约证券交易所	美国	463	742,356.16	0.19
243	Monolithic Power Systems	芯源系统有限公司	MPWR UQ	纳斯达克证券交易所	美国	236	742,296.48	0.19
244	INTUITIVE SURGICAL INC	直觉外科手术公司	ISRG UQ	纳斯达克证券交易所	美国	324	742,215.64	0.19
245	UNITED	联合包裹服务	UPS UN	美国纽约证券交易所	美国	543	742,046.17	0.19

	PARCEL SERVICE-CL B	股份有限公司		交易所				
246	BORGWARNER INC	博格华纳股份有限公司	BWA UN	美国纽约证券交易所	美国	2,581	741,657.57	0.19
247	AMGEN INC	AMGEN-T	AMGN UQ	纳斯达克证券交易所	美国	517	741,554.42	0.19
248	HOLOGIC INC	豪洛捷公司	HOLX UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,519	741,459.74	0.19
249	MOTOROLA SOLUTIONS INC	摩托罗拉解决方案股份有限公司	MSI UN	美国纽约证券交易所	美国	428	741,414.85	0.19
250	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	纽约梅隆银行股份有限公司	BK UN	美国纽约证券交易所	美国	2,002	741,341.91	0.19
251	BLACK ROCK INC	贝莱德有限公司	BLK UN	美国纽约证券交易所	美国	127	741,341.66	0.19
252	TEXTRON INC	德事隆	TXT UN	美国纽约证券交易所	美国	1,506	741,259.28	0.19
253	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	雅诗兰黛	EL UN	美国纽约证券交易所	美国	314	741,129.22	0.19
254	INTERNATIONAL PAPER CO	国际纸业	IP UN	美国纽约证券交易所	美国	2,474	741,038.17	0.19
255	DELTA AIR	达美航空有限	DAL UN	美国纽约证券	美国	2,974	741,008.85	0.19

	LINES INC	公司		交易所				
256	CSX CORP	CSX 公 司	CSX UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	3,091	740,994.06	0.19
257	KEYSI GHT TECHN OLOGI ES INC	是德科 技公司	KEYS UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	562	739,954.94	0.19
258	LUMEN TECHN OLOGI ES INC	世纪电 信公司	LUMN UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	9,244	739,658.98	0.19
259	MASCO CORP	马斯可	MAS UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,652	739,603.13	0.19
260	JM SMUCK ER CO/TH E	JM 斯 马克公 司	SJM UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	854	739,519.23	0.19
261	TELEF LEX INC	泰利福 公司	TFX UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	353	739,284.35	0.19
262	SOUTH WEST AIRLI NES CO	西南航 空	LUV UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,706	739,103.28	0.19
263	STARB UCKS CORP	星巴克	SBUX UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	991	739,053.74	0.19
264	AGILE NT TECHN OLOGI ES INC	安捷伦	A UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	726	738,981.25	0.19
265	ULTA BEAUT Y INC	Ulta 美容产 品公司	ULTA UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	281	738,736.67	0.19
266	ZIMME R BIOME T	捷迈邦 美控股 股份有 限公司	ZBH UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	912	738,691.66	0.19

	HOLDINGS INC							
267	Meta Platforms Inc	Meta 平台股份有限公司	FB UQ	纳斯达克证券交易所	美国	344	737,696.54	0.19
268	WHIRLPOOL CORP	惠而浦	WHR UN	美国纽约证券交易所	美国	493	737,588.03	0.19
269	DOVER CORP	多佛	DOV UN	美国纽约证券交易所	美国	637	737,535.88	0.19
270	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	皇家加勒比游轮有限公司	RCL UN	美国纽约证券交易所	美国	1,504	737,398.16	0.19
271	INTEL CORP	英特尔	INTC UQ	纳斯达克证券交易所	美国	2,245	737,142.49	0.19
272	WR BERKLEY CORP	WR Berkley 公司	WRB UN	美国纽约证券交易所	美国	1,403	736,987.37	0.19
273	HP INC	惠普	HPQ UN	美国纽约证券交易所	美国	3,068	736,849.60	0.19
274	CATERPILLAR INC	卡特彼勒	CAT UN	美国纽约证券交易所	美国	559	736,824.73	0.19
275	EDISON INTERNATIONAL	爱迪生国际	EIX UN	美国纽约证券交易所	美国	1,693	736,694.60	0.19
276	TRACTOR SUPPLY COMPANY	拖拉机供应公司	TSCO UQ	纳斯达克证券交易所	美国	484	736,281.14	0.19
277	WESTROCK CO	WestRock 公	WRK UN	美国纽约证券	美国	2,603	736,196.21	0.19

		司		交易所				
278	PULTE GROUP INC	Pulte 集团公司	PHM UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	2,020	736,158.72	0.19
279	CAMPBELL SOUP CO	金宝汤	CPB UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	2,656	735,945.52	0.19
280	JACOBS ENGINEERING GROUP INC	雅各布 工程集 团	J UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	829	735,893.94	0.19
281	SYNOPTICS INC	新思科 技公司	SNPS UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	313	735,376.43	0.19
282	TJX COMPANIES INC	TJX 公 司	TJX UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,519	735,261.54	0.19
283	FMC CORP	FMC 公 司	FMC UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,049	734,956.33	0.19
284	ILLUMINA INC	Illumi na 公 司	ILMN UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	303	734,948.11	0.19
285	ILLINOIS TOOL WORKS	伊利诺 伊工具	ITW UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	467	734,835.13	0.19
286	COSTCO WHOLESALE CORP	好市多 批发	COST UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	203	734,755.43	0.19
287	MATCH GROUP INC	MATCH 公司	MTCH UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	871	734,415.29	0.19
288	MARATHON OIL CORP	Marath on 石 油公司	MRO UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	7,015	734,393.29	0.19

