

# 大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2025 年中期报告

2025 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：2025 年 8 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 2025 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2025 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>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	41
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	41
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	42

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	95
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	97
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.....	97
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.....	97
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.....	97
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.....	97
7.11 投资组合报告附注.....	97
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>98</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	98
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	98
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.....	99
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>99</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>100</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	100
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.....	100
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	100
10.4 基金投资策略的改变.....	100
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	100
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.....	100
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	100
10.8 其他重大事件.....	101
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>104</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.....	104
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	104
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>104</b>
12.1 备查文件目录.....	104
12.2 存放地点.....	104
12.3 查阅方式.....	104

## § 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	387,715,650.53 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	319,716,646.34 份	67,999,004.19 份

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

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	段皓静	许俊
	联系电话	0755-83183388	010-66596688
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		4008885558	95566

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

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

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

## 2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金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(2025 年 1 月 1 日 - 2025 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	8,617,781.54	1,991,891.36
本期利润	18,292,069.20	2,125,100.40
加权平均基金份 额本期利润	0.0555	0.0278

本期加权平均净值利润率	2.21%	1.12%
本期基金份额净值增长率	3.24%	3.12%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025年6月30日)	
期末可供分配利润	222,499,483.71	46,516,769.98
期末可供分配基金份额利润	0.6959	0.6841
期末基金资产净值	830,119,234.15	176,100,760.53
期末基金份额净值	2.5964	2.5898
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	256.80%	19.14%

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	2.80%	0.62%	3.43%	0.65%	-0.63%	-0.03%
过去三个月	5.01%	1.66%	5.46%	1.80%	-0.45%	-0.14%
过去六个月	3.24%	1.30%	4.82%	1.41%	-1.58%	-0.11%
过去一年	10.61%	1.05%	12.73%	1.13%	-2.12%	-0.08%

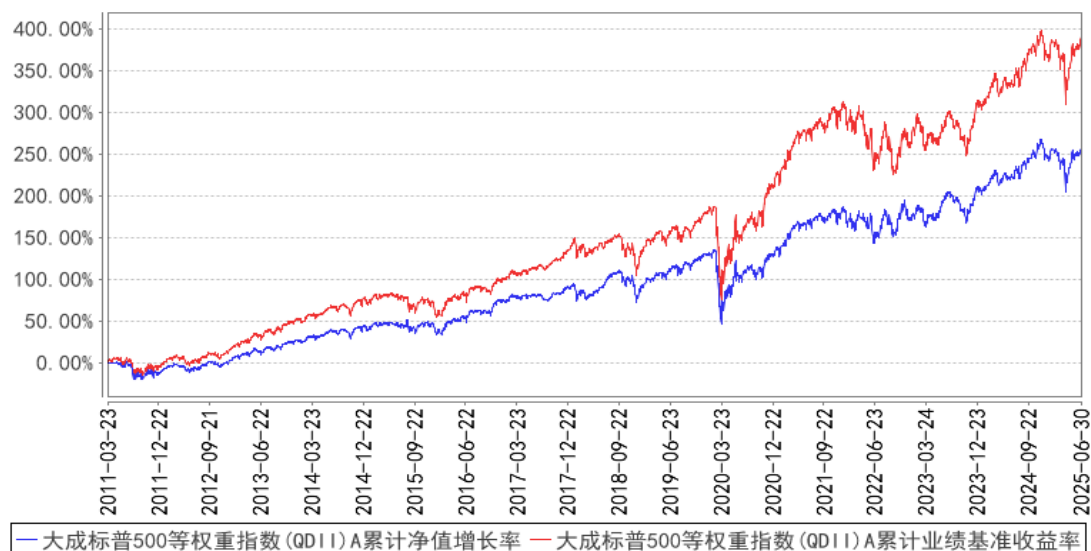
过去三年	42.47%	0.98%	43.37%	1.04%	-0.90%	-0.06%
自基金合同生效起 至今	256.80%	1.10%	389.45%	1.16%	-132.65%	-0.06%

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	2.78%	0.62%	3.43%	0.65%	-0.65%	-0.03%
过去三个月	4.92%	1.67%	5.46%	1.80%	-0.54%	-0.13%
过去六个月	3.12%	1.30%	4.82%	1.41%	-1.70%	-0.11%
过去一年	10.30%	1.05%	12.73%	1.13%	-2.43%	-0.08%
自基金合同生效起 至今	19.14%	0.91%	25.31%	0.98%	-6.17%	-0.07%

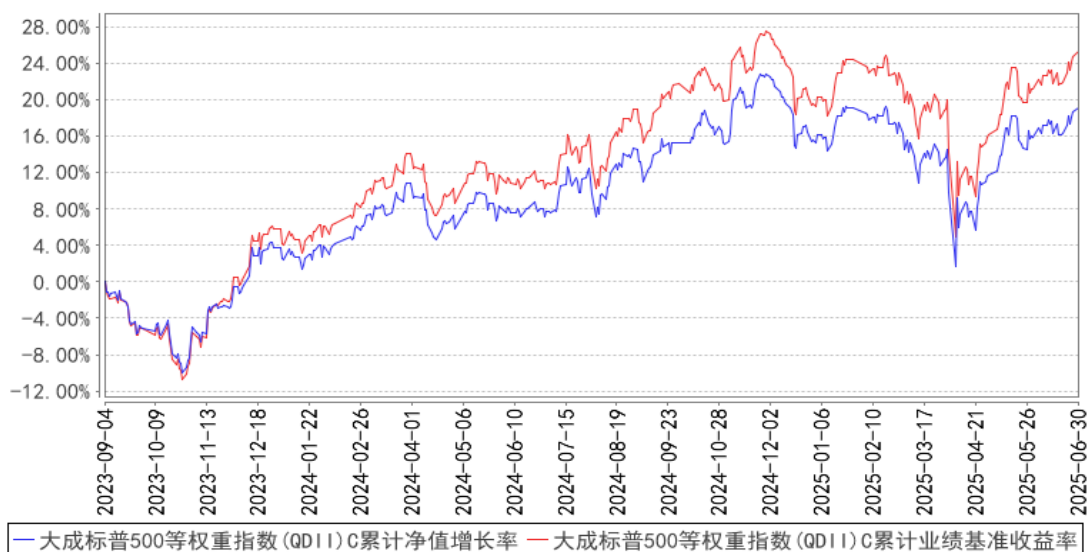
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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；2013 年，设立大成创新资本管理有限公司。

