

# 大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：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 2024 年 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
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合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	40
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	40
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.....	41
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	87
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	89
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.....	89

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 .....	89
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 .....	89
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 .....	89
7.11 投资组合报告附注.....	89
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>90</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	90
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	91
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 .....	91
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>91</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>92</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	92
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 .....	92
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	92
10.4 基金投资策略的改变.....	92
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	92
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 .....	92
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	92
10.8 其他重大事件.....	93
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>95</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	95
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	96
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>96</b>
12.1 备查文件目录.....	96
12.2 存放地点.....	96
12.3 查阅方式.....	96

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成标普 500 等权重指数证券投资基金	
基金简称	大成标普 500 等权重指数 (QDII)	
基金主代码	096001	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011 年 3 月 23 日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	277,456,503.38 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	大成标普 500 等权重指数(QDII)A	大成标普 500 等权重指数(QDII)C
下属分级基金的交易代码	096001	008401
报告期末下属分级基金的份额总额	260,278,386.48 份	17,178,116.90 份

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

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	大成基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	段皓静
	联系电话	0755-83183388
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn
		许俊
		010-66596688
		fxjd_hq@bank-of-china.com

客户服务电话	4008885558	95566
传真	0755-83199588	010-66594942
注册地址	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、 27-33 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、 27-33 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518054	100818
法定代表人	吴庆斌	葛海蛟

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

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

## 2.5 信息披露方式

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

## 2.6 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	大成标普 500 等权重指数(QDII)A	大成标普 500 等权重指数(QDII)C
本期已实现收益	16,036,320.58	947,331.57
本期利润	25,772,605.25	1,376,452.23
加权平均基金份	0.1017	0.0884

额本期利润		
本期加权平均净值利润率	4.25%	3.69%
本期基金份额净值增长率	4.19%	4.08%
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	178,682,796.52	11,704,451.82
期末可供分配基金份额利润	0.6865	0.6814
期末基金资产净值	628,754,275.19	41,491,446.49
期末基金份额净值	2.4157	2.4154
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	222.59%	8.01%

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成标普 500 等权重指数(QDII)A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.32%	0.38%	-0.45%	0.41%	0.13%	-0.03%
过去三个月	-2.44%	0.61%	-2.63%	0.67%	0.19%	-0.06%
过去六个月	4.19%	0.58%	5.08%	0.64%	-0.89%	-0.06%

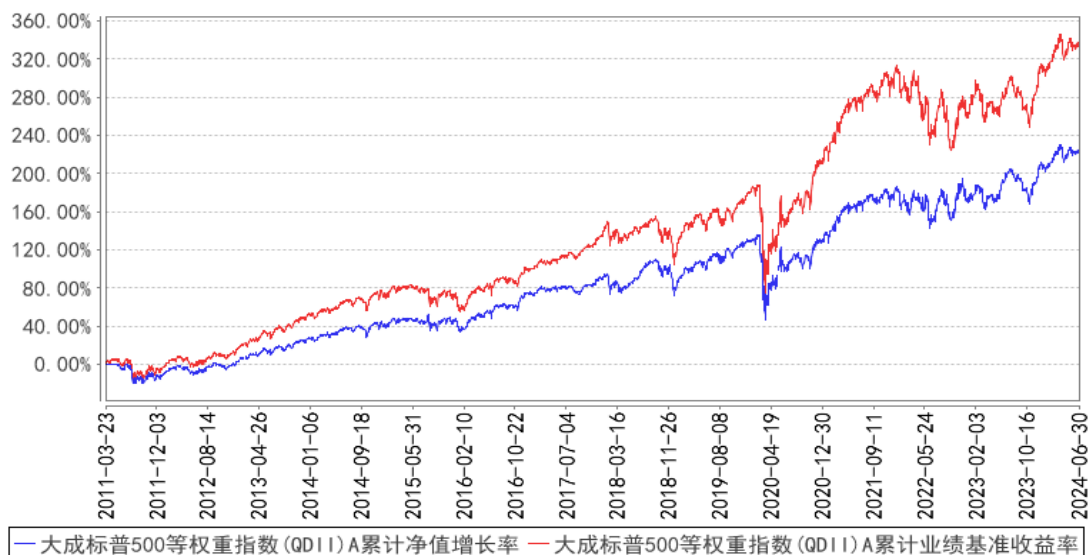
过去一年	7.62%	0.66%	11.79%	0.72%	-4.17%	-0.06%
过去三年	20.29%	1.01%	15.25%	1.05%	5.04%	-0.04%
自基金合同生效起至今	222.59%	1.12%	334.17%	1.16%	-111.58%	-0.04%

大成标普 500 等权重指数 (QDII)C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.34%	0.38%	-0.45%	0.41%	0.11%	-0.03%
过去三个月	-2.50%	0.61%	-2.63%	0.67%	0.13%	-0.06%
过去六个月	4.08%	0.58%	5.08%	0.64%	-1.00%	-0.06%
自基金合同生效起至今	8.01%	0.69%	11.15%	0.74%	-3.14%	-0.05%

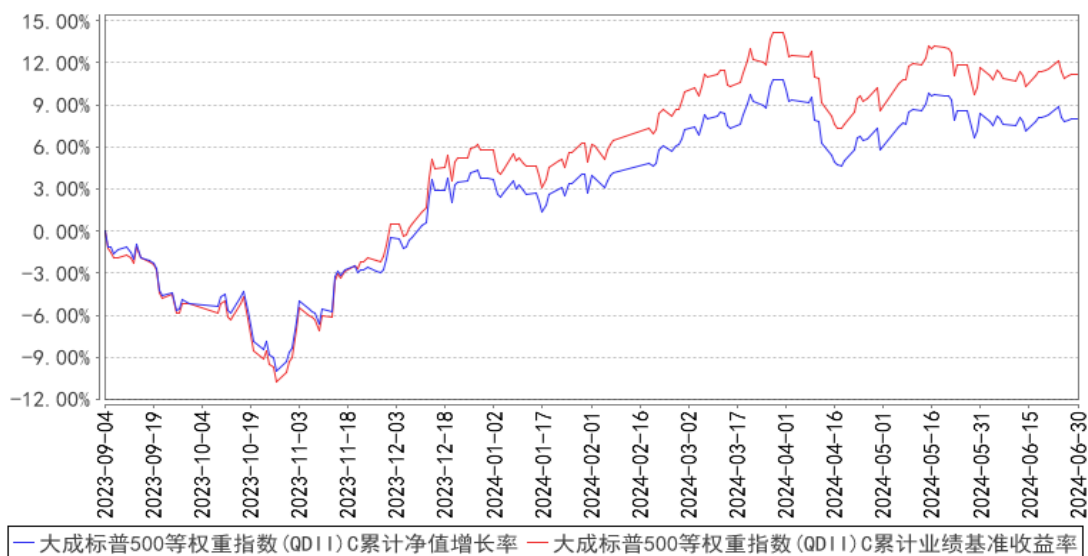
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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





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



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

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

3、同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

合实力不断提升，各项业务迅猛发展，管理资产种类位居同业前列。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
冉凌浩	本基金基金经理	2011年8月26日	-	21年	英国曼彻斯特大学商学院金融学硕士。2003年4月至2004年6月就职于国信证券研究部，任研究员。2004年6月至2005年9月就职于华西证券研究部，任高级研究员。2005年9月加入大成基金管理有限公司，曾担任金融工程师、境外市场研究员及基金经理助理，现任国际业务部基金经理。2011年8月26日起任大成标普500等权重指数型证券投资基金基金经理。2014年11月13日起任大成纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）（转型前为大成纳斯达克100指数证券投资基金）基金经理。2016年12月2日至2023年3月14日任大成恒生综合中小型股指数基金（QDII-LOF）基金经理。2016年12月29日至2020年7月7日任大成海外中国机会混合型证券投资基金（LOF）基金经理。2017年8月10日起任大成恒生指数证券投资基金（LOF）基金经理。2019年3月20日起任大成中华沪深港300指数证券投资基金（LOF）基金经理。2021年5月18日起任大成恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理。2021年9月9日起任大成恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。2023年7月12日起任大成纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理。2024年5月29日起任大成全球美元债债券型证券投资基金（QDII）基金经理。2024年6月18日起任大成恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年上半年，国际经济形势相对较为稳定，美股也继续保持升势并创出了历史新高。

从整体来看，上半年美国宏观经济韧性较强，并没有陷入经济衰退，但经济增速有所放缓。美国 2024 年 1 季度及 2 季度的 GDP 环比增速折年率分别为 1.4% 及 2.8%，保持在正增长区间。

分项来看，个人消费仍然是经济增长的主要支柱。最新公布的美国 2 季度个人消费实际增长季环比折年率为 2.3%，保持在较为健康的水平区间内，也仍然是 GDP 增长的重要支柱。较好的消费是由较好的劳动力市场推动的，美国 24 年 6 月份失业率为 4.1%，持续保持在低位水平区间，但较 2023 年的平均失业率水平有一定程度的上升。

从生产方面来看，美国 2 季度的 ISM 制造业 PMI 指数继续降至 50 以下的水平，这说明 3 月份 PMI 回到经济扩张区间只是昙花一现，而实际美国制造业景气程度仍然较低。

上半年，美国通胀水平继续在中等水平区间保持稳定，6 月份 CPI 为 3.0%，没有出现明显反弹。美国工资增速虽然有所下降，但仍然保持在高位，这对通胀的进一步下降形成了阻碍。同期，美联储既没有加息也没有降息，维持联邦基金目标利率区间不变。

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。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成标普 500 等权重指数(QDII)A 的基金份额净值为 2.4157 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.19%，同期业绩比较基准收益率为 5.08%；截至本报告期末大成标普 500 等权重指数(QDII)C 的基金份额净值为 2.4154 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.08%，同期业绩比较基准收益率为 5.08%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从美国宏观经济来看，长期看来，美国非政府部门资产负债表依然相对较为健康，这是保持经济长期增长的保障。从近期看来，当前市场一致预计今年下半年美联储会开始降息，但具体降息时间以及今年能有多大的降息空间则还有一定的不确定性。

今年以来，本基金基准指数成份股中多数核心企业经营情况稳定，市场预计 2024 年盈利水平持续提升，因此，如果美国经济能保持稳定的正增长，则美股中长期前景依然可期。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由公司各投研部门、交易管理部、风险管理部、监察稽核部、基金运营部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括八名投资组合经理。

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

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交易的债券品种的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内，大成标普 500 等权重指数(QDII)A 已分配利润 17,185,039.78 元，每十份基金份额分红 0.6940 元；大成标普 500 等权重指数(QDII)C 已分配利润 662,284.91 元，每十份基金份额分红 0.6922 元；符合基金合同规定的分红比例。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

报告截止日：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
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	49,216,536.02	31,359,238.59
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	623,112,175.79	420,451,075.44
其中：股票投资		623,112,175.79	420,451,075.44
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	5,516,281.79
应收股利		626,188.20	534,003.68
应收申购款		2,385,646.60	2,992,256.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	171,858.62	-
资产总计		675,512,405.23	460,852,855.90
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		4,467,580.35	4,264,000.73
应付管理人报酬		549,375.81	369,415.03
应付托管费		137,343.97	92,353.74
应付销售服务费		10,475.70	3,070.83
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	101,907.72	191,856.33
负债合计		5,266,683.55	4,920,696.66
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	277,456,503.38	190,869,817.52
未分配利润	6.4.7.12	392,789,218.30	265,062,341.72
净资产合计		670,245,721.68	455,932,159.24
负债和净资产总计		675,512,405.23	460,852,855.90

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 277,456,503.38 份，其中大成标普 500 等权重指数(QDII)A 基金份额总额为 260,278,386.48 份，基金份额净值 2.4157 元。大成标普 500 等权重指数(QDII)C 基金份额总额为 17,178,116.90 份，基金份额净值 2.4154 元。

## 6.2 利润表

会计主体：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

本报告期：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
<b>一、营业总收入</b>		31,408,854.81	37,555,418.21
1. 利息收入		65,137.95	28,727.54
其中：存款利息收入	6.4.7.13	65,137.95	28,727.54
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）		22,687,879.61	7,338,281.63