289	SHERW IN-WI LLIAM S CO/TH E	宣威威 廉斯	SHW UN	美国纽 约证券 交易所	美国	327	734,202.15	0.19
290	UNION PACIF IC CORP	联合太 平洋	UNP UN	美国纽 约证券 交易所	美国	457	734,047.16	0.19
291	EATON CORP PLC	伊顿	ETN UN	美国纽 约证券 交易所	美国	666	733,831.08	0.19
292	WALT DISNE Y CO/TH E	华特迪 士尼公 司	DIS UN	美国纽 约证券 交易所	美国	743	733,736.40	0.19
293	LAM RESEA RCH CORP	泛林集 团	LRCX UQ	纳斯达 克证券 交易所	美国	160	733,613.54	0.19
294	EVERE ST RE GROUP LTD	安富来 集团有 限公司	RE UN	美国纽 约证券 交易所	美国	420	733,501.33	0.19
295	EQUIN IX INC	Equini x 有限 公司	EQIX UQ	纳斯达 克证券 交易所	美国	136	733,423.80	0.19
296	LOWE' S COS INC	劳氏	LOW UN	美国纽 约证券 交易所	美国	445	733,355.97	0.19
297	Trimble Inc	天宝股 份有限 公司	TRMB UQ	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,319	733,228.52	0.19
298	VORNA DO REALTY TRUST	沃那多 房地产 信托	VNO UN	美国纽 约证券 交易所	美国	2,747	733,138.05	0.19
299	DUKE ENERGY CORP	杜克能 源	DUK UN	美国纽 约证券 交易所	美国	1,096	733,016.78	0.19
300	WABTE	西屋制	WAB UN	美国纽	美国	1,248	732,907.63	0.19

	C CORP	动公司		约 证 券 交 易 所				
301	AMERI PRISE FINAN CIAL INC	阿默普 莱斯金 融公司	AMP UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	381	732,774.89	0.19
302	TELED YNE TECHN OLOGI ES INC	Teledy ne 科 技股份 有限公 司	TDY UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	263	732,581.13	0.19
303	BIO-R AD LABOR ATORI ES-A	伯乐生 命医学 产品有 限公司	BIO UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	152	732,227.72	0.19
304	OTIS WORLD WIDE CORP	Otis Worldw ide Corp	OTIS UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,319	732,219.37	0.19
305	PRUDE NTIAL FINAN CIAL INC	保德信 金融集 团	PRU UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,061	732,202.22	0.19
306	INTER PUBLI C GROUP OF COS INC	Interp ublic 集团	IPG UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,066	732,068.71	0.19
307	FORTU NE BRAND S HOME & SECUR ITY INC	Fortun e Brands 家居与 安全有 限	FBHS UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,074	731,997.94	0.19
308	CADEN CE DESIG N SYS	Cadenc e 设计 系统股 份有限	CDNS UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	616	731,876.80	0.19

	INC	公司						
309	MCDON ALD'S CORP	麦当劳	MCD UN	美国纽 约证券 交易所	美国	428	731,509.31	0.19
310	Gener ac Holdi ngs Inc	Genera c 控股 公司	GNRC UN	美国纽 约证券 交易所	美国	326	731,458.05	0.19
311	PEOPL E'S UNITE D FINAN CIAL	人民联 合金融 股份有 限公司	PBCT UQ	纳斯达 克证券 交易所	美国	6,438	731,453.20	0.19
312	NORTH ERN TRUST CORP	北美信 托	NTRS UQ	纳斯达 克证券 交易所	美国	959	731,330.98	0.19
313	T-MOB ILE US INC	T-Mobi le US 有限公 司	TMUS UQ	纳斯达 克证券 交易所	美国	989	731,319.70	0.19
314	ALLEG ION PLC	安朗杰 公共有 限公司	ALLE UN	美国纽 约证券 交易所	美国	866	731,248.42	0.19
315	DISH NETWO RK CORP- A	DISH 网络公 司	DISH UQ	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,534	730,929.12	0.19
316	CHUBB LTD	安达保 险有限 公司	CB UN	美国纽 约证券 交易所	美国	593	730,864.53	0.19
317	UNIVE RSAL HEALT H SERVI CES-B	Univer sal Health Servic es 公 司	UHS UN	美国纽 约证券 交易所	美国	884	730,779.16	0.19
318	HASBR O INC	孩之宝	HAS UQ	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,126	730,682.51	0.19
319	VERIS	Verisk	VRSK	纳斯达	美国	501	730,615.24	0.19

	K ANALY TICS INC	分析公 司	UQ	克 证 券 交 易 所				
320	LEIDO S HOLDI NGS INC	Leidos 控股公 司	LDOS UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,289	730,604.85	0.19
321	VULCA N MATER IALS CO	Vulcan 材料	VMC UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	552	730,554.23	0.19
322	M & T BANK CORP	M&T 银 行	MTB UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	746	730,468.28	0.19
323	JACK HENRY & ASSOC IATES INC	Jack Henry & Associ ates 公司	JKHY UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	686	730,369.21	0.19
324	DUPON T DE NEMOU RS INC	杜邦公 司	DD UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,418	730,311.19	0.19
325	WW GRAIN GER INC	固安捷 公司	GWW UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	221	730,215.55	0.19
326	ALASK A AIR GROUP INC	阿拉斯 加航空 集团公 司	ALK UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,198	730,118.39	0.19
327	XCEL ENERG Y INC	Xcel 能源	XEL UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,691	729,894.60	0.19
328	INTER CONTI NENTA L EXCHA NGE	洲际交 易所 (ICE)	ICE UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	837	729,867.76	0.19