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

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

合实力不断提升，各项业务迅猛发展，管理资产种类位居同业前列。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
冉凌浩	本基金基金经理	2011年8月26日	-	22年	英国曼彻斯特大学商学院金融学硕士。2003年4月至2004年6月就职于国信证券研究部，任研究员。2004年6月至2005年9月就职于华西证券研究部，任高级研究员。2005年9月加入大成基金管理有限公司，曾担任金融工程师、境外市场研究员及基金经理助理，现任国际业务部基金经理。2011年8月26日起任大成标普500等权重指数型证券投资基金基金经理。2014年11月13日起任大成纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）（转型前为大成纳斯达克100指数证券投资基金）基金经理。2016年12月2日至2023年3月14日任大成恒生综合中小型股指数基金（QDII-LOF）基金经理。2016年12月29日至2020年7月7日任大成海外中国机会混合型证券投资基金（LOF）基金经理。2017年8月10日起任大成恒生指数证券投资基金（LOF）基金经理。2019年3月20日起任大成中华沪深港300指数证券投资基金（LOF）基金经理。2021年5月18日起任大成恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理。2021年9月9日起任大成恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。2023年7月12日起任大成纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理。2024年5月29日起任大成全球美元债债券型证券投资基金（QDII）基金经理。2024年6月18日起任大成恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理。2025年6月24日起担任大成恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从

业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 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

7 月份以来的经济数据显示，美国宏观经济有边际走弱的趋势，因此市场对于美联储降息的预期也有所提升。

美股指数涨跌的核心因素是上市公司盈利的变动。当前彭博一致预期数据显示 2025 年美股上市公司盈利仍然有较好的增长，但从估值角度来看，当前主要美股指数的市盈率已经高于历史平均水平。

本基金的投资目标是要复制基准指数的收益率，因此本基金将坚持被动化的投资理念，持续

实施高效的组合管理策略、交易策略及风险控制方法，以期更好地跟踪指数，力争将跟踪误差控制在较低的水平。

#### 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 2.5964 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.24%，同期业绩比较基准收益率为 4.82%；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 2.5898 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.12%，同期业绩比较基准收益率为 4.82%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025 年上半年，全球经济形势经历了显著波动，美国主要股指呈现剧烈震荡态势。这一时期的金融市场表现主要受到以下几方面因素的影响：

今年 2 月以来，美国政府主动缩减财政支出，对经济形成短期抑制效应。这一政策调整导致 2 月下旬起多项宏观经济指标呈现疲软态势，美国主要股指随之出现显著回调。4 月 2 日，特朗普政府正式推出“对等关税政策”，进一步加剧了宏观经济前景的不确定性。

5 月后，随着特朗普政府关税政策的实施细则逐渐明朗，市场不确定性显著降低，美国宏观经济逐步回归正常运转。5 月及 6 月的数据显示，经济活动已重新回到稳健增长轨道，主要体现在就业市场持续强劲，在此支撑下，居民消费继续保持稳步扩张态势。

二季度，特朗普政府关税政策引发的通胀预期分歧曾导致金融市场显著波动。然而，5-6 月实际通胀数据持续温和，有效缓解了市场对关税可能引发通胀抬头的担忧。由于担心关税政策对通胀影响的不确定性，美联储在今年上半年暂停了降息进程，但实际通胀数据的稳定性为美联储在下半年重启宽松周期创造了条件。

#### 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。估值委员会由公司分管领导、各投研部门、交易管理部、风险管理部、监察稽核部、基金运营部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。

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

交易信息；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管人沟通估值调整事项；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算人员执行，并与托管人的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制，投资组合经理作为估值小组成员，对持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管人沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间交易的债券品种的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.7 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 22,537,754.13 元，每十份基金份额分红 0.7451 元；大成标普 500 等权重指数(QDII)C 已分配利润 3,673,861.39 元，每十份基金份额分红 0.7360 元；符合基金合同规定的分红比例。

#### 4.8 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：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	65,593,260.87	61,453,622.90
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	950,510,212.98	770,025,843.25
其中：股票投资		950,510,212.98	770,025,843.25
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	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		4,589,018.45	-
应收股利		904,336.18	789,805.31
应收申购款		1,551,876.20	8,850,413.32
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	149,223.24	-
资产总计		1,023,297,927.92	841,119,684.78
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>

		2025 年 6 月 30 日	2024 年 12 月 31 日
<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		15,904,874.28	6,852,047.19
应付管理人报酬		827,804.33	705,755.73
应付托管费		165,560.86	176,438.93
应付销售服务费		45,158.22	21,863.15
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	134,535.55	195,614.93
负债合计		17,077,933.24	7,951,719.93
<b>净 资 产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	387,715,650.53	321,984,645.37
未分配利润	6.4.7.12	618,504,344.15	511,183,319.48
净资产合计		1,006,219,994.68	833,167,964.85
负债和净资产总计		1,023,297,927.92	841,119,684.78

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 387,715,650.53 份。其中大成标普 500 等权重指数(QDII)A 类基金份额总额为 319,716,646.34 份，基金份额净值 2.5964 元；大成标普 500 等权重指数(QDII)C 类基金份额总额为 67,999,004.19 份，基金份额净值 2.5898 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		26,955,722.76	31,408,854.81
1. 利息收入		136,883.86	65,137.95
其中：存款利息收入	6.4.7.13	136,883.86	65,137.95
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）		20,750,580.90	22,687,879.61
其中：股票投资收益	6.4.7.14	12,542,374.85	17,499,839.51
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	6.4.7.17	-	-
收益			
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	8,208,206.05	5,188,040.10
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	9,807,496.70	10,165,405.33
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-4,055,495.84	-1,602,562.57
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	316,257.14	92,994.49
<b>减：二、营业总支出</b>		6,538,553.16	4,259,797.33
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,026,639.58	3,199,730.93
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,081,108.10	799,932.72
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	280,400.88	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	150,404.60	204,273.34
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		20,417,169.60	27,149,057.48
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		20,417,169.60	27,149,057.48
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		20,417,169.60	27,149,057.48

### 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----



	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	321,984,645.37	-	511,183,319.48	833,167,964.85
二、本期期初净资产	321,984,645.37	-	511,183,319.48	833,167,964.85
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	65,731,005.16	-	107,321,024.67	173,052,029.83
(一)、综合收益总额	-	-	20,417,169.60	20,417,169.60
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	65,731,005.16	-	113,115,470.59	178,846,475.75
其中：1. 基金申购款	286,179,574.93	-	440,401,217.62	726,580,792.55
2. 基金赎回款	-220,448,569.77	-	-327,285,747.03	-547,734,316.80
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-26,211,615.52	-26,211,615.52
四、本期期末净资产	387,715,650.53	-	618,504,344.15	1,006,219,994.68
项目	上年度可比期间			
	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	86,586,685.86	-	118,425,143.79	205,011,829.65