其中：股票投资收益	6.4.7.14	17,499,839.51	4,181,854.61
基金投资收益	6.4.7.15	-	-
债券投资收益	6.4.7.16	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.17	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	5,188,040.10	3,156,427.02
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	10,165,405.33	29,638,360.93
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-1,602,562.57	478,460.24
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.22	92,994.49	71,587.87
<b>减：二、营业总支出</b>		4,259,797.33	2,500,714.65
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,199,730.93	1,841,206.01
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	799,932.72	460,301.49
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	55,860.34	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.24	204,273.34	199,207.15
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		27,149,057.48	35,054,703.56
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		27,149,057.48	35,054,703.56
<b>五、其他综合收益的税后 净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		27,149,057.48	35,054,703.56

### 6.3 净资产变动表

会计主体：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

本报告期：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	190,869,817.52	-	265,062,341.72	455,932,159.24
二、本期期初净资产	190,869,817.52	-	265,062,341.72	455,932,159.24
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	86,586,685.86	-	127,726,876.58	214,313,562.44
(一)、综合收益总额	-	-	27,149,057.48	27,149,057.48
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	86,586,685.86	-	118,425,143.79	205,011,829.65
其中：1. 基金申购款	142,709,415.53	-	196,215,958.18	338,925,373.71
2. 基金赎回款	-56,122,729.67	-	-77,790,814.39	-133,913,544.06
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-17,847,324.69	-17,847,324.69
四、本期期末净资产	277,456,503.38	-	392,789,218.30	670,245,721.68
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	162,940,929.31	-	192,162,727.82	355,103,657.13
二、本期期初净资产	162,940,929.31	-	192,162,727.82	355,103,657.13
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	7,346,695.31	-	31,460,037.26	38,806,732.57
(一)、综合收益总额	-	-	35,054,703.56	35,054,703.56
(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)	7,346,695.31	-	8,232,392.85	15,579,088.16
其中：1. 基金申	43,277,947.47	-	50,121,201.43	93,399,148.90

购款				
2. 基金赎回款	-35,931,252.16	-	-41,888,808.58	-77,820,060.74
(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)	-	-	-11,827,059.15	-11,827,059.15
四、本期期末净资产	170,287,624.62	-	223,622,765.08	393,910,389.70

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：

<u>谭晓冈</u>	<u>范瑛</u>	<u>梁靖</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

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

根据本基金的基金管理人大成基金管理有限公司于 2021 年 9 月 4 日发布的《关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金增设基金份额并修订基金合同、托管协议的公告》以及更新的《大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同》,自 2021 年 9 月 7 日起,本基金增加美元基金份额,现有的基金份额变更为人民币基金份额。其中,以人民币计价并进行申购、赎回的份额类别,称为人民币基金份额;以美元计价并进行申购、赎回的份额类别,称为美元基金份额。各类基金

份额分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。

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

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

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 2024 年 8 月 29 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 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于 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

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

本基金在本报告期间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。

## 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	49,216,536.02
等于：本金	49,213,049.24
加：应计利息	3,486.78
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	49,216,536.02

### 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	537,471,120.80	-	623,112,175.79	85,641,054.99
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	537,471,120.80	-	623,112,175.79	85,641,054.99

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

### 6.4.7.6 其他债权投资

#### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

#### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

### 6.4.7.7 其他权益工具投资

#### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	171,858.62
合计	171,858.62

## 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	8,496.77
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
其他	3,903.35
预提费用	89,507.60
合计	101,907.72

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 大成标普 500 等权重指数 (QDII) A

项目	本期 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	182,508,938.23	182,508,938.23
本期申购	119,066,880.46	119,066,880.46
本期赎回 (以“-”号填列)	-41,297,432.21	-41,297,432.21
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	260,278,386.48	260,278,386.48

## 大成标普 500 等权重指数 (QDII) C

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	8,360,879.29	8,360,879.29
本期申购	23,642,535.07	23,642,535.07
本期赎回(以“-”号填列)	-14,825,297.46	-14,825,297.46
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	17,178,116.90	17,178,116.90

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

#### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

##### 大成标普 500 等权重指数(QDII)A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	126,645,751.79	126,782,574.23	253,428,326.02
本期期初	126,645,751.79	126,782,574.23	253,428,326.02
本期利润	16,036,320.58	9,736,284.67	25,772,605.25
本期基金份额交易产生的变动数	53,185,763.93	53,274,233.29	106,459,997.22
其中：基金申购款	80,122,171.26	83,515,828.45	163,637,999.71
基金赎回款	-26,936,407.33	-30,241,595.16	-57,178,002.49
本期已分配利润	-17,185,039.78	-	-17,185,039.78
本期末	178,682,796.52	189,793,092.19	368,475,888.71

##### 大成标普 500 等权重指数(QDII)C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,786,784.04	5,847,231.66	11,634,015.70
本期期初	5,786,784.04	5,847,231.66	11,634,015.70
本期利润	947,331.57	429,120.66	1,376,452.23
本期基金份额交易产生的变动数	5,632,621.12	6,332,525.45	11,965,146.57
其中：基金申购款	15,235,513.15	17,342,445.32	32,577,958.47
基金赎回款	-9,602,892.03	-11,009,919.87	-20,612,811.90
本期已分配利润	-662,284.91	-	-662,284.91
本期末	11,704,451.82	12,608,877.77	24,313,329.59

#### 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	65,137.95
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	-
合计	65,137.95

#### 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	17,499,839.51
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	17,499,839.51

##### 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	86,174,636.25
减：卖出股票成本总额	68,570,377.84
减：交易费用	104,418.90
买卖股票差价收入	17,499,839.51

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 6.4.7.15 基金投资收益

无。

#### 6.4.7.16 债券投资收益

##### 6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

##### 6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.17 资产支持证券投资收益

## 6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

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

无。

## 6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.18 贵金属投资收益

## 6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.19 衍生工具收益

## 6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	5,188,040.10
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	5,188,040.10

## 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	10,165,405.33
股票投资	10,165,405.33
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	10,165,405.33

## 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	92,246.82
其他	747.67
合计	92,994.49

## 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	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
指数使用费	103,828.22
银行划款手续费	10,937.52
合计	204,273.34

## 6.4.7.25 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
中国银行（香港）有限公司（“中银香港”）	境外资产托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 6.4.10.1.4 基金交易

无。

###### 6.4.10.1.5 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	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	3,199,730.93	1,841,206.01
其中：应支付销售机构的客户维护费	900,940.45	681,627.14
应支付基金管理人的净管理费	2,298,790.48	1,159,578.87

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：

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

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	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	799,932.72	460,301.49

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：

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

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

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

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给大成基金，再由大成基金计算并支付给各基金销售机构。其计

算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.30% / 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

份额单位：份

项目	本期	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
	大成标普 500 等权重指数 (QDII)A	大成标普 500 等权重指数 (QDII)C
基金合同生效日（2011 年 3 月 23 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	4,340.28
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	4,340.28
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.00%
项目	上年度可比期间	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	-
	大成标普 500 等权重指数 (QDII)A	大成标普 500 等权重指数 (QDII)C
基金合同生效日（2011 年 3 月 23 日）持有的基金份额	-	-

报告期初持有的基金份额	-	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注：基金管理人大成基金投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

#### 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	35,271,367.46	65,137.95	9,047,647.51	28,727.54
中银香港	13,945,168.56	-	18,485,904.25	-

注：本基金的银行存款由基金托管人和境外资产托管人保管，按银行约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

大成标普 500 等权重指数(QDII)A								
序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2024年1月18日	-	2024年1月17日	0.6940	11,332,568.59	5,852,471.19	17,185,039.78	-
合计	-	-	-	0.6940	11,332,568.59	5,852,471.19	17,185,039.78	-
大成标普 500 等权重指数(QDII)C								
序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分	现金形式	再投资形式	本期利	备注
		场内	场外					

				红数	发放总额	发放总额	合计	
1	2024 年 1 月 18 日	-	2024 年 1 月 17 日	0.6922	610,155.69	52,129.22	662,284.91	-
合计	-	-	-	0.6922	610,155.69	52,129.22	662,284.91	-

#### 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，将风险控制可在承受的范围之内。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

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

本期末，本基金无债券投资(上年度末：同)。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监

控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非正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。

#### 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。

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	35,271,367.46	-	-	13,945,168.56	49,216,536.02
交易性金融资产	-	-	-	623,112,175.79	623,112,175.79
应收股利	-	-	-	626,188.20	626,188.20
应收申购款	39,124.15	-	-	2,346,522.45	2,385,646.60
其他资产	-	-	-	171,858.62	171,858.62
资产总计	35,310,491.61	-	-	640,201,913.62	675,512,405.23

负债					
应付赎回款	-	-	-	4,467,580.35	4,467,580.35
应付管理人报酬	-	-	-	549,375.81	549,375.81
应付托管费	-	-	-	137,343.97	137,343.97
应付销售服务费	-	-	-	10,475.70	10,475.70
其他负债	-	-	-	101,907.72	101,907.72
负债总计	-	-	-	5,266,683.55	5,266,683.55
利率敏感度缺口	35,310,491.61	-	-	-634,935,230.07	670,245,721.68
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	19,756,173.95	-	-	11,603,064.64	31,359,238.59
交易性金融资产	-	-	-	420,451,075.44	420,451,075.44
应收股利	-	-	-	534,003.68	534,003.68
应收申购款	13,163.18	-	-	2,979,093.22	2,992,256.40
应收清算款	-	-	-	5,516,281.79	5,516,281.79
资产总计	19,769,337.13	-	-	441,083,518.77	460,852,855.90
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,264,000.73	4,264,000.73
应付管理人报酬	-	-	-	369,415.03	369,415.03
应付托管费	-	-	-	92,353.74	92,353.74
应付销售服务费	-	-	-	3,070.83	3,070.83
其他负债	-	-	-	191,856.33	191,856.33
负债总计	-	-	-	4,920,696.66	4,920,696.66
利率敏感度缺口	19,769,337.13	-	-	-436,162,822.11	455,932,159.24

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	美元	港币	其他币种	合计

	折合人民币元	折合人民币元	折合人民币元	
以外币计价的资产				
货币资金	13,947,057.45	-	-	13,947,057.45
交易性金融资产	623,112,175.79	-	-	623,112,175.79
应收股利	626,188.20	-	-	626,188.20
其他资产	146,479.61	-	-	146,479.61
资产合计	637,831,901.05	-	-	637,831,901.05
以外币计价的负债				
其他负债	3,903.35	-	-	3,903.35
负债合计	3,903.35	-	-	3,903.35
资产负债表外汇风险敞口净额	637,827,997.70	-	-	637,827,997.70
	上年度末 2023 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				
货币资金	11,603,064.64	-	-	11,603,064.64
交易性金融资产	420,451,075.44	-	-	420,451,075.44
应收股利	534,003.68	-	-	534,003.68
应收清算款	5,516,281	-	-	5,516,281.79

	.79			
资产合计	438,104,425.55	-	-	438,104,425.55
以外币计价的负债				
其他负债	3,879.19	-	-	3,879.19
负债合计	3,879.19	-	-	3,879.19
资产负债表外 外汇风险敞口净额	438,100,546.36	-	-	438,100,546.36

#### 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%	31,891,400.11	21,905,027.32
所有外币相对人民币贬值 5%	-31,891,400.11	-21,905,027.32	

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于标普 500 等权重指数成份股、备选成份股以及与标普 500 等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例为基金资产净值的 80%-95%，其中投资于与标普 500 等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例不超过 10%；投资于现金、银行存款、固定收益类证券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具的比例为基金资产净值的 5%-20%，其中投资于现金（不包括结算备付金、

存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。此外,本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控,定期运用多种定量方法对基金进行风险度量,包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险,及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末 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	623,112,175.79	92.97	420,451,075.44	92.22
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	623,112,175.79	92.97	420,451,075.44	92.22

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末(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%	30,865,811.60	21,130,686.25
	业绩比较基准下降5%	-30,865,811.60	-21,130,686.25

#### 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	623,112,175.79	420,451,075.44
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	623,112,175.79	420,451,075.44

##### 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，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的公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（上年度末：同）。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括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。

#### 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	623,112,175.79	92.24
	其中：普通股	623,112,175.79	92.24
	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	49,216,536.02	7.29
8	其他各项资产	3,183,693.42	0.47
9	合计	675,512,405.23	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	623,112,175.79	92.97
合计	623,112,175.79	92.97