	INC							
329	APACHE CORP	阿帕契	APA UQ	纳斯达克证券交易所	美国	4,255	729,488.15	0.19
330	PPL CORP	PPL 公司	PPL UN	美国纽约证券交易所	美国	3,806	729,433.38	0.19
331	CBOE GLOBAL MARKETS INC	Cboe 环球市场公司	CBOE UF	巴兹全球市场	美国	877	729,130.15	0.19
332	ANSYS INC	ANSYS 股份有限公司	ANSS UQ	纳斯达克证券交易所	美国	285	728,864.92	0.19
333	TE CONNECTIVITY LTD	泰科电子公司	TEL UN	美国纽约证券交易所	美国	708	728,288.05	0.19
334	CERIDIAN HCM HOLDING	CERIDIAN HCM HOLDING	CDAY UN	美国纽约证券交易所	美国	1,093	727,944.14	0.19
335	FISERV INC	Fiserv 公司	FISV UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,100	727,907.29	0.19
336	VF CORP	VF 公司	VFC UN	美国纽约证券交易所	美国	1,559	727,786.03	0.19
337	KEYCORP	KeyCorp 公司	KEY UN	美国纽约证券交易所	美国	4,935	727,764.16	0.18
338	GILEAD SCIENCES INC	吉利德科学	GILD UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,572	727,741.02	0.18
339	TESLA INC	特斯拉公司	TSLA UQ	纳斯达克证券交易所	美国	108	727,672.92	0.18
340	NXP SEMICONDUCTOR	恩智浦半导体公司	NXPI UQ	纳斯达克证券交易所	美国	501	727,580.73	0.18

	TORS NV							
341	HUMAN A INC	Humana 公司	HUM UN	美国纽 约证券 交易所	美国	246	727,528.32	0.18
342	AMCOR PLC	Amc or PLC	AMCR UN	美国纽 约证券 交易所	美国	9,501	727,512.06	0.18
343	NIELS EN HOLDI NGS PLC	尼尔森 控股公 司有限 公司	NLSN UN	美国纽 约证券 交易所	美国	5,563	727,449.07	0.18
344	MARAT HON PETRO LEUM CORP	马拉松 石油公 司	MPC UN	美国纽 约证券 交易所	美国	1,783	727,430.20	0.18
345	ASSUR ANT INC	安信龙 集团	AIZ UN	美国纽 约证券 交易所	美国	732	727,400.55	0.18
346	PRINC IPAL FINAN CIAL GROUP	信安金 融	PFQ UQ	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,577	727,240.46	0.18
347	PTC Inc	PTC 公 司	PTC UQ	纳斯达 克证券 交易所	美国	941	726,843.51	0.18
348	OLD DOMIN ION FREIG HT LINE	Old Domini on Freigh t Line 股	ODFL UQ	纳斯达 克证券 交易所	美国	318	726,605.63	0.18
349	FLEET COR TECHN OLOGI ES INC	FleetC or 技 术股份 有限公司	FLT UN	美国纽 约证券 交易所	美国	509	726,412.57	0.18
350	HUNTI NGTON INGAL LS	Huntin gton Ingall s 工业	HII UN	美国纽 约证券 交易所	美国	610	726,264.91	0.18

	INDUS TRIE	公司						
351	EVERS OURCE ENERG Y	Everso urce 能源公 司	ES UN	美国纽 约证券 交易所	美国	1,252	726,236.60	0.18
352	3M CO	3M 公 司	MMM UN	美国纽 约证券 交易所	美国	641	725,942.49	0.18
353	Pool Corp	Pool 公司	POOL UQ	纳斯达 克证券 交易所	美国	201	725,337.89	0.18
354	QUALC OMM INC	高通公 司	QCOM UQ	纳斯达 克证券 交易所	美国	622	725,204.89	0.18
355	T ROWE PRICE GROUP INC	普信集 团公司	TROW UQ	纳斯达 克证券 交易所	美国	578	724,648.80	0.18
356	MARTI N MARIE TTA MATER IALS	Martin Mariet ta 材 料股份 有限	MLM UN	美国纽 约证券 交易所	美国	258	724,624.83	0.18
357	IHS MARKI T LTD	IHS Markit 有限公 司	INFO UN	美国纽 约证券 交易所	美国	855	724,576.63	0.18
358	CHIPO TLE MEXIC AN GRILL INC	Chipot le Mexica n Grill 股份	CMG UN	美国纽 约证券 交易所	美国	65	724,510.64	0.18
359	AON PLC-C LASS A	Aon PLC	AON UN	美国纽 约证券 交易所	美国	378	724,353.99	0.18
360	GARMI N LTD	佳明有 限公司	GRMN UN	美国纽 约证券 交易所	美国	834	724,061.34	0.18
361	CME GROUP INC	芝加哥 商业交 易所集	CME UQ	纳斯达 克证券 交易所	美国	497	723,926.43	0.18