净资产变动数 (净资产减少以 “-”号填列)				
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

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

谭晓冈

范瑛

梁靖

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 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

大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同》，自 2021 年 9 月 7 日起，本基金增加美元基金份额，现有的基金份额变更为人民币基金份额。其中，以人民币计价并进行申购、赎回的份额类别，称为人民币基金份额；以美元计价并进行申购、赎回的份额类别，称为美元基金份额。各类基金份额分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。

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

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

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 2025 年 8 月 28 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 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

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 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[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，

不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

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

如基金取得源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(5) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

## 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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	65,593,260.87
等于：本金	65,588,679.96
加：应计利息	4,580.91
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	65,593,260.87

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	828,207,789.78	-	950,510,212.98	122,302,423.20
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	828,207,789.78	-	950,510,212.98	122,302,423.20

## 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 2025 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	149,223.24

待摊费用	-
合计	149,223.24

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	27,353.40
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	3,920.77
预提费用	103,261.38
合计	134,535.55

#### 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	285,403,996.15	285,403,996.15
本期申购	186,195,452.69	186,195,452.69
本期赎回 (以“-”号填列)	-151,882,802.50	-151,882,802.50
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	319,716,646.34	319,716,646.34

大成标普 500 等权重指数 (QDII) C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	36,580,649.22	36,580,649.22
本期申购	99,984,122.24	99,984,122.24
本期赎回 (以“-”号填列)	-68,565,767.27	-68,565,767.27
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	67,999,004.19	67,999,004.19



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	212,635,159.50	240,612,305.90	453,247,465.40
本期期初	212,635,159.50	240,612,305.90	453,247,465.40
本期利润	8,617,781.54	9,674,287.66	18,292,069.20
本期基金份额交易产生的变动数	23,784,296.80	37,616,510.54	61,400,807.34
其中：基金申购款	130,628,916.01	156,239,242.93	286,868,158.94
基金赎回款	-106,844,619.21	-118,622,732.39	-225,467,351.60
本期已分配利润	-22,537,754.13	-	-22,537,754.13
本期末	222,499,483.71	287,903,104.10	510,402,587.81

##### 大成标普 500 等权重指数(QDII)C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	26,923,050.16	31,012,803.92	57,935,854.08
本期期初	26,923,050.16	31,012,803.92	57,935,854.08
本期利润	1,991,891.36	133,209.04	2,125,100.40
本期基金份额交易产生的变动数	21,275,689.85	30,438,973.40	51,714,663.25
其中：基金申购款	66,811,579.51	86,721,479.17	153,533,058.68
基金赎回款	-45,535,889.66	-56,282,505.77	-101,818,395.43
本期已分配利润	-3,673,861.39	-	-3,673,861.39
本期末	46,516,769.98	61,584,986.36	108,101,756.34

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
活期存款利息收入	117,103.30
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	19,780.56
合计	136,883.86

#### 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
	2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	12,542,374.85
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	12,542,374.85

#### 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
	2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	168,701,888.47
减：卖出股票成本总额	155,980,452.51
减：交易费用	179,061.11
买卖股票差价收入	12,542,374.85

#### 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
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	8,208,206.05
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	8,208,206.05

## 6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	9,807,496.70
股票投资	9,807,496.70
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	9,807,496.70

#### 6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	311,210.51
其他	5,046.63
合计	316,257.14

#### 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
	2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	46,292.57
银行划款手续费	17,331.58
合计	150,404.60

#### 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 2025年1月1日至2025年6 月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,026,639.58	3,199,730.93
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,642,737.41	900,940.45
应支付基金管理人的净管理费	3,383,902.17	2,298,790.48

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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 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
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,081,108.10	799,932.72

注：自 2024 年 1 月 1 日至 2025 年 2 月 27 日止，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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

根据基金管理人大成基金于 2025 年 2 月 27 日发布的《大成基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同和托管协议的公告》，自 2025 年 2 月 28 日起，支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 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		
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成标普 500 等权重指数 (QDII) A	大成标普 500 等权重指数 (QDII) C	合计
大成基金	-	7,692.62	7,692.62
合计	-	7,692.62	7,692.62
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 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

注：C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.3%。

销售服务费的计算方法如下：

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

H 为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为该类基金份额前一日基金资产净值

#### 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
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
	大成标普 500 等权重指数 (QDII)A	大成标普 500 等权重指数 (QDII)C
基金合同生效日（2011 年 3 月 23 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	4,340.28
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	4,340.28
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-
项目	上年度可比期间	上年度可比期间
	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%

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 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	60,070,230.67	117,103.30	35,271,367.46	65,137.95
中银香港	5,523,030.20	-	13,945,168.56	-

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	2025年1月20日	-	2025年1月17日	0.7451	8,780,753.20	13,757,000.93	22,537,754.13	-
合计	-	-	-	0.7451	8,780,753.20	13,757,000.93	22,537,754.13	-
大成标普 500 等权重指数(QDII)C								
序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					



					额			
1	2025 年 1 月 20 日	-	2025 年 1 月 17 日	0.7360	2,769,764.06	904,097.33	3,673,861.39	-
合计	-	-	-	0.7360	2,769,764.06	904,097.33	3,673,861.39	-

#### 6.4.12 期末（2025 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，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 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	60,070,230.67	-	-	5,523,030.20	65,593,260.87
交易性金融资产	-	-	-	950,510,212.98	950,510,212.98
应收股利	-	-	-	904,336.18	904,336.18
应收申购款	38,800.31	-	-	1,513,075.89	1,551,876.20
应收清算款	-	-	-	4,589,018.45	4,589,018.45
其他资产	-	-	-	149,223.24	149,223.24
资产总计	60,109,030.98	-	-	963,188,896.94	1,023,297,927.92
负债					
应付赎回款	-	-	-	15,904,874.28	15,904,874.28