注：股票的国家（地区）类别根据其所在证券交易所确定。

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

### 7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
通讯	30,190,382.32	4.50
非必需消费品	64,780,115.41	9.67
必需消费品	47,335,679.76	7.06
能源	30,711,555.73	4.58
金融	95,199,589.54	14.20
房地产	38,651,446.70	5.77
医疗保健	77,188,738.67	11.52
工业	89,602,478.21	13.37
材料	34,204,310.51	5.10
科技	77,362,281.03	11.54



公用事业	37,885,597.91	5.65
政府	-	-
合计	623,112,175.79	92.97

注：以上分类采用彭博行业分类标准。

### 7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

无。

### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	CARNIVAL CORP	嘉年华公司	CCL US	美国纽约证券交易所	美国	11,311	1,509,042.32	0.23
2	FEDEX CORP	联邦快递	FDX US	美国纽约证券交易所	美国	694	1,483,008.40	0.22
3	SYNCHRONY FINANCIAL	同步金融公司	SYF US	美国纽约证券交易所	美国	4,302	1,446,821.50	0.22
4	DIAMONDBACK ENERGY INC	Diamondback 能源股份有限公司	FANG US	纳斯达克证券交易所	美国	989	1,411,020.24	0.21
5	BAKER HUGHES CO	贝克休斯公司	BKR US	纳斯达克证券交易所	美国	5,622	1,409,151.80	0.21
6	NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDING	挪威邮轮控股有限公司	NCLH US	美国纽约证券交易所	美国	10,477	1,403,002.02	0.21
7	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	Discover 金融服务公司	DFS US	美国纽约证券交易所	美国	1,486	1,385,333.47	0.21

	CES							
8	TESLA INC	特斯拉 公司	TSLA US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	981	1,383,456.41	0.21
9	MGM RESOR TS INTER NATIO NAL	美高梅 国际酒 店集团	MGM US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	4,354	1,378,977.08	0.21
10	SALES FORCE INC	Salesf orce 股份有 限公司	CRM US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	748	1,370,560.61	0.20
11	EOG RESOU RCES INC	EOG 能 源公司	EOG US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,527	1,369,795.83	0.20
12	M & T BANK CORP	制造商 和贸易 商银行	MTB US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,267	1,366,728.67	0.20
13	TYSON FOODS INC-C L A	泰森食 品公司	TSN US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,350	1,364,204.93	0.20
14	CAESA RS ENTER TAINM ENT INC	西泽娱 乐公司	CZR US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	4,815	1,363,699.64	0.20
15	AT&T INC	美国电 话电报 公司	T US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	10,002	1,362,203.87	0.20
16	PRUDE NTIAL FINAN CIAL INC	美国保 德信金 融集团	PRU US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,628	1,359,688.82	0.20
17	SCHLU MBERG ER LTD	斯伦贝 谢公司	SLB US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	4,035	1,356,738.18	0.20
18	AVALO NBAY COMMU	艾芙隆 海湾社 区	AVB US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	920	1,356,506.56	0.20

	NITIE S INC							
19	AUTOD ESK INC	欧特克 有限公 司	ADSK US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	768	1,354,388.47	0.20
20	AMAZO N.COM INC	亚马 逊公 司	AMZN US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	981	1,351,086.27	0.20
21	IRON MOUNT AIN INC	铁山公 司	IRM US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,114	1,350,219.87	0.20
22	CHEVR ON CORP	雪佛龙 公司	CVX US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,209	1,347,761.83	0.20
23	WELLS FARGO & CO	富国银 行	WFC US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,176	1,344,275.83	0.20
24	TARGA RESOU RCES CORP	Targa 资源公 司	TRGP US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,458	1,338,136.81	0.20
25	ROCKW ELL AUTOM ATION INC	罗克韦 尔自动 化公司	ROK US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	682	1,337,992.27	0.20
26	TRUIS T FINAN CIAL CORP	Truist 金融公 司	TFC US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	4,831	1,337,588.83	0.20
27	OCCID ENTAL PETRO LEUM CORP	西方石 油公司	OXY US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,975	1,336,376.56	0.20
28	MCCOR MICK & CO-NO N VTG SHRS	味好美 有限公 司	MKC US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,643	1,336,235.23	0.20
29	BANK OF NEW YORK	纽约梅 隆银行	BK US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,130	1,335,959.28	0.20

	MELLO N CORP							
30	SERVIC ENOW INC	ServiceNow 公司	NOW US	美国纽约 证券交易所	美国	238	1,334,332.66	0.20
31	UDR INC	UDR 不动 产信托公 司	UDR US	美国纽约 证券交易所	美国	4,549	1,334,075.31	0.20
32	AFLAC INC	家庭人 寿保险公 司	AFL US	美国纽约 证券交易所	美国	2,095	1,333,455.99	0.20
33	PNC FINAN CIAL SERVI CES GROUP	PNC 金 融服务集 团公司	PNC US	美国纽约 证券交易所	美国	1,203	1,333,014.06	0.20
34	MOODY 'S CORP	穆迪公 司	MCO US	美国纽约 证券交易所	美国	444	1,331,948.46	0.20
35	CUMMI NS INC	康明斯 公司	CMI US	美国纽约 证券交易所	美国	673	1,328,249.44	0.20
36	EVERG Y INC	Evergy 公司	EVRG US	纳斯达 克证券交 易所	美国	3,516	1,327,313.19	0.20
37	FORD MOTOR CO	福特汽 车公司	F US	美国纽约 证券交易所	美国	14,850	1,327,145.57	0.20
38	ROYAL CARIB BEAN CRUIS ES LTD	皇家加 勒比国际 游轮有限 公司	RCL US	美国纽约 证券交易所	美国	1,168	1,327,111.65	0.20
39	DEVON ENERG Y CORP	戴文能 源公司	DVN US	美国纽约 证券交易所	美国	3,927	1,326,581.13	0.20
40	CITIG ROUP INC	花旗集 团	C US	美国纽约 证券交易所	美国	2,924	1,322,427.91	0.20
41	LOCKH EED MARTI N CORP	洛克希 德马丁公 司	LMT US	美国纽约 证券交易所	美国	397	1,321,584.53	0.20

42	ELEVANCE HEALTH INC	Elevance 健康公司	ELV US	美国纽约证券交易所	美国	342	1,320,710.92	0.20
43	CORPAY INC	Corpay 公司	CPAY US	美国纽约证券交易所	美国	695	1,319,562.30	0.20
44	PALO ALTO NETWORKS INC	Palo Alto Networks 公司	PANW US	纳斯达克证券交易所	美国	546	1,319,166.83	0.20
45	ARISTA NETWORKS INC	ARISTA 网络公司	ANET US	美国纽约证券交易所	美国	528	1,318,838.86	0.20
46	HUNTINGTON BANCSHARES INC	亨廷顿银行	HBAN US	纳斯达克证券交易所	美国	14,027	1,317,573.28	0.20
47	JPMORGAN CHASE & CO	摩根大通	JPM US	美国纽约证券交易所	美国	914	1,317,500.44	0.20
48	MOSAIC CO/THIE	美盛公司	MOS US	美国纽约证券交易所	美国	6,388	1,315,701.35	0.20
49	L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	L3 哈里斯科技公司	LHX US	美国纽约证券交易所	美国	822	1,315,641.20	0.20
50	FAIR ISAAC CORP	Fair Isaac 公司	FICO US	美国纽约证券交易所	美国	124	1,315,563.38	0.20
51	KEYCORP	科凯国际集团	KEY US	美国纽约证券交易所	美国	12,987	1,315,217.23	0.20
52	TYLER TECHNOLOGIES INC	泰勒科技公司	TYL US	美国纽约证券交易所	美国	367	1,315,038.99	0.20

53	REPUB LIC SERVI CES INC	共和废 品处理 公司	RSG US	美国纽 约证券 交易所	美国	949	1,314,386.17	0.20
54	ALLST ATE CORP	好事达 保险公 司	ALL US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,155	1,314,233.95	0.20
55	TE CONNE CTIVI TY LTD	泰科电 子有限 公司	TEL US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,224	1,312,231.46	0.20
56	HESS CORP	赫斯公 司	HES US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,248	1,312,079.23	0.20
57	DIGIT AL REALT Y TRUST INC	数字房 地产信 托公司	DLR US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,210	1,311,192.23	0.20
58	COCA- COLA CO/TH E	可口可 乐公司	KO US	美国纽 约证券 交易所	美国	2,890	1,310,964.17	0.20
59	UNITE DHEAL TH GROUP INC	联合健 康集团 公司	UNH US	美国纽 约证券 交易所	美国	361	1,310,211.29	0.20
60	EPAM SYSTE MS INC	亿盘系 统公司	EPAM US	美国纽 约证券 交易所	美国	977	1,309,788.03	0.20
61	APA CORP	阿帕奇 公司	APA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	6,237	1,308,603.63	0.20
62	COGNI ZANT TECH SOLUT IONS- A	高知特 科技公司	CTSH US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,700	1,308,480.48	0.20
63	ACCEN TURE PLC-C	埃森哲 公司	ACN US	美国纽 约证券 交易所	美国	605	1,308,217.14	0.20

	L A							
64	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	爱德华兹生命科学公司	EW US	美国纽约证券交易所	美国	1,987	1,308,047.10	0.20
65	NISOURCE INC	尼索思公司	NI US	美国纽约证券交易所	美国	6,369	1,307,702.87	0.20
66	ONEOK INC	欧尼克公司	OKE US	美国纽约证券交易所	美国	2,250	1,307,678.72	0.20
67	EBAY INC	eBay 公司	EBAY US	纳斯达克证券交易所	美国	3,415	1,307,438.54	0.20
68	AMERIPRISE FINANCIAL INC	阿默普莱斯金融公司	AMP US	美国纽约证券交易所	美国	429	1,306,089.51	0.19
69	LIVENATION ENTERTAINMENT INC	理想国演艺股份有限公司	LYV US	美国纽约证券交易所	美国	1,955	1,306,069.48	0.19
70	GLOBELIFE INC	环球人寿公司	GL US	美国纽约证券交易所	美国	2,227	1,305,897.44	0.19
71	PEPSICO INC	百事公司	PEP US	纳斯达克证券交易所	美国	1,111	1,305,895.09	0.19
72	PINNACLE WESTCAPITAL	品尼高西方资本公司	PNW US	美国纽约证券交易所	美国	2,399	1,305,883.62	0.19
73	CONAGRA BRANDS INC	康尼格拉品牌公司	CAG US	美国纽约证券交易所	美国	6,445	1,305,393.86	0.19
74	EXXON MOBIL CORP	埃克森美孚公司	XOM US	美国纽约证券交易所	美国	1,590	1,304,495.17	0.19

75	HONEY WELL INTER NATIO NAL INC	霍尼韦 尔国际 公司	HON US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	857	1,304,231.34	0.19
76	COTER RA ENERG Y INC	科特拉 能源公 司	CTRA US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	6,861	1,304,082.32	0.19
77	GILEA D SCIEN CES INC	吉利德 科学公 司	GILD US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,666	1,303,593.35	0.19
78	CORTE VA INC	科迪华 公司	CTVA US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,390	1,303,182.42	0.19
79	C. H. ROBIN SON WORLD WIDE INC	罗宾升 国际联 运股份 有限公 司	CHRW US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,075	1,303,128.25	0.19
80	HILTO N WORLD WIDE HOLDI NGS IN	希尔顿 全球控 股公司	HLT US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	836	1,300,036.65	0.19
81	BORGW ARNER INC	博格华 纳公司	BWA US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	5,658	1,300,027.53	0.19
82	DOLLA R GENER AL CORP	达乐公 司	DG US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,379	1,299,537.56	0.19
83	FMC CORP	富美实 公司	FMC US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,166	1,298,526.48	0.19
84	MARAT HON OIL CORP	马拉松 石油公 司	MRO US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	6,355	1,298,487.64	0.19