		团股份有限						
362	ADVANCED MICRO DEVICES	AMD 公司	AMD UQ	纳斯达克证券交易所	美国	789	723,878.49	0.18
363	PAYPAL HOLDINGS INC	Paypal 控股股份有限公司	PYPL UQ	纳斯达克证券交易所	美国	602	723,802.36	0.18
364	ARTHUR J GALLAGHER & CO	亚瑟加拉格尔有限公司	AJG UN	美国纽约证券交易所	美国	669	723,700.80	0.18
365	BANK OF AMERICA CORP	美国银行控股公司	BAC UN	美国纽约证券交易所	美国	2,551	723,603.63	0.18
366	LAS VEGAS SANDS CORP	拉斯维加斯金沙集团	LVS UN	美国纽约证券交易所	美国	3,015	723,543.76	0.18
367	PHILLIPS 66	Phillips 66	PSX UN	美国纽约证券交易所	美国	1,566	723,465.73	0.18
368	ADVANCE AUTO PARTS INC	领先汽车配件公司	AAP UN	美国纽约证券交易所	美国	473	723,407.58	0.18
369	FASTENAL CO	快扣公司	FAST UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,771	723,324.82	0.18
370	FORTIVE CORP	福迪威公司	FTV UN	美国纽约证券交易所	美国	1,487	723,280.00	0.18
371	MICROCHIP TECHNOLOGY	微芯科技股份有限公司	MCHP UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,303	723,254.18	0.18

	INC							
372	ZIONS BANCO RP NA	ZB NA- 用于基 本面	ZION UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,796	723,229.82	0.18
373	IDEX CORP	艺达思 集团	IEX UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	480	723,218.60	0.18
374	CUMMI NS INC	康明斯	CMI UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	520	723,213.50	0.18
375	LOCKH EED MARTI N CORP	洛克希 德马丁	LMT UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	319	722,850.02	0.18
376	DOMIN ION ENERG Y INC	Domini on 能 源公司	D UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,443	722,762.61	0.18
377	HOME DEPOT INC	家得宝	HD UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	273	722,352.34	0.18
378	AMERI CAN AIRLI NES GROUP INC	美国航 空集团 公司	AAL UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	6,306	722,084.75	0.18
379	PARKE R HANNI FIN CORP	派克汉 尼汾	PH UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	356	722,052.62	0.18
380	CITIZ ENS FINAN CIAL GROUP	公民金 融集团	CFG UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,396	721,799.37	0.18
381	MORGA N STANL EY	摩根士 丹利	MS UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,153	721,592.03	0.18
382	AES CORP	爱伊斯	AES UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	4,655	721,196.87	0.18

383	OMNICOM GROUP	奥姆尼康	OMC UN	美国纽约证券交易所	美国	1,543	720,808.65	0.18
384	RESMED INC	瑞思迈股份有限公司	RMD UN	美国纽约证券交易所	美国	434	720,762.17	0.18
385	AUTODESK INC	欧特克	ADSK UQ	纳斯达克证券交易所	美国	402	720,698.80	0.18
386	FIFTH THIRD BANCORP	五三银行	FITB UQ	纳斯达克证券交易所	美国	2,595	720,532.20	0.18
387	INVESTCO LTD	景顺有限公司	IVZ UN	美国纽约证券交易所	美国	4,908	720,340.36	0.18
388	CITIGROUP INC	花旗集团	C UN	美国纽约证券交易所	美国	1,870	720,003.34	0.18
389	STATE STREET CORP	道富集团	STT UN	美国纽约证券交易所	美国	1,214	719,829.28	0.18
390	MOODY'S CORP	穆迪	MCO UN	美国纽约证券交易所	美国	289	719,673.84	0.18
391	GOLDMAN SACHS GROUP INC	高盛	GS UN	美国纽约证券交易所	美国	295	719,512.09	0.18
392	EBAY INC	eBay 公司	EBAY UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,697	719,500.93	0.18
393	HOWMET AEROSPACE INC	Howmet 航空航天股份有限公司	HWM UN	美国纽约证券交易所	美国	3,544	719,214.15	0.18
394	LENNAR CORP-A	Lennar 公司	LEN UN	美国纽约证券交易所	美国	971	719,123.87	0.18
395	S&P GLOBAL	标普全球	SPGI UN	美国纽约证券交易所	美国	239	719,123.30	0.18

	L INC			交易所				
396	ROCKWELL AUTOMATION INC	罗克韦尔自动化	ROK UN	美国纽约证券交易所	美国	323	718,404.63	0.18
397	NIKE INC -CL B	耐克公司	NKE UN	美国纽约证券交易所	美国	676	718,343.23	0.18
398	GLOBE LIFE INC	Globe Life 股份有限公司	GL UN	美国纽约证券交易所	美国	1,202	718,231.79	0.18
399	BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	布朗福曼	BF/B UN	美国纽约证券交易所	美国	1,546	718,168.79	0.18
400	CHEVRON CORP	雪佛龙	CVX UN	美国纽约证券交易所	美国	959	717,512.67	0.18
401	MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	莫尔森库尔斯饮料公司	TAP UN	美国纽约证券交易所	美国	2,428	717,507.25	0.18
402	EQUIFAX INC	Equifax 公司	EFX UN	美国纽约证券交易所	美国	384	716,828.62	0.18
403	CORNING INC	康宁公司	GLW UN	美国纽约证券交易所	美国	3,019	716,611.91	0.18
404	SYNCHRONY FINANCIAL	同步金融公司	SYF UN	美国纽约证券交易所	美国	2,422	716,351.85	0.18
405	NVR INC	NVR 股份有限公司	NVR UN	美国纽约证券交易所	美国	19	715,790.47	0.18
406	BALL CORP	波尔	BLL UN	美国纽约证券交易所	美国	1,166	715,677.55	0.18