应付管理人报酬	-	-	-	827,804.33	827,804.33
应付托管费	-	-	-	165,560.86	165,560.86
应付销售服务费	-	-	-	45,158.22	45,158.22
其他负债	-	-	-	134,535.55	134,535.55
负债总计	-	-	-	17,077,933.24	17,077,933.24
利率敏感度缺口	60,109,030.98	-	-	-946,110,963.70	1,006,219,994.68
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	47,770,589.76	-	-	13,683,033.14	61,453,622.90
交易性金融资产	-	-	-	-770,025,843.25	770,025,843.25
应收股利	-	-	-	789,805.31	789,805.31
应收申购款	125,381.69	-	-	8,725,031.63	8,850,413.32
资产总计	47,895,971.45	-	-	-793,223,713.33	841,119,684.78
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,852,047.19	6,852,047.19
应付管理人报酬	-	-	-	705,755.73	705,755.73
应付托管费	-	-	-	176,438.93	176,438.93
应付销售服务费	-	-	-	21,863.15	21,863.15
其他负债	-	-	-	195,614.93	195,614.93
负债总计	-	-	-	7,951,719.93	7,951,719.93
利率敏感度缺口	47,895,971.45	-	-	-785,271,993.40	833,167,964.85

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

#### 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和交易性资产支持证券投资（上年度末：同），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（上年度末：同）。

#### 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 2025 年 6 月 30 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				
货币资金	19,128,639.81	-	-	19,128,639.81
交易性金融资产	950,510,212.98	-	-	950,510,212.98
应收股利	904,336.18	-	-	904,336.18
应收清算款	4,589,018.45	-	-	4,589,018.45
其他资产	149,223.24	-	-	149,223.24
资产合计	975,281,430.66	-	-	975,281,430.66
以外币计价的负债				
其他负债	13,913.96	-	-	13,913.96
负债合计	13,913.96	-	-	13,913.96
资产负债表外汇风险敞口净额	975,267,516.70	-	-	975,267,516.70
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
货币资金	13,684,938.78	-	-	13,684,938.78
交易性金融资产	770,025,843.25	-	-	770,025,843.25
应收股利	789,805.31	-	-	789,805.31
资产合计	784,500,587.34	-	-	784,500,587.34

	87.34			
以外币计价的负债				
其他负债	3,937.09	-	-	3,937.09
负债合计	3,937.09	-	-	3,937.09
资产负债表外 外汇风险敞口净额	784,496,650.25	-	-	784,496,650.25

#### 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（2025年6月30日）	上年度末（2024年12月31日）
	所有外币相对人民币升值 5%	48,763,375.84	39,224,832.45
	所有外币相对人民币贬值 5%	-48,763,375.84	-39,224,832.45

#### 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 2025年6月30日		上年度末 2024年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	950,510,212.98	94.46	770,025,843.25	92.42
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	950,510,212.98	94.46	770,025,843.25	92.42

#### 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（2025年6月30日）	上年度末（2024年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	37,428,322.49	38,501,754.10
	业绩比较基准下降5%	-37,428,322.49	-38,501,754.10

#### 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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	950,510,212.98	770,025,843.25
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	950,510,212.98	770,025,843.25

##### 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证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；对于定期开放的基金投资，本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关投资的公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### 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工具(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货币资金、应收款项和其他金融负债等，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 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	950,510,212.98	92.89
	其中：普通股	950,510,212.98	92.89



	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	65,593,260.87	6.41
8	其他各项资产	7,194,454.07	0.70
9	合计	1,023,297,927.92	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	950,510,212.98	94.46
合计	950,510,212.98	94.46

## 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	50,034,730.80	4.97
非必需消费品	95,598,831.83	9.50
必需消费品	67,533,303.52	6.71
能源	43,088,198.61	4.28
金融	150,739,860.07	14.98
房地产	54,592,965.27	5.43
医疗保健	105,132,479.42	10.45
工业	143,724,704.41	14.28
材料	47,482,489.55	4.72
科技	133,810,712.23	13.30
公用事业	58,384,897.90	5.80
政府	-	-
合计	950,123,173.61	94.42

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

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
通讯	-	-
非必需消费品	-	-
必需消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
房地产	-	-
医疗保健	-	-
工业	387,039.37	0.04
材料	-	-
科技	-	-
公用事业	-	-
政府	-	-
合计	387,039.37	0.04

注：以上分类采用彭博行业分类标准。

## 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

## 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	Capital One Financial Corp	第一资本金融	COF US	美国纽约证券交易所	美国	3,132	4,770,235.62	0.47
2	GE Vernova Inc.	通用电气 Vernova 股份有限公司	GEV US	美国纽约证券交易所	美国	828	3,136,441.80	0.31
3	Nrg Energy Inc.	NRG 能源股份有限公司	NRG US	美国纽约证券交易所	美国	2,674	3,073,837.84	0.31
4	Seagate Technology	Seagate Technology	STX US	纳斯达克证券交易所	美国	2,851	2,945,655.30	0.29

	Holdings Public Limited Company	控股公共有限公司						
5	Palantir Technologies Inc.	Palantir 科技股份有限公司	PLTR US	纳斯达克证券交易所	美国	2,956	2,884,643.20	0.29
6	Jabil Inc.	捷普集团	JBL US	美国纽约证券交易所	美国	1,844	2,879,019.98	0.29
7	Dollar Tree Inc.	美元树公司	DLTR US	纳斯达克证券交易所	美国	3,994	2,831,697.05	0.28
8	Vistra Corp.	Vistra 公司	VST US	美国纽约证券交易所	美国	2,028	2,813,663.96	0.28
9	Amphe nol Corporation	安费诺公司	APH US	美国纽约证券交易所	美国	3,936	2,782,404.65	0.28
10	Dollar General Corporation	达乐公司	DG US	美国纽约证券交易所	美国	3,304	2,705,317.41	0.27
11	Quanta Services Inc.	Quanta 服务股份有限公司	PWR US	美国纽约证券交易所	美国	992	2,684,871.30	0.27
12	Royal Caribbean Cruises	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	1,192	2,672,039.65	0.27

	Ltd.							
13	Constellation Energy Corporation	美国联合能源公司	CEG US	纳斯达克证券交易所	美国	1,148	2,652,465.18	0.26
14	Western Digital Corp.	西部数据公司	WDC US	纳斯达克证券交易所	美国	5,757	2,637,159.73	0.26
15	Axon Enterprise, Inc.	Axon Enterprise 股份有限公司	AXON US	纳斯达克证券交易所	美国	443	2,625,612.84	0.26
16	Mosaic Co.	Mosaic 公司	MOS US	美国纽约证券交易所	美国	10,017	2,615,896.76	0.26
17	CrowdStrike Holdings, Inc.	CrowdStrike 控股股份有限公司	CRWD US	纳斯达克证券交易所	美国	713	2,599,559.90	0.26
18	Howmet Aerospace Inc.	Howmet 航空航天股份有限公司	HWM US	美国纽约证券交易所	美国	1,933	2,575,587.61	0.26
19	Netflix Inc.	奈飞公司	NFLX US	纳斯达克证券交易所	美国	268	2,569,127.33	0.26
20	Oracle Corp.	甲骨文	ORCL US	美国纽约证券交易所	美国	1,639	2,565,173.85	0.25
21	Carnival Corporation	嘉年华公司	CCL US	美国纽约证券交易所	美国	12,683	2,553,085.77	0.25
22	Ulta	Ulta	ULTA	纳斯达克	美国	751	2,515,051.13	0.25