85	INTUIT INC	财捷公司	INTU US	纳斯达克证券交易所	美国	277	1,297,413.77	0.19
86	CARMAX INC	车美仕公司	KMX US	美国纽约证券交易所	美国	2,481	1,296,767.87	0.19
87	TARGET CORP	塔吉特公司	TGT US	美国纽约证券交易所	美国	1,229	1,296,658.26	0.19
88	MID-AMERICA APARTMENT COMM	MAA 房产信托	MAA US	美国纽约证券交易所	美国	1,275	1,295,850.01	0.19
89	UNITED RENTALS INC	美国联合租赁有限公司	URI US	美国纽约证券交易所	美国	281	1,295,161.42	0.19
90	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	奥莱利汽车股份有限公司	ORLY US	纳斯达克证券交易所	美国	172	1,294,528.49	0.19
91	NASDAQ INC	纳斯达克公司	NDAQ US	纳斯达克证券交易所	美国	3,014	1,294,395.36	0.19
92	DUKE ENERGY CORP	杜克能源公司	DUK US	美国纽约证券交易所	美国	1,812	1,294,346.33	0.19
93	AMGEN INC	安进公司	AMGN US	纳斯达克证券交易所	美国	581	1,293,752.59	0.19
94	COMCAST CORP-CLASS A	康卡斯特公司	CMCSA US	纳斯达克证券交易所	美国	4,634	1,293,282.15	0.19
95	VIATRIS INC	晖致公司	VTRS US	纳斯达克证券交易所	美国	17,061	1,292,505.26	0.19
96	CHARTER COMMUNICATIONS	特许通讯公司	CHTR US	纳斯达克证券交易所	美国	606	1,291,160.65	0.19

	IONS INC-A							
97	INTUI TIVE SURGI CAL INC	直觉外 科手术 公司	ISRG US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	407	1,290,335.29	0.19
98	UNIVE RSAL HEALT H SERVI CES-B	环球健 康服务 公司	UHS US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	979	1,290,281.98	0.19
99	CORNI NG INC	康宁公 司	GLW US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	4,658	1,289,689.25	0.19
100	DEERE & CO	迪尔公 司	DE US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	484	1,288,788.56	0.19
101	QORVO INC	科沃公 司	QRVO US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,558	1,288,456.45	0.19
102	CITIZ ENS FINAN CIAL GROUP	公民金 融集团	CFG US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	5,012	1,286,974.36	0.19
103	LOEWS CORP	洛斯保 险公司	L US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,416	1,286,899.39	0.19
104	HUMAN A INC	哈门那 公司	HUM US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	483	1,286,194.62	0.19
105	CISCO SYSTE MS INC	思科	CSCO US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	3,798	1,285,981.03	0.19
106	MONST ER BEVER AGE CORP	怪物饮 料公司	MNST US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	3,612	1,285,812.98	0.19
107	EQUIT Y RESID ENTIA	公平住 屋公司	EQR US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,601	1,285,342.18	0.19

	L							
108	ROSS STORE S INC	罗斯百货公司	ROST US	纳斯达克证券交易所	美国	1,241	1,285,262.22	0.19
109	CSX CORP	CSX 运输公司	CSX US	纳斯达克证券交易所	美国	5,391	1,285,168.36	0.19
110	EXTRA SPACE STORAGE INC	额外空间仓储公司	EXR US	美国纽约证券交易所	美国	1,160	1,284,788.15	0.19
111	VALERO ENERGY CORP	瓦莱罗能源公司	VLO US	美国纽约证券交易所	美国	1,150	1,284,776.74	0.19
112	AIRBNB INC-CLASS A	爱彼迎	ABNB US	纳斯达克证券交易所	美国	1,188	1,283,796.38	0.19
113	BUNGE GLOBAL SA	邦吉有限公司	BG US	美国纽约证券交易所	美国	1,687	1,283,686.27	0.19
114	PROGRESSIVE CORP	前进保险公司	PGR US	美国纽约证券交易所	美国	867	1,283,426.71	0.19
115	GARTNER INC	加特纳公司	IT US	美国纽约证券交易所	美国	401	1,283,344.68	0.19
116	ARCH CAPITAL GROUP LTD	艾奇资本集团	ACGL US	纳斯达克证券交易所	美国	1,784	1,282,736.77	0.19
117	UBER TECHNOLOGIES INC	优步	UBER US	美国纽约证券交易所	美国	2,476	1,282,508.14	0.19
118	VERIZON COMMUNICATIONS INC	威瑞森电信公司	VZ US	美国纽约证券交易所	美国	4,354	1,279,680.80	0.19
119	CHURCH & DWIGHT	丘奇& 迪怀特	CHD US	美国纽约证券交易所	美国	1,731	1,279,047.37	0.19

	H & DWIGHT CO INC	德怀特公司		约 证 券 交 易 所				
120	HOLOGIC INC	豪洛捷公司	HOLX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,416	1,278,462.40	0.19
121	WILLIAMS COS INC	威廉姆斯公司	WMB US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	4,214	1,276,374.25	0.19
122	LKQ CORP	LKQ 公司	LKQ US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	4,306	1,276,313.95	0.19
123	HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	亨廷顿英戈尔斯工业公司	HII US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	727	1,276,280.96	0.19
124	PHILLIPS 66	菲利普 66	PSX US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,268	1,275,722.57	0.19
125	METLIFE INC	大都会人寿保险公司	MET US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,550	1,275,586.73	0.19
126	S&P GLOBAL INC	标普全球公司	SPGI US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	401	1,274,599.67	0.19
127	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	哈特福德金融服务公司	HIG US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,776	1,272,554.57	0.19
128	BIOGEN INC	生物基因公司	BIIB US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	770	1,272,143.78	0.19
129	ELI LILLY & CO	礼来公司	LLY US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	197	1,271,135.05	0.19
130	MOTOROLA SOLUTIONS	摩托罗拉解决方案公司	MSI US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	462	1,271,101.13	0.19

	INC							
131	ALTRIA GROUP INC	高特利集团公司	MO US	美国纽约证券交易所	美国	3,915	1,270,909.77	0.19
132	WARNER BROS DISCOVERY INC	华纳兄弟探索公司	WBD US	纳斯达克证券交易所	美国	23,966	1,270,758.61	0.19
133	NORTHROP GRUMMAN CORP	诺斯罗普-格鲁曼公司	NOC US	美国纽约证券交易所	美国	409	1,270,733.74	0.19
134	AMERICAN EXPRESS CO	美国运通公司	AXP US	美国纽约证券交易所	美国	770	1,270,662.12	0.19
135	INCYTE CORP	因塞特医疗公司	INCY US	纳斯达克证券交易所	美国	2,941	1,270,590.28	0.19
136	OTIS WORLDWIDE CORP	奥的斯	OTIS US	美国纽约证券交易所	美国	1,852	1,270,519.72	0.19
137	PAYPAL HOLDINGS INC	Paypal 控股有限公司	PYPL US	纳斯达克证券交易所	美国	3,072	1,270,481.52	0.19
138	F5 INC	F5 公司	FFIV US	纳斯达克证券交易所	美国	1,035	1,270,409.47	0.19
139	CAMPBELL SOUP CO	康宝浓汤公司	CPB US	美国纽约证券交易所	美国	3,944	1,270,205.00	0.19
140	DANAHER CORP	丹纳赫公司	DHR US	美国纽约证券交易所	美国	713	1,269,589.89	0.19
141	JACK HENRY & ASSOC	杰克亨利公司	JKHY US	纳斯达克证券交易所	美国	1,073	1,269,564.30	0.19

	IATES INC							
142	GLOBA L PAYME NTS INC	环汇有 限公司	GPN US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,842	1,269,435.59	0.19
143	MOLSO N COORS BEVER AGE CO - B	莫尔森 库尔斯 饮料公 司	TAP US	美国纽 约证券 交易所	美国	3,503	1,268,980.12	0.19
144	HALLI BURTO N CO	哈利伯 顿公司	HAL US	美国纽 约证券 交易所	美国	5,270	1,268,717.21	0.19
145	BOEIN G CO/TH E	波音公 司	BA US	美国纽 约证券 交易所	美国	978	1,268,611.59	0.19
146	WILLI S TOWER S WATSO N PLC	韦莱韬 悦股份 有限公司	WTW US	纳斯达 克证券 交易所	美国	679	1,268,520.94	0.19
147	NEWMO NT CORP	纽蒙特 公司	NEM US	美国纽 约证券 交易所	美国	4,250	1,268,196.24	0.19
148	EVERE ST GROUP LTD	艾弗再 保险有 限公司	EG US	美国纽 约证券 交易所	美国	467	1,268,116.71	0.19
149	COLGA TE-PA LMOLI VE CO	高露洁 公司	CL US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,833	1,267,674.70	0.19
150	CBRE GROUP INC - A	世邦魏 理仕集 团公司	CBRE US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,996	1,267,598.02	0.19
151	LAM RESEA RCH CORP	拉姆研 究公司	LRCX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	167	1,267,358.49	0.19

152	GEN DIGITAL INC	数字时代公司	GEN US	纳斯达克证券交易所	美国	7,114	1,266,487.38	0.19
153	BLACKSTONE INC	黑石公司	BX US	美国纽约证券交易所	美国	1,435	1,266,097.40	0.19
154	FRANKLIN RESOURCES INC	富兰克林资源公司	BEN US	美国纽约证券交易所	美国	7,948	1,265,989.07	0.19
155	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	斑马技术公司	ZBRA US	纳斯达克证券交易所	美国	575	1,265,967.34	0.19
156	TAPETRY INC	挂毯公司	TPR US	美国纽约证券交易所	美国	4,150	1,265,566.45	0.19
157	ROPER TECHNOLOGIES INC	儒博科技公司	ROP US	纳斯达克证券交易所	美国	315	1,265,384.01	0.19
158	VENTAS INC	芬塔公司	VTR US	美国纽约证券交易所	美国	3,463	1,265,102.36	0.19
159	LAS VEGAS SANDS CORP	金沙集团	LVS US	美国纽约证券交易所	美国	4,011	1,264,912.57	0.19
160	PUBLIC STORAGE	大众仓储信托公司	PSA US	美国纽约证券交易所	美国	617	1,264,864.82	0.19
161	ALLIANT ENERGY CORP	美国联合能源公司	LNT US	纳斯达克证券交易所	美国	3,486	1,264,560.86	0.19
162	US BANCORP	美国合众银行	USB US	美国纽约证券交易所	美国	4,468	1,264,148.93	0.19
163	TERADYNE INC	泰瑞达公司	TER US	纳斯达克证券交易所	美国	1,196	1,263,972.47	0.19

164	ORACLE CORP	甲骨文公司	ORCL US	美国纽约证券交易所	美国	1,256	1,263,918.02	0.19
165	OMNICOM GROUP	宏盟集团	OMC US	美国纽约证券交易所	美国	1,977	1,263,844.62	0.19
166	OLD DOMINION FREIGHT LINE	统领货运线公司	ODFL US	纳斯达克证券交易所	美国	1,004	1,263,627.25	0.19
167	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	IBM 公司	IBM US	美国纽约证券交易所	美国	1,025	1,263,394.56	0.19
168	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	瑞杰金融公司	RJF US	美国纽约证券交易所	美国	1,434	1,263,273.33	0.19
169	ELECTRONIC ARTS INC	艺电公司	EA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,272	1,263,066.80	0.19
170	NUCOR CORP	纽柯钢铁公司	NUE US	美国纽约证券交易所	美国	1,121	1,262,923.69	0.19
171	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	微芯科技公司	MCHP US	纳斯达克证券交易所	美国	1,936	1,262,469.86	0.19
172	PTC INC	参数科技公司	PTC US	纳斯达克证券交易所	美国	975	1,262,357.61	0.19
173	ARTHUR J GALLAGHER & CO	亚瑟加拉格尔有限公司	AJG US	美国纽约证券交易所	美国	683	1,262,218.50	0.19
174	NETAP	美国网	NTAP	纳斯达克	美国	1,375	1,262,156.28	0.19



	P INC	存公司	US	克 证 券 交 易 所				
175	GARMI N LTD	佳明公 司	GRMN US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,087	1,262,113.80	0.19
176	CLORO X COMPA NY	高乐氏 公司	CLX US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,297	1,261,454.93	0.19
177	TRIMB LE INC	天宝公 司	TRMB US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	3,165	1,261,349.53	0.19
178	EXPED ITORS INTL WASH INC	康捷国 际物流 公司	EXPD US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,418	1,261,103.08	0.19
179	MARAT HON PETRO LEUM CORP	马拉松 原油公 司	MPC US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,020	1,261,084.41	0.19
180	GENER AL ELECT RIC CO	通用电 气航空 航天公 司	GE US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,113	1,260,970.45	0.19
181	REGIO NS FINAN CIAL CORP	地区金 融公司	RF US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	8,828	1,260,824.42	0.19
182	PFIZE R INC	辉瑞制 药有限 公司	PFE US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	6,320	1,260,257.70	0.19
183	VERIS K ANALY TICS INC	Verisk Analyt ics 公 司	VRSK US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	656	1,260,194.98	0.19
184	CONST ELLAT ION BRAND S INC-A	星座品 牌公司	STZ US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	687	1,259,671.59	0.19