407	DR HORTON INC	霍顿房 屋公司	DHI UN	美国纽 约证券 交易所	美国	1,035	715,645.23	0.18
408	APPLE INC	苹果公 司	AAPL UQ	纳斯达 克证券 交易所	美国	632	715,508.09	0.18
409	EOG RESOU RCES INC	EOG 资 源	EOG UN	美国纽 约证券 交易所	美国	1,263	715,304.38	0.18
410	DEERE & CO	迪尔	DE UN	美国纽 约证券 交易所	美国	327	714,875.55	0.18
411	PAYCO M SOFTW ARE INC	Paycom 软件股 份有限 公司	PAYC UN	美国纽 约证券 交易所	美国	270	714,724.26	0.18
412	DARDE N RESTA URANT S INC	达登饭 店	DRI UN	美国纽 约证券 交易所	美国	744	714,563.97	0.18
413	US BANCO RP	美国合 众银行	USB UN	美国纽 约证券 交易所	美国	1,995	714,455.52	0.18
414	PIONE ER NATUR AL RESOU RCES CO	Pioneer 自然 资源公 司	PXD UN	美国纽 约证券 交易所	美国	616	714,321.19	0.18
415	MODER NA INC	Modern a 股份 有限公司	MRNA UQ	纳斯达 克证券 交易所	美国	441	714,111.43	0.18
416	ROSS STORE S INC	Ross 商店有 限公司	ROST UQ	纳斯达 克证券 交易所	美国	980	714,042.70	0.18
417	DISCO VER FINAN CIAL	Discov er 金 融服务 公司	DFS UN	美国纽 约证券 交易所	美国	969	713,935.84	0.18

	SERVICES							
418	CORTEVA INC	Corteva Inc	CTVA UN	美国纽约证券交易所	美国	2,368	713,817.25	0.18
419	TRUIST FINANCIAL CORP	Truist 金融公司	TFC UN	美国纽约证券交易所	美国	1,912	713,744.31	0.18
420	STANLEY BLACK & DECKER INC	史丹利百得公司	SWK UN	美国纽约证券交易所	美国	593	713,132.63	0.18
421	DEVON ENERGY CORP	戴文能源	DVN UN	美国纽约证券交易所	美国	2,536	712,234.55	0.18
422	FRANKLIN RESOURCES INC	富兰克林资源	BEN UN	美国纽约证券交易所	美国	3,335	712,096.51	0.18
423	BAKER HUGHES CO	贝克休斯公司	BKR UQ	纳斯达克证券交易所	美国	4,637	711,312.75	0.18
424	QORVO INC	Qorvo 股份有限公司	QRVO UQ	纳斯达克证券交易所	美国	713	710,929.25	0.18
425	NETFLIX INC	奈飞公司	NFLX UQ	纳斯达克证券交易所	美国	185	710,580.69	0.18
426	ETSY INC	Etsy 股份有限公司	ETSY UQ	纳斯达克证券交易所	美国	509	710,510.94	0.18
427	TEXAS INSTRUMENTS INC	德州仪器	TXN UQ	纳斯达克证券交易所	美国	591	710,162.25	0.18
428	REGIONS FINANCIAL	地区金融公司	RF UN	美国纽约证券交易所	美国	5,109	710,101.24	0.18

	CORP							
429	MICRO SOFT CORP	微软	MSFT UQ	纳斯达克 证券 交易所	美国	331	709,755.17	0.18
430	MOHAW K INDUS TRIES INC	Mohawk 工业股 份有限 公司	MHK UN	美国纽 约证 券交 易所	美国	611	709,691.79	0.18
431	CINCI NNATI FINAN CIAL CORP	辛辛那 提金融	CINF UQ	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	976	708,950.30	0.18
432	WALMA RT INC	沃尔玛 股份有 限公司	WMT UN	美国纽 约证 券交 易所	美国	768	708,480.03	0.18
433	AMERI CAN EXPRES S CO	美国运 通	AXP UN	美国纽 约证 券交 易所	美国	679	708,240.81	0.18
434	NEWEL L BRAND S INC	纽威尔 品牌公 司	NWL UQ	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	5,086	708,201.53	0.18
435	WILLI AMS COS INC	威廉姆 斯公司	WMB UN	美国纽 约证 券交 易所	美国	4,263	707,757.02	0.18
436	TAPES TRY INC	TPR-DR S-RS	TPR UN	美国纽 约证 券交 易所	美国	2,734	707,705.25	0.18
437	APTIV PLC	Aptiv 公共有 限公司	APTIV UN	美国纽 约证 券交 易所	美国	672	706,723.39	0.18
438	XYLEM INC	Xylem 公司/ 纽约	XYL UN	美国纽 约证 券交 易所	美国	924	706,466.32	0.18
439	CONOC OPHIL LIPS	康菲石 油	COP UN	美国纽 约证 券交 易所	美国	1,534	705,943.77	0.18
440	NVIDI A CORP	英伟达	NVDA UQ	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	376	705,059.08	0.18