	Beauty, Inc	美容产品公司	US	克 证 券 交 易 所				
23	Broadcom Inc.	博通股份有限公司	AVGO US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,273	2,511,970.28	0.25
24	Intuit Inc.	Intuit 股份有限公司	INTU US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	442	2,492,141.03	0.25
25	Advanced Micro Devices Inc.	AMD 公司	AMD US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,453	2,491,770.50	0.25
26	KLA Corporation	KLA 公司	KLAC US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	384	2,462,301.84	0.24
27	Booking Holdings Inc.	Booking 控股股份有限公司	BKNG US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	59	2,445,128.35	0.24
28	Northern Trust Corp.	北美信托	NTRS US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,664	2,417,950.01	0.24
29	NVIDIA Corp.	英伟达	NVDA US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,136	2,415,788.69	0.24
30	Micro Technology Inc.	美光科技股份有限公司	MU US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,736	2,413,965.82	0.24
31	Microchip Technology Inc.	微芯科技股份有限公司	MCHP US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	4,765	2,400,372.00	0.24
32	Hewlett Packard	慧与公司	HPE US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	16,390	2,399,387.33	0.24

	Enterprise Company							
33	Johnson Controls International plc	江森自控国际有限公司	JCI US	美国纽约证券交易所	美国	3,143	2,376,395.06	0.24
34	Newmont Corporation	纽蒙黄金公司	NEM US	美国纽约证券交易所	美国	5,668	2,363,896.28	0.23
35	Citigroup Inc.	花旗集团	C US	美国纽约证券交易所	美国	3,851	2,346,568.46	0.23
36	Cardinal Health Inc.	嘉德诺健康集团	CAH US	美国纽约证券交易所	美国	1,950	2,345,157.36	0.23
37	General Electric Company	通用电气航空航天	GE US	美国纽约证券交易所	美国	1,268	2,336,356.00	0.23
38	The Goldman Sachs Group, Inc.	高盛	GS US	美国纽约证券交易所	美国	461	2,335,656.11	0.23
39	Boeing Co.	波音	BA US	美国纽约证券交易所	美国	1,557	2,335,408.85	0.23
40	DoorDash, Inc.	DoorDash 股份有限公司	DASH US	纳斯达克证券交易所	美国	1,317	2,324,065.76	0.23
41	Uber Techn	优步技术股份	UBER US	美国纽约证券	美国	3,473	2,319,607.60	0.23

	ologies, Inc.	有限公司		交易所				
42	IDEXX Laboratories, Inc.	爱德士股份有限公司	IDXX US	纳斯达克证券交易所	美国	599	2,299,826.67	0.23
43	Microsoft Corporation	微软	MSFT US	纳斯达克证券交易所	美国	645	2,296,689.70	0.23
44	Dell Technologies Inc.	戴尔科技公司	DELL US	美国纽约证券交易所	美国	2,615	2,295,040.00	0.23
45	American Express Co.	美国运通	AXP US	美国纽约证券交易所	美国	1,003	2,290,300.58	0.23
46	Trane Technologies plc	特灵科技公共有限公司	TT US	美国纽约证券交易所	美国	728	2,279,545.07	0.23
47	Cadence Design Systems, Inc.	Cadence 设计系统股份有限公司	CDNS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,033	2,278,718.04	0.23
48	Tesla, Inc.	特斯拉公司	TSLA US	纳斯达克证券交易所	美国	996	2,264,904.87	0.23
49	Arista Networks, Inc.	Arista 网络股份有限公司	ANET US	美国纽约证券交易所	美国	3,081	2,256,513.20	0.22
50	Emerson Electric	艾默生电气	EMR US	美国纽约证券交易所	美国	2,361	2,253,470.94	0.22

	Co.							
51	JPMorgan Chase & Co.	摩根大通	JPM US	美国纽约证券交易所	美国	1,085	2,251,754.45	0.22
52	Lam Research Corp.	泛林集团	LRCX US	纳斯达克证券交易所	美国	3,229	2,250,025.72	0.22
53	Rockwell Automation Inc.	罗克韦尔自动化	ROK US	美国纽约证券交易所	美国	944	2,244,711.32	0.22
54	Insulet Corporation	Insulet 股份有限公司	PODD US	纳斯达克证券交易所	美国	995	2,237,843.50	0.22
55	Corteva, Inc.	科迪华公司	CTVA US	美国纽约证券交易所	美国	4,192	2,236,559.68	0.22
56	Huntington Ingalls Industries, Inc.	Huntington Ingalls 工业公司	HII US	美国纽约证券交易所	美国	1,289	2,228,056.55	0.22
57	The Walt Disney Company	华特迪士尼公司	DIS US	美国纽约证券交易所	美国	2,504	2,222,895.92	0.22
58	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	424	2,219,918.51	0.22
59	Texas Instruments	德州仪器	TXN US	纳斯达克证券交易所	美国	1,489	2,213,053.84	0.22



	Incorporated							
60	Synchrony Financial	同步金融公司	SYF US	美国纽约证券交易所	美国	4,613	2,203,929.78	0.22
61	Franklin Resources Inc.	富兰克林资源	BEN US	美国纽约证券交易所	美国	12,875	2,198,182.35	0.22
62	Electronic Arts Inc.	电子艺界	EA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,922	2,197,285.02	0.22
63	State Street Corp.	道富集团	STT US	美国纽约证券交易所	美国	2,883	2,194,670.85	0.22
64	Morgan Stanley	摩根士丹利	MS US	美国纽约证券交易所	美国	2,169	2,187,133.70	0.22
65	TKO Group Holdings, Inc.	TKO 集团控股有限公司	TKO US	美国纽约证券交易所	美国	1,679	2,186,909.71	0.22
66	United Rentals, Inc.	联合租赁公司	URI US	美国纽约证券交易所	美国	405	2,184,282.14	0.22
67	DexCom, Inc.	Dexcom 股份有限公司	DXCM US	纳斯达克证券交易所	美国	3,495	2,183,935.31	0.22
68	Hilton Worldwide Holdings Inc.	希尔顿全球控股股份有限公司	HLT US	美国纽约证券交易所	美国	1,145	2,183,081.64	0.22
69	Live	Live	LYV US	美国纽	美国	2,012	2,178,901.45	0.22