185	FORTIVE CORP	Fortive 公司	FTV US	美国 纽约 证券 交易所	美国	2,385	1,259,508.67	0.19
186	GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	奇异医疗 保健 科技 公司	GEHC US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,268	1,259,466.34	0.19
187	UNION PACIFIC CORP	联合太 平洋公 司	UNP US	美国 纽约 证券 交易所	美国	781	1,259,370.13	0.19
188	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	芯源系 统有限 公司	MPWR US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	215	1,259,029.04	0.19
189	WASTE MANAGEMENT INC	美国废 物管理 公司	WM US	美国 纽约 证券 交易所	美国	828	1,258,917.29	0.19
190	MARSH & MCLENAN COS	威达信 集团	MMC US	美国 纽约 证券 交易所	美国	838	1,258,474.29	0.19
191	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CLASS B	波克夏 海瑟威 公司	BRK/B US	美国 纽约 证券 交易所	美国	434	1,258,245.09	0.19
192	NORTHERN TRUST CORP	北美信 托公司	NTRS US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,102	1,258,065.21	0.19
193	MORGAN STANLEY	摩根士 丹利	MS US	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,816	1,257,859.10	0.19
194	ABBVIE INC	艾伯维 公司	ABBV US	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,029	1,257,838.01	0.19
195	DOVER CORP	都福公 司	DOV US	美国 纽约 证 券	美国	978	1,257,738.38	0.19

				交易所				
196	HUNT (JB) TRANS PRT SVCS INC	JB 亨 特运输 服务公 司	JBHT US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,103	1,257,737.66	0.19
197	INTEL CORP	英特尔 公司	INTC US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	5,698	1,257,645.44	0.19
198	DARDE N RESTA URANT S INC	达登饭 店集团 公司	DRI US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,166	1,257,446.32	0.19
199	ZOETI S INC	硕腾公 司	ZTS US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,017	1,256,505.58	0.19
200	ARCHE R-DAN IELS- MIDLA ND CO	阿彻丹 尼尔斯 米德兰 公司	ADM US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,916	1,256,256.71	0.19
201	DAVIT A INC	达维塔 公司	DVA US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,272	1,256,177.18	0.19
202	CHUBB LTD	丘博保 险有限 公司	CB US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	691	1,256,171.76	0.19
203	GODAD DY INC - CLASS A	GoDadd y 公司	GDDY US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,261	1,255,559.07	0.19
204	ALLEG ION PLC	安朗杰 有限公 司	ALLE US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,491	1,255,468.85	0.19
205	ADVAN CED MICRO DEVIC ES	美国超 威半导 体公司	AMD US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,086	1,255,457.52	0.19
206	STEEL DYNAM ICS	钢铁动 态公司	STLD US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,360	1,255,172.02	0.19

	INC							
207	LEIDOS HOLDINGS INC	雷多斯控股公司	LDOS US	美国纽约证券交易所	美国	1,207	1,254,866.70	0.19
208	IDEX CORP	IDEX 公司	IEX US	美国纽约证券交易所	美国	875	1,254,673.14	0.19
209	TJX COMPANIES INC	TJX 公司	TJX US	美国纽约证券交易所	美国	1,599	1,254,672.43	0.19
210	CBOE GLOBAL MARKETS INC	芝加哥选择权交易所全球市场公司	CBOE US	巴兹全球市场	美国	1,035	1,254,403.03	0.19
211	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	公共服务企业集团公司	PEG US	美国纽约证券交易所	美国	2,388	1,254,285.44	0.19
212	KINDER MORGAN INC	金德摩根公司	KMI US	美国纽约证券交易所	美国	8,857	1,254,235.48	0.19
213	FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	辉盛研究系统公司	FDS US	美国纽约证券交易所	美国	431	1,254,062.87	0.19
214	MOHAWK INDUSTRIES INC	莫霍克工业公司	MHK US	美国纽约证券交易所	美国	1,548	1,253,157.41	0.19
215	BANK OF AMERICA CORP	美国银行	BAC US	美国纽约证券交易所	美国	4,421	1,253,056.57	0.19

216	NORDSON CORP	诺信公司	NDSN US	纳斯达克证券交易所	美国	758	1,252,966.41	0.19
217	INVITATION HOMES INC	邀请回家公司	INVH US	美国纽约证券交易所	美国	4,898	1,252,814.61	0.19
218	STATE STREET CORP	道富公司	STT US	美国纽约证券交易所	美国	2,375	1,252,535.10	0.19
219	GENERAL MILLS INC	通用磨坊公司	GIS US	美国纽约证券交易所	美国	2,778	1,252,437.32	0.19
220	3M CO	3M 公司	MMM US	美国纽约证券交易所	美国	1,719	1,251,926.54	0.19
221	SMURFIT WESTROCK PLC	SMURFIT WESTROCK 公司	SW US	美国纽约证券交易所	美国	3,494	1,251,526.23	0.19
222	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	齐默尔控股公司	ZBH US	美国纽约证券交易所	美国	1,618	1,251,477.06	0.19
223	GENUINE PARTS CO	通用配件公司	GPC US	美国纽约证券交易所	美国	1,269	1,250,953.52	0.19
224	REGENERON PHARMACEUTICALS	再生元制药股份有限公司	REGN US	纳斯达克证券交易所	美国	167	1,250,910.26	0.19
225	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	CF 实业控股公司	CF US	美国纽约证券交易所	美国	2,368	1,250,868.57	0.19
226	GOLDM	高盛集	GS US	美国纽	美国	388	1,250,754.54	0.19

	AN SACHS GROUP INC	团		约 证 券 交 易 所				
227	COPART INC	科帕特公司	CPRT US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	3,240	1,250,599.46	0.19
228	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	阿卡迈技术公司	AKAM US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,947	1,249,939.23	0.19
229	EXPEA GROUP INC	亿客行	EXPE US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,392	1,249,884.50	0.19
230	DUPONT DE NEMOURS INC	杜邦公司	DD US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,178	1,249,379.50	0.19
231	FREEMORT-MCMORAN INC	自由港麦克莫兰公司	FCX US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,606	1,248,983.10	0.19
232	WALMART INC	沃尔玛公司	WMT US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,588	1,248,853.97	0.19
233	CAMDEN PROPERTYS TRUST	卡姆登物业信托	CPT US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,606	1,248,833.87	0.19
234	TELEFLEX INC	泰利福公司	TFX US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	833	1,248,650.21	0.19
235	MICROSOFT CORP	微软公司	MSFT US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	392	1,248,646.72	0.19
236	SYSCO CORP	西斯科公司	SYU US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,454	1,248,551.65	0.19
237	HOST HOTELS & RESOR	豪斯特酒店及度假村公司	HST US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	9,737	1,247,697.86	0.19

	TS INC							
238	UNITED PARCEL SERVICES-CL B	联合包裹服务 公司	UPS US	美国纽约 证券交易所	美国	1,279	1,247,412.00	0.19
239	SOUTHWEST AIRLINES CO	西南航空公司	LUV US	美国纽约 证券交易所	美国	6,113	1,246,426.93	0.19
240	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	百时美施贵宝 公司	BMJ US	美国纽约 证券交易所	美国	4,211	1,246,354.95	0.19
241	LYONDELL SELLER INDUSTRIAL	利安德巴塞尔 工业公司	LYB US	美国纽约 证券交易所	美国	1,828	1,246,238.43	0.19
242	NETFLIX INC	奈飞公司	NFLX US	纳斯达克 证券交易所	美国	259	1,245,721.31	0.19
243	WYNN RESORTS LTD	永利度假公司	WYNN US	纳斯达克 证券交易所	美国	1,953	1,245,718.32	0.19
244	GE VERNOVA INC	奇异维诺瓦 公司	GEV US	美国纽约 证券交易所	美国	1,019	1,245,541.50	0.19
245	TEXTRON INC	德事隆集团	TXT US	美国纽约 证券交易所	美国	2,035	1,245,230.84	0.19
246	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	国际香料香 精公司	IFF US	美国纽约 证券交易所	美国	1,835	1,245,125.72	0.19
247	DOLLAR TREE INC	美元树	DLTR US	纳斯达克 证券交易所	美国	1,636	1,244,878.92	0.19
248	ILLINOIS TOOL	伊利诺伊工 具集团	ITW US	美国纽约 证券交易所	美国	737	1,244,620.93	0.19

	WORKS							
249	KENVUE INC	Kenvue 公司	KVUE US	美国 纽约 证券 交易所	美国	9,602	1,244,085.28	0.19
250	INSUL ET CORP	Insulet 公司	PODD US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	865	1,244,032.83	0.19
251	NVR INC	NVR 公司	NVR US	美国 纽约 证券 交易所	美国	23	1,243,889.44	0.19
252	ROLLINS INC	罗林斯 公司	ROL US	美国 纽约 证券 交易所	美国	3,577	1,243,782.18	0.19
253	SCHWAB (CHARLES) CORP	嘉信理 财公司	SCHW US	美国 纽约 证券 交易所	美国	2,368	1,243,611.78	0.19
254	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	是德科 技公司	KEYS US	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,276	1,243,576.71	0.19
255	AXON ENTERPRISE INC	泰瑟国 际公司	AXON US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	593	1,243,514.85	0.19
256	WRBERKLEY CORP	W.R. 柏 克利公 司	WRB US	美国 纽约 证券 交易所	美国	2,220	1,243,253.16	0.19
257	CINTAS CORP	信达思 公司	CTAS US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	249	1,242,662.63	0.19
258	SYNOPTICS INC	新思科 技公司	SNPS US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	293	1,242,575.97	0.19
259	STERIS PLC	思泰瑞 有限公 司	STE US	美国 纽约 证券 交易所	美国	794	1,242,306.43	0.19
260	MCDONALD'S CORP	麦当劳 公司	MCD US	美国 纽约 证券 交易所	美国	684	1,242,276.50	0.19
261	BOOKING HOLDINGS INC	缤客控 股公司	BKNG	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	44	1,242,244.00	0.19



	NG HOLDINGS INC	股公司	US	克 证 券 交 易 所				
262	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	宣伟公司	SHW US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	584	1,242,080.94	0.19
263	AMERICAN AIRLINES GROUP INC	美国航空集团公司	AAL US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	15,382	1,242,044.88	0.19
264	AVERY DENNISON CORP	艾利丹尼森公司	AVY US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	797	1,241,945.03	0.19
265	CENTROPOINT ENERGY INC	中点能源公司	CNP US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	5,624	1,241,713.20	0.19
266	JOHNSON & JOHNSON	强生公司	JNJ US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,192	1,241,650.48	0.19
267	CONOCOPHILIPS	康菲石油公司	COP US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,522	1,240,678.67	0.19
268	EQUIFAX INC	艾可菲公司	EFX US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	718	1,240,678.10	0.19
269	BOSTON SCIENTIFIC CORP	波士顿科学公司	BSX US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,260	1,240,366.80	0.19
270	COSTAR GROUP INC	科斯塔集团	CSGP US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,347	1,240,110.09	0.19
271	PARKE	帕克汉	PH US	美 国 纽	美国	344	1,240,053.51	0.19

	R HANNI FIN CORP	尼汾公 司		约 证 券 交 易 所				
272	KELLA NOVA	家 乐 氏 公 司	K US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	3,016	1,239,798.65	0.18
273	AMERI CAN INTER NATIO NAL GROUP	美 国 国 际 集 团 公 司	AIG US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	2,343	1,239,666.38	0.18
274	CDW CORP/ DE	CDW 公 司	CDW US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	777	1,239,519.28	0.18
275	MSCI INC	MSCI 明 晟	MSCI US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	361	1,239,434.26	0.18
276	TEXAS INSTR UMENT S INC	德 州 仪 器 公 司	TXN US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	894	1,239,420.51	0.18
277	ABBOT T LABOR ATORI ES	雅 培 制 药 公 司	ABT US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,673	1,238,933.10	0.18
278	ETSY INC	Etsy 公 司	ETSY US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,947	1,238,738.04	0.18
279	APTIV PLC	安 波 福 有 限 公 司	APTIV US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	2,468	1,238,613.32	0.18
280	PAYCO M SOFTW ARE INC	Paycom 软 件 公 司	PAYC US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,215	1,238,592.23	0.18
281	WELLT OWER INC	WELLTO WER 房 地 产 信 托	WELL US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,667	1,238,529.16	0.18
282	SBA COMMU	SBA 通 信 公 司	SBAC US	纳 斯 达 克 证 券	美 国	885	1,238,106.89	0.18