441	TARGET CORP	塔吉特公司	TGT UN	美国纽约证券交易所	美国	477	703,857.39	0.18
442	VISA INC-CLASS A SHARES	维萨公司	V UN	美国纽约证券交易所	美国	509	703,274.08	0.18
443	MSCI INC	MSCI 明晟	MSCI UN	美国纽约证券交易所	美国	180	703,138.97	0.18
444	EXXON MOBIL CORP	埃克森美孚石油	XOM UN	美国纽约证券交易所	美国	1,802	703,012.61	0.18
445	AVERY DENNISON CORP	艾利丹尼森	AVY UN	美国纽约证券交易所	美国	509	702,819.74	0.18
446	WYNN RESORTS LTD	永利渡假村有限公司	WYNN UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,296	702,677.63	0.18
447	AMAZON.COM INC	亚马逊公司	AMZN UQ	纳斯达克证券交易所	美国	33	701,538.80	0.18
448	FORD MOTOR CO	福特汽车	F UN	美国纽约证券交易所	美国	5,294	701,048.89	0.18
449	KINDER MORGAN INC	特拉华州金德摩根公司	KMI UN	美国纽约证券交易所	美国	6,928	700,549.67	0.18
450	RALPH LAUREN CORP	Ralph Lauren 公司	RL UN	美国纽约证券交易所	美国	924	700,221.71	0.18
451	VIACOMCBS INC - CLASS B	维亚康姆哥伦比亚广播公司	VIAC UQ	纳斯达克证券交易所	美国	3,637	699,826.54	0.18
452	SCHLUMBERGER LTD	斯伦贝谢公众有限公司	SLB UN	美国纽约证券交易所	美国	3,664	699,648.92	0.18
453	ZEBRA	斑马技术	ZBRA	纳斯达克	美国	184	698,246.26	0.18

	TECHNOLOGIES CORP-CL A	术公司	UQ	克 证 券 交 易 所				
454	QUANTA SERVICES INC	Quanta 服务股份有限公司	PWR UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	955	698,141.06	0.18
455	CINTAS CORP	CINTAS 公司	CTAS UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	247	697,903.19	0.18
456	NORWEGIAN CRUISE LINE HLDGS LTD	挪威邮轮控股有限公司	NCLH UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	5,272	697,127.20	0.18
457	SALESFORCE.COM INC	Salesforce.com 股份有限公司	CRM UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	430	696,710.36	0.18
458	UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	美国联合航空控股股份有限公司	UAL UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,495	696,424.72	0.18
459	SVB FINANCIAL GROUP	硅谷银行金融集团	SIVB UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	161	696,205.02	0.18
460	SNAP-ON INC	Snap-On 公司	SNA UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	506	694,838.32	0.18
461	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	第一资本金融	COF UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	751	694,712.79	0.18
462	ANALOG	模拟器	ADI UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	619	693,686.55	0.18

	G DEVIC ES INC	件		克 证 券 交 易 所				
463	HALLI BURTO N CO	哈利伯 顿	HAL UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	4,746	692,024.98	0.18
464	WELLS FARGO & CO	富国银 行	WFC UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,262	691,959.57	0.18
465	EMERS ON ELECT RIC CO	艾默生 电气	EMR UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,167	691,737.88	0.18
466	SKYWO RKS SOLUT IONS INC	思佳讯 解决方 案公司	SWKS UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	699	691,399.14	0.18
467	XILIN X INC	赛灵思	XLNX UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	511	690,790.07	0.18
468	EPAM Syste ms Inc	EPAM System s Inc	EPAM UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	162	690,417.54	0.18
469	DEXCO M INC	DexCom 股份有 限公司	DXCM UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	201	688,109.86	0.17
470	TWITT ER INC	推特公 司	TWTR UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,492	686,689.92	0.17
471	UNITE D RENTA LS INC	联合租 赁公司	URI UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	324	686,420.36	0.17
472	ONEOK INC	Oneok 股份有 限公司	OKE UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,831	685,958.76	0.17
473	INTUI T INC	Intuit 公司	INTU UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	167	684,863.28	0.17
474	Honey well Intl Inc	霍尼韦 尔	HON UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	515	684,639.56	0.17

475	REGENERON PHARMACEUTICALS	再生元制药股份有限公司	REGN UQ	纳斯达克证券交易所	美国	170	684,484.95	0.17
476	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	西方石油	OXY UN	美国纽约证券交易所	美国	3,691	682,213.23	0.17
477	DIAMONDBACK ENERGY INC	Diamondback 能源股份有限公司	FANG UQ	纳斯达克证券交易所	美国	989	680,055.43	0.17
478	L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	L3Harris Technologies 股份有	LHX UN	美国纽约证券交易所	美国	500	679,777.13	0.17
479	BESTBUY CO INC	百思买	BBY UN	美国纽约证券交易所	美国	1,049	679,511.90	0.17
480	ALIGN TECHNOLOGY INC	Align 科技股份有限公司	ALGN UQ	纳斯达克证券交易所	美国	162	678,777.17	0.17
481	CARRIER GLOBAL CORP	Carrier Global Corp	CARR UN	美国纽约证券交易所	美国	1,960	677,803.22	0.17
482	HESS CORP	赫斯公司	HES UN	美国纽约证券交易所	美国	1,434	676,838.06	0.17
483	GENERAL ELECTRIC CO	通用电气	GE UN	美国纽约证券交易所	美国	1,123	676,396.80	0.17
484	BOEING CO/TH E	波音	BA UN	美国纽约证券交易所	美国	526	675,150.42	0.17
485	PENTAIR PLC	Pentair 公共	PNR UN	美国纽约证券	美国	1,445	672,817.10	0.17