	Nation Entertainment, Inc.	Nation 娱乐公司		约 证 券 交 易 所				
70	KKR & Co. Inc.	KKR & Co 股份有限公司	KKR US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	2,288	2,178,881.98	0.22
71	Charles Schwab Corp.	嘉信理 财	SCHW US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	3,332	2,176,298.01	0.22
72	Autodesk Inc.	欧特克	ADSK US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	982	2,176,198.22	0.22
73	Applied Materials, Inc.	应用材 料	AMAT US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,659	2,174,160.81	0.22
74	Nasdaq, Inc.	纳斯达 克股份 有限公 司	NDAQ US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	3,389	2,169,373.50	0.22
75	Verisign Inc.	威瑞信 股份有 限公司	VRSN US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,049	2,168,706.46	0.22
76	Tapestry, Inc.	TPR-DR S-RS 公司	TPR US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	3,449	2,168,029.90	0.22
77	HCA Healthcare, Inc.	HCA 医 疗保健 有限公 司	HCA US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	790	2,166,543.13	0.22
78	ON Semiconductor Corporation	安森美 半导体 公司	ON US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	5,772	2,165,551.81	0.22
79	Eaton	伊顿公 司	ETN US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	846	2,161,994.13	0.21

	Corporation Plc	共有限公司		约 证 券 交 易 所				
80	Hubbell Inc.	哈 贝 尔 公 司	HUBB US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	738	2,157,649.14	0.21
81	ServiceNow, Inc.	Servic eNow 公 司	NOW US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	293	2,156,366.75	0.21
82	First Solar Inc.	福 思 第 一 太 阳 能 公 司	FSLR US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,818	2,154,392.98	0.21
83	Ralph Lauren Corporation	拉 夫 劳 伦	RL US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,097	2,153,916.51	0.21
84	The Estee Lauder Companies Inc.	雅 诗 兰 黛	EL US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	3,722	2,152,860.18	0.21
85	Cisco Systems, Inc.	思 科	CSCO US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	4,329	2,150,057.02	0.21
86	Marathon Petroleum Corporation	马 拉 松 石 油 公 司	MPC US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,803	2,143,974.43	0.21
87	RTX Corporation	RTX 公 司	RTX US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	2,045	2,137,635.99	0.21
88	Palo Alto Networks Inc.	Palo Alto Networ ks 股 份 有 限	PANW US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,458	2,135,876.55	0.21

		公司						
89	Philip Morris International Inc.	菲利普莫里斯国际集团公司	PM US	美国纽约证券交易所	美国	1,634	2,130,402.37	0.21
90	Parke-Hanfin Corp.	派克汉尼汾公司	PH US	美国纽约证券交易所	美国	426	2,130,028.69	0.21
91	Pentair plc	Pentair 公共有限公司	PNR US	美国纽约证券交易所	美国	2,891	2,124,601.32	0.21
92	L3Harris Technologies, Inc.	L3Harris Technologies 股份有限公司	LHX US	美国纽约证券交易所	美国	1,183	2,124,269.59	0.21
93	Moody's Corp.	穆迪	MCO US	美国纽约证券交易所	美国	591	2,122,093.16	0.21
94	Fidelity National Information Services, Inc.	繁德信息技术有限公司	FIS US	美国纽约证券交易所	美国	3,630	2,115,497.30	0.21
95	Honeywell International Inc.	霍尼韦尔	HON US	纳斯达克证券交易所	美国	1,268	2,113,876.17	0.21
96	W.R. Berkley	WR Berkley 公司	WRB US	美国纽约证券交易所	美国	4,018	2,113,236.33	0.21

	Corporation							
97	Trimble Inc.	天宝股份有限公司	TRMB US	纳斯达克证券交易所	美国	3,885	2,113,092.01	0.21
98	Hasbro Inc.	孩之宝	HAS US	纳斯达克证券交易所	美国	3,998	2,112,734.51	0.21
99	EQT Corp.	EQT 公司	EQT US	美国纽约证券交易所	美国	5,052	2,109,157.22	0.21
100	Meta Platforms, Inc.	Meta 平台股份有限公司	META US	纳斯达克证券交易所	美国	399	2,108,192.74	0.21
101	Westinghouse Air Brake Technologies Corporation	西屋制动公司	WAB US	美国纽约证券交易所	美国	1,405	2,105,607.34	0.21
102	Iron Mountain Inc.	美国铁山公司	IRM US	美国纽约证券交易所	美国	2,860	2,099,976.74	0.21
103	Bank of America Corp.	美国银行公司	BAC US	美国纽约证券交易所	美国	6,197	2,099,202.47	0.21
104	Marrriott International Inc.	万豪国际	MAR US	纳斯达克证券交易所	美国	1,073	2,098,574.59	0.21
105	Cf Industries Holdi	CF 工业控股股份有限公司	CF US	美国纽约证券交易所	美国	3,182	2,095,637.20	0.21

	ngs Inc.							
106	Synopsys, Inc.	新思科技公司	SNPS US	纳斯达克证券交易所	美国	571	2,095,610.57	0.21
107	Cboe Global Markets, Inc.	Cboe 环球市场公司	CBOE US	巴兹全球市场	美国	1,255	2,095,168.67	0.21
108	Take-Two Interactive Software, Inc.	Take-Two 互动软件股份有限公司	TTWO US	纳斯达克证券交易所	美国	1,204	2,093,113.08	0.21
109	Martin Marietta Materials, Inc.	Martin Marietta 材料股份有限公司	MLM US	美国纽约证券交易所	美国	532	2,090,645.65	0.21
110	Leidos Holdings, Inc.	Leidos 控股公司	LDOS US	美国纽约证券交易所	美国	1,851	2,090,409.70	0.21
111	Williams Companies, Inc.	威廉姆斯公司	WMB US	美国纽约证券交易所	美国	4,648	2,089,887.98	0.21
112	International Business Machines Corporation	国际商业机器公司	IBM US	美国纽约证券交易所	美国	990	2,089,109.99	0.21