	NICAT IONS CORP			交易所				
283	MARKE TAXES S HOLDI NGS INC	Market Axess 控股公 司	MKTX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	866	1,237,632.82	0.18
284	SEMPR A	桑普拉	SRE US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,283	1,237,533.04	0.18
285	NXP SEMIC ONDU CTORS NV	恩智浦 半导体 公司	NXPI US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	645	1,236,949.14	0.18
286	HORME L FOODS CORP	荷美尔 食品公 司	HRL US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	5,692	1,236,849.58	0.18
287	T-MOB ILE US INC	T-Mobi le 美 国公司	TMUS US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	985	1,236,765.63	0.18
288	PROLO GIS INC	安博	PLD US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,545	1,236,634.85	0.18
289	CAPIT AL ONE FINAN CIAL CORP	第一资 本金融 公司	COF US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,253	1,236,341.94	0.18
290	ENTER GY CORP	安特吉 公司	ETR US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,621	1,236,122.08	0.18
291	ATMOS ENERG Y CORP	ATMOS 能源公 司	ATO US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,485	1,234,541.71	0.18
292	AMERI CAN WATER WORKS CO INC	美国水 业股份 有限公司	AWK US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,341	1,234,387.13	0.18
293	AGILE NT	安捷伦 科技有	A US	美 国 纽 约 证 券	美国	1,336	1,234,259.70	0.18

	TECHNOLOGIES INC	限公司		交易所				
294	KLA CORP	科天半导体公司	KLAC US	纳斯达克证券交易所	美国	210	1,233,984.75	0.18
295	CINCINNATI FINANCIAL CORP	辛辛那提金融公司	CINF US	纳斯达克证券交易所	美国	1,466	1,233,895.67	0.18
296	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	Healthpeak Properties 公司	DOC US	美国纽约证券交易所	美国	8,830	1,233,421.02	0.18
297	TRANE TECHNOLOGIES PLC	特灵科技有限公司	TT US	美国纽约证券交易所	美国	526	1,233,058.84	0.18
298	CME GROUP INC	芝加哥交易所集团	CME US	纳斯达克证券交易所	美国	880	1,232,993.41	0.18
299	FASTENAL CO	快扣	FAST US	纳斯达克证券交易所	美国	2,752	1,232,478.00	0.18
300	AMERICAN ELECTRIC POWER	美国电力公司	AEP US	纳斯达克证券交易所	美国	1,971	1,232,477.01	0.18
301	REGENCY CENTERS CORP	Regency Centers 公司	REG US	纳斯达克证券交易所	美国	2,780	1,232,337.75	0.18
302	SIMON PROPERTY GROUP INC	西蒙地产集团	SPG US	美国纽约证券交易所	美国	1,139	1,232,225.15	0.18
303	FISERV INC	费哲金融服务公司	FI US	美国纽约证券交易所	美国	1,160	1,232,126.80	0.18
304	INGER	英格索	IR US	美国纽	美国	1,903	1,231,999.37	0.18

	SOLL-RAND INC	兰公司		约 证 券 交 易 所				
305	FIRST ENERGY CORP	第一能源公司	FE US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	4,516	1,231,705.74	0.18
306	SNAP-ON INC	实耐宝公司	SNA US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	661	1,231,359.88	0.18
307	ADOBE INC	奥多比公司	ADBE US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	311	1,231,318.19	0.18
308	APPLIED MATERIALS INC	应用材料	AMAT US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	732	1,231,116.79	0.18
309	KRAFT HEINZ CO/TH E	卡夫亨氏公司	KHC US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	5,358	1,230,333.41	0.18
310	FIFTH THIRD BANCO RP	五三银行	FITB US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	4,730	1,230,069.29	0.18
311	SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	希捷科技有限公司	STX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,670	1,229,094.34	0.18
312	MERCK & CO. INC.	默克集团	MRK US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,393	1,229,040.89	0.18
313	SKYWORLD SOLUTIONS INC	思佳讯解决方案公司	SWKS US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,618	1,228,991.29	0.18
314	CROWDSTRIKE HOLDINGS INC -	CrowdStrike 控股公司	CRWD US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	450	1,228,913.32	0.18

	A							
315	MONDE LEZ INTER NATIO NAL INC-A	亿滋国际有限公司	MDLZ US	纳斯达克 证券 交易所	美国	2,634	1,228,439.10	0.18
316	PARAM OUNT GLOBA L-CLA SS B	派拉蒙 全球	PARA US	纳斯达克 证券 交易所	美国	16,588	1,228,299.13	0.18
317	GENER AL DYNAM ICS CORP	通用动力公司	GD US	美国纽约 证券 交易所	美国	594	1,228,255.23	0.18
318	AON PLC-C LASS A	怡安保险集团	AON US	美国纽约 证券 交易所	美国	587	1,228,171.85	0.18
319	WW GRAIN GER INC	固安捷 公司	GWW US	美国纽约 证券 交易所	美国	191	1,228,146.05	0.18
320	IQVIA HOLDI NGS INC	艾昆纬 控股公 司	IQV US	美国纽约 证券 交易所	美国	815	1,228,115.83	0.18
321	GENER AL MOTOR S CO	通用汽车公司	GM US	美国纽约 证券 交易所	美国	3,709	1,228,091.17	0.18
322	SMITH (A.O. ) CORP	A.O. 史 密斯	AOS US	美国纽约 证券 交易所	美国	2,107	1,228,022.19	0.18
323	XCEL ENERG Y INC	埃克西 尔能源 公司	XEL US	纳斯达克 证券 交易所	美国	3,226	1,227,952.34	0.18
324	WALT DISNE Y CO/TH E	华特迪 斯尼公 司	DIS US	美国纽约 证券 交易所	美国	1,735	1,227,720.65	0.18
325	BROWN &	布朗保 险经纪	BRO US	美国纽约 证券	美国	1,926	1,227,261.04	0.18

	BROWN INC	公司		交易所				
326	QUEST DIAGN OSTIC S INC	奎斯特 诊疗公 司	DGX US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,258	1,227,199.61	0.18
327	HOME DEPOT INC	家得宝 公司	HD US	美国纽 约证券 交易所	美国	500	1,226,664.82	0.18
328	MASTE RCARD INC - A	万事达 卡公司	MA US	美国纽 约证券 交易所	美国	390	1,226,183.04	0.18
329	FORTI NET INC	飞塔公 司	FTNT US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,854	1,225,885.00	0.18
330	EMERS ON ELECT RIC CO	艾默生 电气集 团	EMR US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,561	1,225,522.82	0.18
331	KROGE R CO	克罗格 公司	KR US	美国纽 约证券 交易所	美国	3,444	1,225,516.83	0.18
332	PHILI P MORRI S INTER NATIO NAL	菲利普 莫里斯 国际公 司	PM US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,697	1,225,503.22	0.18
333	AUTOZ ONE INC	汽车地 带	AZO US	美国纽 约证券 交易所	美国	58	1,225,223.78	0.18
334	APPLE INC	苹果公 司	AAPL US	纳斯达 克证券 交易所	美国	816	1,224,854.04	0.18
335	ECOLA B INC	艺康化 工公司	ECL US	美国纽 约证券 交易所	美国	722	1,224,640.80	0.18
336	BAXTE R INTER NATIO NAL INC	百特国 际有限 公司	BAX US	美国纽 约证券 交易所	美国	5,136	1,224,378.54	0.18

337	KIMBERLY-CORP	金佰利公司	KMB US	美国纽约证券交易所	美国	1,243	1,224,260.23	0.18
338	KIMCO REALTY CORP	金克地产公司	KIM US	美国纽约证券交易所	美国	8,827	1,224,194.81	0.18
339	NRG ENERGY INC	NRG 能源公司	NRG US	美国纽约证券交易所	美国	2,206	1,224,093.18	0.18
340	REALTY INCOME CORP	Realty Income 公司	O US	美国纽约证券交易所	美国	3,251	1,223,798.56	0.18
341	MCKESSON CORP	麦克森公司	MCK US	美国纽约证券交易所	美国	294	1,223,726.86	0.18
342	COSTCO WHOLESALE CORP	好市多公司	COST US	纳斯达克证券交易所	美国	202	1,223,657.16	0.18
343	ANSYS INC	安西斯公司	ANSS US	纳斯达克证券交易所	美国	534	1,223,536.15	0.18
344	BROWN-BROWN CORP-CLASS B	百富门公司	BF/B US	美国纽约证券交易所	美国	3,974	1,223,223.00	0.18
345	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	埃培智集团	IPG US	美国纽约证券交易所	美国	5,897	1,222,557.85	0.18
346	PROCTER & GAMBLE CO/TH E	宝洁公司	PG US	美国纽约证券交易所	美国	1,040	1,222,365.93	0.18
347	PPG INDUSTRIES	PPG 工业公司	PPG US	美国纽约证券交易所	美国	1,362	1,221,976.66	0.18



	TRIES INC			交易所				
348	META PLATF ORMS INC-C LASS A	Meta 平台公 司	META US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	340	1,221,781.53	0.18
349	PACKA GING CORP OF AMERI CA	美国包 装公司	PKG US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	939	1,221,703.42	0.18
350	DOMIN O'S PIZZA INC	达美乐 比萨公 司	DPZ US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	332	1,221,687.17	0.18
351	CADEN CE DESIG N SYS INC	铿腾电 子公司	CDNS US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	557	1,221,652.89	0.18
352	WEST PHARM ACEUT ICAL SERVI CES	West Pharma ceutic al Servic es 公 司	WST US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	520	1,220,698.26	0.18
353	TRAVE LERS COS INC/T HE	旅行者 集团	TRV US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	842	1,220,195.68	0.18
354	TRANS DIGM GROUP INC	TransD igm 集 团公司	TDG US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	134	1,220,106.31	0.18
355	ANALO G DEVIC ES INC	亚德诺 公司	ADI US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	750	1,220,072.53	0.18
356	AMPHE NOL CORP-	安费诺 公司	APH US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,541	1,220,016.72	0.18

	CL A							
357	CATAL ENT INC	康泰伦 特公司	CTLT US	美国纽 约证券 交易所	美国	3,044	1,219,852.45	0.18
358	SOUTH ERN CO/TH E	南方电 力公司	SO US	美国纽 约证券 交易所	美国	2,206	1,219,533.88	0.18
359	HP INC	惠普公 司	HPQ US	美国纽 约证券 交易所	美国	4,886	1,219,450.50	0.18
360	LOWE' S COS INC	劳氏公 司	LOW US	美国纽 约证券 交易所	美国	776	1,219,231.28	0.18
361	CHARL ES RIVER LABOR ATORI ES	查尔斯 河实验 室国际 公司	CRL US	美国纽 约证券 交易所	美国	828	1,219,026.60	0.18
362	VERIS IGN INC	威瑞信 公司	VRSN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	962	1,218,993.53	0.18
363	RALPH LAURE N CORP	拉夫劳 伦	RL US	美国纽 约证券 交易所	美国	977	1,218,922.40	0.18
364	WABTE C CORP	美国西 屋制动 公司	WAB US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,082	1,218,754.78	0.18
365	EQUIN IX INC	易昆尼 克斯公 司	EQIX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	226	1,218,622.93	0.18
366	CROWN CASTL E INC	冠城国 际公司	CCI US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,750	1,218,504.63	0.18
367	ULTA BEAUT Y INC	ULTA 美妆公 司	ULTA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	443	1,218,258.11	0.18
368	PPL CORP	PPL 公 司	PPL US	美国纽 约证券 交易所	美国	6,179	1,217,609.15	0.18
369	FIDEL ITY NATIO	富达国 民信息 服务公 司	FIS US	美国纽 约证券 交易所	美国	2,266	1,217,013.42	0.18