		有限公司		交易所				
486	GENERAL MOTOR S CO	通用汽车公司	GM UN	美国纽约证券交易所	美国	1,796	671,357.89	0.17
487	MEDTRONIC PLC	美敦力	MDT UN	美国纽约证券交易所	美国	1,010	666,161.83	0.17
488	BATH&BODY WORKS	蕾碧裳股份有限公司	BBWI UN	美国纽约证券交易所	美国	1,485	660,765.75	0.17
489	Coter ra Energy Inc	卡伯特石油天然气公司	CTRA UN	美国纽约证券交易所	美国	5,431	657,902.11	0.17
490	Solar Edge Technologies Inc	SolarEdge Technologies Inc	SEDG UQ	纳斯达克证券交易所	美国	367	656,500.66	0.17
491	ALBEMARLE CORP	雅保公司	ALB UN	美国纽约证券交易所	美国	432	643,873.27	0.16
492	ADOBE INC	奥多比	ADBE UQ	纳斯达克证券交易所	美国	177	639,926.59	0.16
493	CARMAX INC	CarMax股份有限公司	KMX UN	美国纽约证券交易所	美国	759	630,203.32	0.16
494	ORACLE CORP	甲骨文	ORCL UN	美国纽约证券交易所	美国	1,106	614,963.43	0.16
495	Enphase Energy Inc	Enphase 能源公司	ENPH UQ	纳斯达克证券交易所	美国	514	599,514.47	0.15
496	NEWS CORP - CLASS A	新闻集团	NWSA UQ	纳斯达克证券交易所	美国	3,873	550,902.75	0.14
497	FOX CORP - CLASS	福克斯公司	FOXA UQ	纳斯达克证券交易所	美国	2,152	506,286.69	0.13

	A							
498	DISCO VERY INC-C	探索通 信公司	DISCK UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	3,208	468,379.32	0.12
499	ALPHA BET INC-C L A	Alphab et 公 司	GOOGL UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	20	369,413.16	0.09
500	ALPHA BET INC-C L C	Alphab et 公 司	GOOG UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	19	350,524.57	0.09
501	UNDER ARMOU R INC-C LASS A	安德玛 公司	UAA UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,573	347,615.09	0.09
502	UNDER ARMOU R INC-C LASS C	安德玛 公司	UA UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,658	305,716.86	0.08
503	DISCO VERY INC - A	探索通 信公司	DISCA UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,786	268,049.98	0.07
504	FOX CORP - CLASS B	福克斯 公司	FOX UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,036	226,361.07	0.06
505	NEWS CORP - CLASS B	新闻集 团	NWS UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,249	179,173.11	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

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	Canad ian Pacif ic	加拿大 太平洋 铁路	CP UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,179	540,769.40	0.14

	Railway Limited							
--	-----------------	--	--	--	--	--	--	--

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	Penn National Gaming Inc	PENN UQ	1,136,259.34	0.52
2	MODERNA INC	MRNA UQ	1,113,635.51	0.51
3	Charles River Laboratories International Inc.	CRL UN	932,810.81	0.42
4	Enphase Energy Inc	ENPH UQ	928,989.46	0.42
5	TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	TDY UN	864,303.50	0.39
6	PTC Inc	PTC UQ	855,496.22	0.39
7	Organon & Co	OGN UN	824,703.26	0.37
8	MATCH GROUP INC	MTCH UQ	824,350.07	0.37
9	BIO-TECHNE	TECH UQ	816,995.27	0.37
10	Generac Holdings Inc	GNRC UN	794,761.22	0.36
11	Caesars Entertainment, Inc.	CZR UQ	786,682.98	0.36
12	Trimble Inc	TRMB UQ	773,969.43	0.35
13	CONOCOPHILLIPS	COP UN	769,681.29	0.35
14	Monolithic Power Systems	MPWR UQ	760,391.03	0.35
15	NXP SEMICONDUCTORS NV	NXPI UQ	760,168.94	0.35
16	CERIDIAN HCM HOLDING	CDAY UN	758,062.93	0.34
17	ANALOG DEVICES INC	ADI UQ	754,601.27	0.34
18	Signature Bank	SBNY UQ	740,171.10	0.34
19	Factset Research Systems Inc	FDS UN	720,006.55	0.33
20	BROWN & BROWN INC	BRO UN	708,269.96	0.32

注：本期累计买入金额指买入成交金额（成交单价乘以成交数量），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	ANALOG DEVICES INC	ADI UQ	826,867.72	0.38
2	PERRIGO CO PLC	PRGO UN	749,982.83	0.34
3	KANSAS CITY SOUTHERN	KSU UN	690,744.89	0.31
4	CONOCOPHILLIPS	COP UN	684,282.17	0.31
5	NVIDIA CORP	NVDA UQ	674,108.57	0.31
6	LEGGETT & PLATT INC	LEG UN	666,457.69	0.30
7	HANESBRANDS INC	HBI UN	662,431.57	0.30
8	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	VAR UN	651,726.67	0.30
9	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	ALXN UQ	643,312.60	0.29
10	WESTERN UNION CO	WU UN	629,894.60	0.29
11	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	MXIM UQ	626,926.49	0.28
12	FLIR SYSTEMS INC	FLIR UQ	617,615.16	0.28
13	HOLLYFRONTIER CORP	HFC UN	599,584.41	0.27
14	NOV INC	NOV UN	579,412.25	0.26
15	ARISTA NETWORKS INC	ANET UN	573,841.50	0.26
16	UNUM GROUP	UNM UN	572,869.25	0.26
17	XEROX HOLDINGS CORP	XRX UN	562,233.32	0.26
18	DEVON ENERGY CORP	DVN UN	551,198.49	0.25
19	SL GREEN REALTY CORP	SLG UN	542,260.88	0.25
20	FLOWSERVE CORP	FLS UN	542,257.62	0.25