	n							
113	Cencora, Inc.	Cencora 股份有限公司	COR US	美国 纽约 证券交易所	美国	973	2,088,550.54	0.21
114	Freemort-McMoran Inc.	自由港迈克墨伦股份有限公司	FCX US	美国 纽约 证券交易所	美国	6,724	2,086,627.38	0.21
115	TE Connectivity plc	TE Connectivity 公共有限公司	TEL US	美国 纽约 证券交易所	美国	1,727	2,085,250.71	0.21
116	Norfolk Southern Corp.	诺福克南方	NSC US	美国 纽约 证券交易所	美国	1,133	2,076,094.29	0.21
117	ResMed Inc.	瑞思迈股份有限公司	RMD US	美国 纽约 证券交易所	美国	1,123	2,074,089.81	0.21
118	Fastenal Co	法思诺公司	FAST US	纳斯达克 证券交易所	美国	6,888	2,070,954.35	0.21
119	Charter Communications, Inc.	Charter 通信公司	CHTR US	纳斯达克 证券交易所	美国	707	2,069,040.64	0.21
120	CSX Corp.	CSX 公司	CSX US	纳斯达克 证券交易所	美国	8,857	2,068,863.39	0.21
121	S&P Global Inc.	标普全球	SPGI US	美国 纽约 证券交易所	美国	547	2,064,738.03	0.21
122	Gen Digital Inc.	Gen Digital 股份有限公司	GEN US	纳斯达克 证券交易所	美国	9,802	2,062,956.76	0.21
123	Netapp Inc.	美国网域存储	NTAP US	纳斯达克 证券交易所	美国	2,703	2,061,710.09	0.20

		技术有限公司		交易所				
124	Allegion Plc	安朗杰公共有限公司	ALLE US	美国纽约证券交易所	美国	1,995	2,058,236.38	0.20
125	Wells Fargo & Co.	富国银行	WFC US	美国纽约证券交易所	美国	3,588	2,057,886.75	0.20
126	Expanded Energy Corporation	Expand 能源公司	EXE US	纳斯达克证券交易所	美国	2,453	2,053,471.76	0.20
127	Cintas Corp	Cintas 公司	CTAS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,286	2,051,732.22	0.20
128	Corning Inc.	康宁公司	GLW US	美国纽约证券交易所	美国	5,447	2,050,636.31	0.20
129	Keyight Technologies Inc.	是德科技公司	KEYS US	美国纽约证券交易所	美国	1,745	2,046,899.30	0.20
130	Super Micro Computer, Inc.	Super Micro Computer 股份有限公司	SMCI US	纳斯达克证券交易所	美国	5,823	2,042,958.71	0.20
131	Analog Devices Inc.	亚德诺半导体	ADI US	纳斯达克证券交易所	美国	1,197	2,039,556.30	0.20
132	Huntington Bancshares Inc.	俄亥俄州亨廷顿银行控股公司	HBAN US	纳斯达克证券交易所	美国	16,998	2,039,388.36	0.20
133	Monster	怪兽饮料公司	MNST US	纳斯达克证券交易所	美国	4,546	2,038,493.24	0.20



	Beverage Corporation			交易所				
134	Align Technology, Inc.	Align 科技股份有限公司	ALGN US	纳斯达克证券交易所	美国	1,502	2,035,717.28	0.20
135	Black Rock, Inc.	贝莱德股份有限公司	BLK US	美国纽约证券交易所	美国	271	2,035,524.64	0.20
136	Digital Realty Trust, Inc.	数字房地产信托有限公司	DLR US	美国纽约证券交易所	美国	1,630	2,034,172.74	0.20
137	US Bancorp	美国合众银行	USB US	美国纽约证券交易所	美国	6,279	2,033,935.44	0.20
138	Darden Restaurants Inc.	达登餐饮公司	DRI US	美国纽约证券交易所	美国	1,302	2,031,588.77	0.20
139	Caterpillar Inc.	卡特彼勒	CAT US	美国纽约证券交易所	美国	731	2,031,478.32	0.20
140	Vulcan Materials Co.	Vulcan 材料	VMC US	美国纽约证券交易所	美国	1,088	2,031,411.38	0.20
141	Walmart Inc.	沃尔玛股份有限公司	WMT US	美国纽约证券交易所	美国	2,902	2,031,306.87	0.20
142	McKesson Corp.	McKesson 公司	MCK US	美国纽约证券交易所	美国	386	2,024,832.06	0.20
143	Verisk Analytics, Inc.	Verisk 分析公司	VRSK US	纳斯达克证券交易所	美国	908	2,024,752.74	0.20

144	Trans Digm Group Incor porat ed	TransD igm集 团公司	TDG US	美国纽 约证券 交易所	美国	186	2,024,731.55	0.20
145	EBay Inc.	eBay 股份有 限公司	EBAY US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,797	2,023,912.46	0.20
146	Edwar ds Lifes cienc es Corp.	爱德华 生命科 学公司	EW US	美国纽 约证券 交易所	美国	3,610	2,021,145.52	0.20
147	CME Group Inc.	芝加哥 商业交 易所	CME US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,019	2,010,541.35	0.20
148	Evers ource Ener gy	Evers ource 能源公 司	ES US	美国纽 约证券 交易所	美国	4,402	2,004,803.44	0.20
149	Ford Motor Co	福特汽 车	F US	美国纽 约证券 交易所	美国	25,790	2,003,130.19	0.20
150	Repub lic Servi ces Inc.	公共服 务公司	RSG US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,134	2,001,943.58	0.20
151	Holog ic Inc.	豪洛捷 公司	HOLX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,283	1,997,824.09	0.20
152	The Bank Of New York Mello n Corpo ratio n	纽约梅 隆银行	BK US	美国纽 约证券 交易所	美国	3,062	1,997,097.78	0.20
153	M&T Bank Corpo	M&T 银 行	MTB US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,437	1,995,557.32	0.20

	ratio n							
154	KeyCorp	KeyCorp 公司	KEY US	美国 纽约 证券 交易所	美国	15,977	1,992,376.83	0.20
155	AT&T Inc.	美国电 话电报 公司	T US	美国 纽约 证券 交易所	美国	9,616	1,992,145.60	0.20
156	Chipotle Mexican Grill Inc.	Chipotle Mexican Grill 股份有 限公司	CMG US	美国 纽约 证券 交易所	美国	4,941	1,986,061.58	0.20
157	General Dynamics Corp	通用动 力	GD US	美国 纽约 证券 交易所	美国	951	1,985,571.29	0.20
158	Juniper Networks Inc.	瞻博网 络股份 有限公 司	JNPR US	美国 纽约 证券 交易所	美国	6,945	1,985,178.93	0.20
159	Archer-daniels-midland Co	Archer-Daniels-Midland 公司	ADM US	美国 纽约 证券 交易所	美国	5,253	1,984,745.76	0.20
160	Paycom Software, Inc.	Paycom 软件股 份有限 公司	PAYC US	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,197	1,982,830.55	0.20
161	Verato Corporation	Veralto 公司	VLTO US	美国 纽约 证券 交易所	美国	2,742	1,981,535.56	0.20
162	Carrier Global Corp	开利全 球公司	CARR US	美国 纽约 证券 交易所	美国	3,780	1,980,485.39	0.20
163	Regio	Region	RF US	美国 纽	美国	11,744	1,977,340.47	0.20