	NAL INFO SERV	司						
370	EASTM AN CHEMI CAL CO	伊士曼 化工公 司	EMN US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,743	1,216,984.55	0.18
371	CONSO LIDAT ED EDISO N INC	爱迪生 联合电 气公司	ED US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,909	1,216,564.57	0.18
372	HOWME T AEROS PACE INC	Howmet 航天公 司	HWM US	美国纽 约证券 交易所	美国	2,198	1,216,051.16	0.18
373	WATER S CORP	沃特世 公司	WAT US	美国纽 约证券 交易所	美国	588	1,215,764.80	0.18
374	XYLEM INC	赛莱默 公司	XYL US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,257	1,215,026.11	0.18
375	DAYFO RCE INC	Dayfor ce 公 司	DAY US	美国纽 约证券 交易所	美国	3,436	1,214,589.17	0.18
376	INVES CO LTD	景顺集 团	IVZ US	美国纽 约证券 交易所	美国	11,390	1,214,366.81	0.18
377	AMCOR PLC	安姆科 公开有 限公司	AMCR US	美国纽 约证券 交易所	美国	17,421	1,214,245.51	0.18
378	EATON CORP PLC	伊顿公 司	ETN US	美国纽 约证券 交易所	美国	543	1,213,392.22	0.18
379	VISTR A CORP	维斯达 能源公 司	VST US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,980	1,213,269.28	0.18
380	KEURI G DR PEPPE R INC	克里格 胡椒博 士公司	KDP US	纳斯达 克证券 交易所	美国	5,097	1,213,265.01	0.18
381	CARDI NAL	卡地纳 健康公 司	CAH US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,731	1,212,923.78	0.18

	HEALTH INC	司		交易所				
382	EDISON INTERNATIONAL	爱迪生国际公司	EIX US	美国纽约证券交易所	美国	2,370	1,212,907.95	0.18
383	CVS HEALTH CORP	西维斯健康公司	CVS US	美国纽约证券交易所	美国	2,881	1,212,638.28	0.18
384	CARRIER GLOBAL CORP	开利全球	CARR US	美国纽约证券交易所	美国	2,696	1,212,009.83	0.18
385	BLACK ROCK INC	贝莱德集团	BLK US	美国纽约证券交易所	美国	216	1,211,991.59	0.18
386	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	慧与	HPE US	美国纽约证券交易所	美国	8,033	1,211,973.70	0.18
387	CMS ENERGY CORP	CMS 能源公司	CMS US	美国纽约证券交易所	美国	2,855	1,211,257.74	0.18
388	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	FRT 信托	FRT US	美国纽约证券交易所	美国	1,683	1,211,075.01	0.18
389	GENERAL HOLDINGS INC	Generac 控股公司	GNRC US	美国纽约证券交易所	美国	1,285	1,210,862.56	0.18
390	UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	美国联合航空控股公司	UAL US	纳斯达克证券交易所	美国	3,491	1,210,644.20	0.18
391	WEYERHAEUSER	惠好公司	WY US	美国纽约证券交易所	美国	5,983	1,210,539.50	0.18

	ER CO			交易所				
392	INTER CONTI NENTA L EXCHA NGE IN	洲际交 易所集 团公司	ICE US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,240	1,209,728.69	0.18
393	TAKE- TWO INTER ACTIV E SOFTW RE	TAKE-T WO 互 动软件 公司	TTWO US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,091	1,208,987.43	0.18
394	HCA HEALT HCARE INC	HCA 医 疗保健 公司	HCA US	美国纽 约证券 交易所	美国	528	1,208,960.70	0.18
395	DEXCO M INC	德康医 疗公司	DXCM US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,496	1,208,822.73	0.18
396	ESSEX PROPE RTY TRUST INC	埃塞克 斯信托 公司	ESS US	美国纽 约证券 交易所	美国	623	1,208,567.02	0.18
397	STARB UCKS CORP	星巴克	SBUX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,178	1,208,400.97	0.18
398	JM SMUCK ER CO/TH E	斯马克 公司	SJM US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,555	1,208,400.25	0.18
399	NORFO LK SOUTH ERN CORP	诺福克 南方公 司	NSC US	美国纽 约证券 交易所	美国	789	1,207,211.57	0.18
400	LULUL EMON ATHLE TICA INC	露露乐 蒙公司	LULU US	纳斯达 克证券 交易所	美国	567	1,207,015.52	0.18
401	AUTOM	自动数	ADP US	纳斯达	美国	709	1,206,076.99	0.18

	ATIC DATA PROCE SSING	据处理 公司		克 证 券 交 易 所				
402	VICI PROPE RTIES INC	VICI 房地 产公 司	VICI US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	5,908	1,205,891.05	0.18
403	DTE ENERG Y COMPA NY	DTE 能 源公 司	DTE US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,524	1,205,706.61	0.18
404	HENRY SCHEI N INC	亨利香 恩公 司	HSIC US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,636	1,204,198.29	0.18
405	DELTA AIR LINES INC	达美航 空有 限公 司	DAL US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	3,561	1,203,957.69	0.18
406	CATER PILLA R INC	卡特彼 勒公 司	CAT US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	507	1,203,586.10	0.18
407	PRINC IPAL FINAN CIAL GROUP	信安金 融集 团公 司	PFG US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,151	1,202,618.64	0.18
408	VERTE X PHARM ACEUT ICALS INC	福泰制 药公 司	VRTX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	360	1,202,570.53	0.18
409	PAYCH EX INC	沛齐公 司	PAYX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,423	1,202,368.70	0.18
410	DOMIN ION ENERG Y INC	道明尼 资源公 司	D US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	3,440	1,201,293.41	0.18
411	JACOB S SOLUT IONS	雅各布 布解 决方 案公 司	J US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,206	1,200,796.38	0.18

	INC							
412	ASSURANT INC	美国艾斯兰公司	AIZ US	美国纽约证券交易所	美国	1,013	1,200,233.30	0.18
413	WESTERN DIGITAL CORP	西部数据公司	WDC US	纳斯达克证券交易所	美国	2,221	1,199,334.75	0.18
414	SOLVENTUM CORP	Solventum 公司	SOLV US	美国纽约证券交易所	美国	3,180	1,198,431.29	0.18
415	T ROWE PRICE GROUP INC	普信集团有限公司	TROW US	纳斯达克证券交易所	美国	1,458	1,198,171.73	0.18
416	HUBBELL INC	哈贝尔公司	HUBB US	美国纽约证券交易所	美国	460	1,198,163.32	0.18
417	NEXTERA ENERGY INC	新纪元能源公司	NEE US	美国纽约证券交易所	美国	2,374	1,198,036.03	0.18
418	LAMB WESTON HOLDINGS INC	蓝威斯顿控股公司	LW US	美国纽约证券交易所	美国	1,999	1,197,843.47	0.18
419	PULTE GROUP INC	普尔特房屋有限公司	PHM US	美国纽约证券交易所	美国	1,526	1,197,392.20	0.18
420	MOLINA HEALTHCARE INC	莫利纳医疗保健公司	MOH US	美国纽约证券交易所	美国	565	1,197,120.67	0.18
421	SUPERMICRO COMPUTER INC	超威电脑公司	SMCI US	纳斯达克证券交易所	美国	205	1,197,065.43	0.18
422	JUNIPER NETWORK	瞻博网络公司	JNPR US	美国纽约证券交易所	美国	4,605	1,196,577.60	0.18

	RKS INC							
423	CELAN ESE CORP	塞拉尼 斯公司	CE US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,244	1,195,899.56	0.18
424	BIO-R AD LABOR ATORI ES-A	BIO RAD 实 验室	BIO US	美国纽 约证券 交易所	美国	614	1,195,089.81	0.18
425	BEST BUY CO INC	百思买 集团	BBY US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,989	1,194,828.05	0.18
426	LINDE PLC	林德公 开有限 公司	LIN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	382	1,194,632.84	0.18
427	IDEXX LABOR ATORI ES INC	IDEXX 实验室 公司	IDXX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	344	1,194,428.87	0.18
428	BECTO N DICKI NSON AND CO	碧迪公 司	BDX US	美国纽 约证券 交易所	美国	717	1,194,238.37	0.18
429	LENN A CORP- A	莱纳房 产公司	LEN US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,118	1,194,128.55	0.18
430	AMERE N CORPO RATIO N	阿曼瑞 恩公司	AEE US	美国纽 约证券 交易所	美国	2,356	1,193,989.58	0.18
431	PACCA R INC	帕卡公 司	PCAR US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,625	1,192,153.29	0.18
432	MASCO CORP	马斯可 木业公 司	MAS US	美国纽 约证券 交易所	美国	2,509	1,192,135.68	0.18
433	KKR & CO INC	科尔伯 格-克 拉维斯 -罗伯 茨公司	KKR US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,589	1,191,788.82	0.18



434	MEDTRONIC PLC	美敦力公司	MDT US	美国纽约证券交易所	美国	2,124	1,191,458.71	0.18
435	TRACTOR SUPPLY COMPANY	拖拉机供应公司	TSCO US	纳斯达克证券交易所	美国	619	1,191,102.08	0.18
436	RTX CORP	雷神技术公司	RTX US	美国纽约证券交易所	美国	1,664	1,190,524.53	0.18
437	CENTENE CORP	圣丁公司	CNC US	美国纽约证券交易所	美国	2,517	1,189,299.72	0.18
438	INTERNATIONAL PAPER CO	国际纸业公司	IP US	美国纽约证券交易所	美国	3,865	1,188,570.29	0.18
439	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION	布罗德里奇金融解决方案公司	BR US	美国纽约证券交易所	美国	845	1,186,362.76	0.18
440	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	亚历山大房地产公司	ARE US	美国纽约证券交易所	美国	1,422	1,185,410.19	0.18
441	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	梅特勒-托利多国际公司	MTD US	美国纽约证券交易所	美国	119	1,185,280.99	0.18
442	THE CIGNA GROUP	信诺保险集团	CI US	美国纽约证券交易所	美国	503	1,185,020.86	0.18
443	JOHNSON CONTROLS	江森自控国际有限公司	JCI US	美国纽约证券交易所	美国	2,499	1,183,822.27	0.18

	INTERNATIONAL							
444	MARRIOTT INTERNATIONAL-CLASS A	万豪国际	MAR US	纳斯达克证券交易所	美国	687	1,183,732.90	0.18
445	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	墨式烧烤公司	CMG US	美国纽约证券交易所	美国	2,650	1,183,209.15	0.18
446	PG&E CORP	太平洋煤气与电力公司	PCG US	美国纽约证券交易所	美国	9,507	1,182,993.35	0.18
447	STANLEY BLACK & DECKER INC	史丹利百得公司	SWK US	美国纽约证券交易所	美国	2,076	1,181,991.47	0.18
448	BXP INC	波士顿地产公司	BXP US	美国纽约证券交易所	美国	2,690	1,180,172.42	0.18
449	WEC ENERGY GROUP INC	WEC 能源集团	WEC US	美国纽约证券交易所	美国	2,106	1,177,609.34	0.18
450	ON SEMICONDUCTOR	安森美半导体	ON US	纳斯达克证券交易所	美国	2,410	1,177,386.56	0.18
451	VISA INC-C CLASS A SHARES	VISA 公司	V US	美国纽约证券交易所	美国	629	1,176,589.28	0.18
452	HASBRO INC	孩之宝公司	HAS US	纳斯达克证券交易所	美国	2,821	1,176,125.11	0.18

453	REVVI TY INC	Revvit y 公司	RVTY US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,573	1,175,528.46	0.18
454	TELED YNE TECHN OLOGI ES INC	得立达 科技公 司	TDY US	美国纽 约证券 交易所	美国	424	1,172,383.69	0.17
455	VERAL TO CORP	Veralt o 公司	VLTO US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,722	1,171,641.22	0.17
456	DR HORTO N INC	霍顿房 屋公司	DHI US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,162	1,167,089.47	0.17
457	DECKE RS OUTDO OR CORP	德克斯 户外用 品公司	DECK US	美国纽 约证券 交易所	美国	169	1,165,827.24	0.17
458	ALIGN TECHN OLOGY INC	阿莱技 术公司	ALGN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	677	1,164,861.99	0.17
459	STRYK ER CORP	史赛克 公司	SYK US	美国纽 约证券 交易所	美国	480	1,163,948.98	0.17
460	AMETE K INC	阿美特 克股份 有限公司	AME US	美国纽 约证券 交易所	美国	979	1,163,158.54	0.17
461	YUM! BRAND S INC	百胜餐 饮集团	YUM US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,232	1,163,027.62	0.17
462	CENCO RA INC	森科拉 公司	COR US	美国纽 约证券 交易所	美国	724	1,162,503.66	0.17
463	EQT CORP	EQT 能 源公司	EQT US	美国纽 约证券 交易所	美国	4,410	1,162,251.37	0.17
464	AIR PRODU CTS & CHEMI CALS INC	空气化 工产品 有限公司	APD US	美国纽 约证券 交易所	美国	630	1,158,614.57	0.17