注：本期累计卖出金额指卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），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	200,170,333.80
卖出收入（成交）总额	97,440,671.03

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	应收证券清算款	-
3	应收股利	381,084.98
4	应收利息	499.87
5	应收申购款	1,015,822.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,397,407.08

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

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 (%)
42,450	3,971.33	39,043,878.13	23.16	129,539,086.12	76.84

注：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	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	23,610.27	0.0140

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	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

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

基金合同生效日 (2011 年 3 月 23 日)	822,754,222.26
---------------------------	----------------

基金份额总额	
本报告期期初基金份额总额	112,448,859.42
本报告期基金总申购份额	183,558,840.42
减：本报告期基金总赎回份额	127,424,735.59
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	168,582,964.25

§ 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

1. 2021 年 9 月 3 日, 经大成基金管理有限公司 2021 年第四次临时股东会审议通过, 选举陈勇先生担任公司股东监事, 许国平先生不再担任公司股东监事。

2. 2021 年 9 月 3 日, 经大成基金管理有限公司第七届监事会第六次会议审议通过, 选举陈勇先生担任公司第七届监事会监事会主席。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

无

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

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

本基金聘任的为本基金审计的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), 本年度应支付的审计费用为 60,000.00 元整。该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

11.6 管理人、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, 基金管理人、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。

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	
摩根士丹利	1	291,570,563.76	100.00%	88,271.10	100.00%	-

注：1、公司作为管理人负责选择代理各投资组合证券买卖的境外券商，具体选择标准如下：

- （一）具备该机构所在国家或地区政府、监管机构核发的营业执照、业务许可证明文件；
- （二）资历雄厚，信誉良好；
- （三）财务状况良好，经营行为规范；
- （四）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度(包括但不限于公平交易制度及保密制度)，能满足各投资组合运作高度保密的要求；
- （五）证券研究或市场研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为各投资组合提供宏观经济、行业情况、个股分析、市场研究等各方面研究报告及周到的信息服务，并能根据各投资组合投资的特定要求，提供专题研究报告；
- （六）具备各投资组合运作所需的交易执行能力。能够准确、及时、高质量完成各投资组合下达的交易指令。
- （七）具备各投资组合运作所需的后台清算执行能力。能及时、高效处理交易清算、证券交收等后台清算业务。
- （八）能提供各投资组合运作、管理所需的其他服务。
- （九）相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

交易管理部在每半年 15 个交易日内，汇总上半年境外券商综合服务评价结果，作为当次境外券商交易量分配依据。并依此制作交易量分配计划，报部门及公司分管领导批准；

交易量分配计划获批后，作为选择交易券商的依据，供交易员在交易时进行券商选择。

券商服务出现重大失误或其他异常情况时，及时报公司监察稽核部及相关领导。可暂停与该券商的合作，并对其失误所造成的损失进行追偿。

2、本报告期内本基金无新增或退租境外交易单元。

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

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	关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 12 月 31 日
2	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金于 2021 年底及 2022 年境外（地区）主要市场节假日（含非港股通交易日）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	2021 年 12 月 28 日
3	关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资北京证券交易所股票及相关风险提示的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 11 月 16 日
4	关于终止晋城银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 11 月 12 日
5	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2021 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	2021 年 10 月 27 日
6	大成标普 500 等权重指数证券投资基金(人民币份额)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	2021 年 09 月 07 日
7	大成标普 500 等权重指数证券投资基金(美元份额)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	2021 年 09 月 07 日
8	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	2021 年 09 月 04 日
9	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	2021 年 09 月 04 日
10	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	2021 年 09 月 04 日
11	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	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 09 月 04 日
12	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加西部证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 09 月 01 日
13	大成基金管理有限公司旗下 122 只公募基金 2021 年中期报告提示性公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 08 月 31 日
14	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2021 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	2021 年 08 月 31 日

15	大成标普 500 等权重指数证券投资基金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	2021 年 08 月 27 日
16	大成基金管理有限公司关于变更分红方式业务规则的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 08 月 14 日
17	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2021 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	2021 年 07 月 21 日
18	关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 06 月 30 日
19	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加平安银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 06 月 28 日
20	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加海银基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 05 月 27 日
21	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	2021 年 04 月 23 日
22	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2021 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	2021 年 04 月 22 日
23	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2020 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	2021 年 03 月 30 日
24	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	2021 年 03 月 30 日
25	大成标普 500 等权重指数证券投资基金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	2021 年 03 月 30 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	2021 年 03 月 30 日
27	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	2021 年 03 月 23 日
28	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	2021 年 03 月 11 日
29	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加鼎信汇金（北京）投资管理	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本	2021 年 03 月 11 日

	有限公司为销售机构的公告	公司网站	
30	大成标普 500 等权重指数证券投资基金第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 01 月 22 日
31	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加江苏银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 01 月 16 日
32	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 2020 年度第一次分红的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 01 月 14 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

2022 年 3 月 29 日