465	HERSHEY CO/TH E	好时公司	HSY US	美国纽约证券交易所	美国	884	1,158,145.77	0.17
466	NVIDIA CORP	英伟达公司	NVDA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,315	1,157,785.01	0.17
467	PENTAIR PLC	滨特尔集团	PNR US	美国纽约证券交易所	美国	2,118	1,157,300.10	0.17
468	EVERSOURCE ENERGY	能源方案公司	ES US	美国纽约证券交易所	美国	2,863	1,157,112.45	0.17
469	MATCH GROUP INC	Match Group 公司	MTCH US	纳斯达克证券交易所	美国	5,335	1,155,092.50	0.17
470	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	雅诗兰黛公司	EL US	美国纽约证券交易所	美国	1,523	1,154,877.98	0.17
471	COOPER COS INC/THE	库珀医疗公司	COO US	美国纽约证券交易所	美国	1,856	1,154,746.85	0.17
472	CONSTELLATION ENERGY	星座能源公司	CEG US	纳斯达克证券交易所	美国	807	1,151,818.38	0.17
473	MICRON TECHNOLOGY INC	美光科技公司	MU US	纳斯达克证券交易所	美国	1,227	1,150,175.08	0.17
474	DOW INC	陶氏公司	DOW US	美国纽约证券交易所	美国	3,039	1,148,975.21	0.17
475	AMERICAN TOWER CORP	美国电塔公司	AMT US	美国纽约证券交易所	美国	829	1,148,419.82	0.17
476	QUANT	广达服	PWR US	美国纽	美国	634	1,148,078.02	0.17

	A SERVI CES INC	务公司		约 证 券 交 易 所				
477	EXELO N CORP	爱克斯 龙电力 公司	EXC US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	4,654	1,147,948.88	0.17
478	BIO-T ECHNE CORP	Bio-Te chne 公司	TECH US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,248	1,147,907.97	0.17
479	LABCO RP HOLDI NGS INC	美国控 股实验 室公司	LH US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	791	1,147,246.68	0.17
480	BUILD ERS FIRST SOURC E INC	Builde rs FirstS ource 公司	BLDR US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,160	1,144,247.65	0.17
481	BROAD COM INC	博通公 司	AVGO US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	100	1,144,229.12	0.17
482	VULCA N MATER IALS CO	火神材 料公司	VMC US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	645	1,143,128.74	0.17
483	QUALC OMM INC	高通公 司	QCOM US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	805	1,142,710.40	0.17
484	BALL CORP	波尔公 司	BALL US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,670	1,142,093.93	0.17
485	ALBEM ARLE CORP	雅保公 司	ALB US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,676	1,140,940.24	0.17
486	THERM O FISHE R SCIEN TIFIC INC	赛默飞 世尔科 技公司	TMO US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	287	1,131,101.55	0.17
487	BATH &	Bath &	BBWI	美 国 纽	美国	4,050	1,127,121.24	0.17

	BODY WORKS INC	Body Works 公司	US	约 证 券 交 易 所				
488	JABIL INC	捷普公司	JBL US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,452	1,125,771.28	0.17
489	AES CORP	爱依斯电力公司	AES US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	8,971	1,123,329.57	0.17
490	RESMED INC	瑞思迈公司	RMD US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	819	1,117,289.67	0.17
491	POOL CORP	普尔公司	POOL US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	508	1,112,661.96	0.17
492	MARTIN MARIE TTA MATERIALS	马丁-玛丽埃塔材料公司	MLM US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	288	1,112,054.47	0.17
493	MODERNA INC	莫德纳公司	MRNA US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,239	1,048,574.99	0.16
494	FIRST SOLAR INC	第一太阳能公司	FSLR US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	634	1,018,716.48	0.15
495	NIKE INC -CL B	耐克公司	NKE US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,857	997,481.82	0.15
496	NEWS CORP - CLASS A	新闻集团公司	NWSA US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	4,973	977,124.26	0.15
497	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	沃尔格林联合博姿集团	WBA US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	11,158	961,804.49	0.14
498	ENPHASE ENERGY INC	Enphase 能源公司	ENPH US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,320	938,009.46	0.14

499	FOX CORP - CLASS A	福斯公 司	FOXA US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	3,413	836,007.92	0.12
500	ALPHA BET INC-C L A	谷歌 (Alpha bet)	GOOGL US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	533	691,912.15	0.10
501	ALPHA BET INC-C L C	谷歌 (Alpha bet)	GOOG US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	443	579,088.56	0.09
502	FOX CORP - CLASS B	福斯公 司	FOX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,186	498,845.50	0.07
503	NEWS CORP - CLASS B	新闻集 团公司	NWS US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,500	303,494.78	0.05

7.4.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细无。

## 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	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	DOC US	1,624,320.51	0.36
2	VISTRA CORP	VST US	1,571,164.09	0.34
3	COOPER COS INC/THE	COO US	1,460,997.00	0.32
4	EXXON MOBIL CORP	XOM US	1,431,061.46	0.31
5	SUPER MICRO COMPUTER INC	SMCI US	1,357,364.45	0.30
6	DECKERS OUTDOOR CORP	DECK US	1,316,103.04	0.29
7	GODADDY INC - CLASS A	GDDY US	1,244,039.11	0.27
8	KKR & CO INC	KKR US	1,232,871.30	0.27
9	CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	CRWD US	1,217,055.57	0.27
10	SOLVENTUM CORP	SOLV US	1,175,089.82	0.26

11	EPAM SYSTEMS INC	EPAM US	1,032,061.47	0.23
12	LULULEMON ATHLETICA INC	LULU US	971,851.34	0.21
13	GLOBE LIFE INC	GL US	948,572.63	0.21
14	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	WBA US	935,206.80	0.21
15	WARNER BROS DISCOVERY INC	WBD US	931,194.02	0.20
16	GE VERNOVA INC	GEV US	920,915.84	0.20
17	3M CO	MMM US	910,993.58	0.20
18	PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	PARA US	883,632.24	0.19
19	HUMANA INC	HUM US	825,462.86	0.18
20	ARCHER-DANIELS-MID LAND CO	ADM US	816,322.20	0.18

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

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	NVIDIA CORP	NVDA US	1,644,117.89	0.36
2	EXXON MOBIL CORP	XOM US	1,455,220.14	0.32
3	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	PEAK US	1,365,555.60	0.30
4	ZIONS BANCORP NA	ZION US	1,227,950.31	0.27
5	COOPER COS INC/THE	COO US	1,204,165.08	0.26
6	COMERICA INC	CMA US	1,131,777.06	0.25
7	WHIRLPOOL CORP	WHR US	1,093,398.68	0.24
8	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	PXD US	1,084,501.24	0.24
9	ILLUMINA INC	ILMN US	1,078,977.00	0.24
10	ROBERT HALF INC	RHI US	1,038,826.72	0.23
11	DENTSPLY SIRONA INC	XRAY US	1,027,132.09	0.23
12	VF CORP	VFC US	971,981.08	0.21
13	FIRST SOLAR INC	FSLR US	902,568.23	0.20
14	BROADCOM INC	AVGO US	885,328.13	0.19
15	MICRON TECHNOLOGY INC	MU US	854,766.31	0.19
16	CONSTELLATION ENERGY	CEG US	827,218.27	0.18
17	NRG ENERGY INC	NRG US	760,172.62	0.17



18	GENERAL ELECTRIC CO	GE US	721,266.44	0.16
19	WESTERN DIGITAL CORP	WDC US	701,602.24	0.15
20	TERADYNE INC	TER US	695,134.98	0.15

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

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	261,066,072.86
卖出收入（成交）总额	86,174,636.25

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

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

### 7.11 投资组合报告附注

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

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

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

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

#### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-

3	应收股利	626,188.20
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,385,646.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	171,858.62
8	其他	-
9	合计	3,183,693.42

#### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

无。

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

无。

#### 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
大成标普 500 等权 重指 数 (QDII)A	54,977	4,734.31	89,297,682.05	34.31	170,980,704.43	65.69
大成标普 500 等权 重指 数 (QDII)C	3,231	5,316.66	11,362,437.83	66.14	5,815,679.07	33.86
合计	58,208	4,766.64	100,660,119.88	36.28	176,796,383.50	63.72

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

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	大成标普 500 等权重指数 (QDII)A	18,702.93	0.0072
	大成标普 500 等权重指数 (QDII)C	-	-
	合计	18,702.93	0.0067

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

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成标普 500 等权重指数(QDII)A	大成标普 500 等权重指数(QDII)C
基金合同生效日 (2011年3月23日) 基金份额总额	822,754,222.26	-
本报告期期初基金份额总额	182,508,938.23	8,360,879.29
本报告期基金总申购份额	119,066,880.46	23,642,535.07
减：本报告期基金总赎回份额	41,297,432.21	14,825,297.46
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份	260,278,386.48	17,178,116.90

额总额		
-----	--	--

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

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

无。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

无。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金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）。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。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	

Morgan Stanley	1	342,551,754.75	100.00	102,766.55	100.00	-
Daiwa Capital Markets Hong Kong Limited	1	-	-	-	-	-

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

- (一) 财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- (二) 经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- (三) 研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；
- (四) 具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；
- (五) 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。

租用交易单元的使用流程为：首先根据证券经纪商选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行本基金交易单元选择。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	大成标普 500 等权重指数证券投资基金(人民币 A 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 6 月 28 日
2	大成标普 500 等权重指数证券投资基金(美元 A 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 6 月 28 日
3	大成标普 500 等权重指数证券投资基金(人民币 C 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 6 月 28 日
4	大成标普 500 等权重指数证券投资基金(美元 C 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 6 月 28 日
5	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东兴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	2024 年 6 月 28 日
6	大成基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件及其他身	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本	2024 年 6 月 28 日

	份基本信息的公告	公司网站	
7	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加部分代销机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 6 月 13 日
8	大成基金管理有限公司关于暂停海银基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 6 月 12 日
9	大成标普 500 等权重指数证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 4 月 23 日
10	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2024 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	2024 年 4 月 19 日
11	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国信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	2024 年 4 月 15 日
12	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	2024 年 4 月 2 日
13	大成标普 500 等权重指数证券投资基金（人民币）C 类份额增加财信证券股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 4 月 1 日
14	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加山西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	2024 年 4 月 1 日
15	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2023 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	2024 年 3 月 29 日
16	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	2024 年 3 月 21 日
17	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	2024 年 3 月 19 日
18	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	2024 年 3 月 19 日
19	大成基金管理有限公司关于调整旗下部分基金基金份额净值的小数点保留位数并相应修订基金合同和托管协议的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 3 月 19 日
20	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海万得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	2024 年 3 月 4 日

21	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华西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	2024 年 2 月 28 日
22	大成标普 500 等权重指数(QDII)C 人民币类份额增加兴业证券股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 2 月 22 日
23	关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金暂停大额申购（含定期定额申购）业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 2 月 7 日
24	关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金暂停大额申购（含定期定额申购）业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 2 月 1 日
25	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	2024 年 1 月 23 日
26	大成标普 500 等权重指数证券投资基金(人民币)C 类份额增加上海华夏财富投资管理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	2024 年 1 月 22 日
27	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 1 月 19 日
28	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 2023 年度第 1 次分红的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 1 月 16 日
29	关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金暂停大额申购（含定期定额申购）业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 1 月 10 日
30	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金 2024 年境外（地区）主要市场节假日暂停申购赎回安排的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2024 年 1 月 5 日
31	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	2024 年 1 月 4 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20240110-202	-	63,391,5	-	63,391,512.89	22.85

		40630		12.89		
产品特有风险						
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险，甚至有可能引起基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。						

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

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

大成基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日