	ns Finan cial Corp	s 金融 公司		约 证 券 交 易 所				
164	Rolli ns, Inc.	Rollin s 公司	ROL US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	4,891	1,975,417.24	0.20
165	Param ount Globa l	派拉蒙 全球	PARA US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	21,358	1,972,324.59	0.20
166	Bosto n Scien tific Corp.	波士顿 科学	BSX US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	2,565	1,972,241.90	0.20
167	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	7,980	1,964,550.35	0.20
168	Ameri prise Finan cial Inc.	阿默普 莱斯金 融公司	AMP US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	514	1,963,870.42	0.20
169	Kinde r Morga n, Inc.	特拉华 州金德 摩根公 司	KMI US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	9,326	1,962,776.45	0.20
170	Autom atic Data Proce ssing , Inc.	Automa tic Data Proces s 公司	ADP US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	889	1,962,656.18	0.20
171	Labco rp Holdi ngs Inc.	Labcor p 控股 股份有 限公司	LH US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,044	1,961,889.07	0.19
172	ANSYS , INC.	ANSYS 股份有	ANS US	纳 斯 达 克 证 券	美 国	779	1,958,595.68	0.19

		限公司		交易所				
173	Citizens Financial Group, Inc.	公民金融集团股份有限公司	CFG US	美国纽约证券交易所	美国	6,111	1,957,642.66	0.19
174	F5, Inc.	F5 股份有限公司	FFIV US	纳斯达克证券交易所	美国	929	1,957,327.89	0.19
175	Textro, Inc.	德事隆	TXT US	美国纽约证券交易所	美国	3,401	1,954,772.34	0.19
176	Kroger Co.	克罗格公司	KR US	美国纽约证券交易所	美国	3,805	1,953,815.67	0.19
177	Zebra Technologies Corporation	斑马技术公司	ZBRA US	纳斯达克证券交易所	美国	885	1,953,571.92	0.19
178	Amazon.com, Inc.	亚马逊公司	AMZN US	纳斯达克证券交易所	美国	1,243	1,952,162.89	0.19
179	Cbre Group, Inc.	世邦魏理仕	CBRE US	美国纽约证券交易所	美国	1,943	1,948,951.47	0.19
180	Warner Bros. Discovery, Inc.	华纳兄弟探索股份有限公司	WBD US	纳斯达克证券交易所	美国	23,736	1,947,243.43	0.19
181	Sempra	Sempra 公司	SRE US	美国纽约证券交易所	美国	3,587	1,945,614.35	0.19
182	United Airlines Holdings, Inc.	美国联合航空控股股份有限公司	UAL US	纳斯达克证券交易所	美国	3,413	1,945,544.19	0.19

183	Skyworks Solutions, Inc.	思佳讯解决方案公司	SWKS US	纳斯达克证券交易所	美国	3,645	1,944,457.59	0.19
184	Bunge Global SA	Bunge Global SA 公司	BG US	美国纽约证券交易所	美国	3,382	1,943,609.72	0.19
185	PTC Inc.	PTC 公司	PTC US	纳斯达克证券交易所	美国	1,575	1,943,098.17	0.19
186	Steel Dynamics Inc.	Steel Dynamics 股份有限公司	STLD US	纳斯达克证券交易所	美国	2,118	1,940,876.71	0.19
187	The Hartford Insurance Group, Inc.	哈特福德保险集团股份有限公司	HIG US	美国纽约证券交易所	美国	2,136	1,939,939.94	0.19
188	Ball Corp.	波尔	BALL US	美国纽约证券交易所	美国	4,824	1,936,960.82	0.19
189	Wynn Resorts, Limited	永利度假村有限公司	WYNN US	纳斯达克证券交易所	美国	2,887	1,935,866.48	0.19
190	GoDaddy Inc.	GoDaddy 股份有限公司	GDDY US	美国纽约证券交易所	美国	1,501	1,934,755.25	0.19
191	Intuitive Surgical Inc.	直觉外科手术公司	ISRG US	纳斯达克证券交易所	美国	497	1,933,357.25	0.19
192	Loews Corp	罗斯公司	L US	美国纽约证券交易所	美国	2,944	1,931,727.02	0.19
193	Gener	Genera	GNRC	美国纽	美国	1,884	1,931,444.97	0.19

	ac Holdings Inc.	c 控股公司	US	约 证 券 交 易 所				
194	Jacobson Solutions Inc.	嘉科解决方案股份有限公司	J US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,052	1,930,927.83	0.19
195	The Pnc Financial Services Group, Inc.	PNC 财务服务	PNC US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,446	1,929,695.98	0.19
196	O'reilly Automotive Inc.	O'Reilly 汽车股份有限公司	ORLY US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,985	1,925,935.78	0.19
197	Universal Health Services, Inc.	Universal 保健服务股份有限公司	UHS US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,484	1,924,422.10	0.19
198	Stryker Corp	史赛克	SYK US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	679	1,923,034.55	0.19
199	Raymond James Financial, Inc.	Raymond James 金融股份有限公司	RJF US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,751	1,922,448.26	0.19
200	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	5,459	1,921,895.26	0.19
201	Intercontinental	洲际交易所 (ICE)	ICE US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,463	1,921,487.14	0.19

	l Excha nge, Inc.							
202	SBA Comm nicat ions Corpo ratio n	SBA 通 信公司	SBAC US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,142	1,919,845.46	0.19
203	Equif ax Inc.	Equifa x 股 份 有 限 公 司	EFX US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,033	1,917,998.04	0.19
204	Intel Corpo ratio n	英 特 尔	INTC US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	11,959	1,917,657.22	0.19
205	PayPa l Holdi ngs Inc.	Paypal 控 股 股 份 有 限 公 司	PYPL US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	3,604	1,917,425.86	0.19
206	BXP, Inc.	波 士 顿 地 产 公 司	BXP US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,960	1,912,643.34	0.19
207	Forti net Inc.	Fortin et 股 份 有 限 公 司	FTNT US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,525	1,910,938.16	0.19
208	Quest Diagn ostic s Inc.	Quest Diagno stics 股 份 有 限 公 司	DGX US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,486	1,910,846.39	0.19
209	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	1,195	1,910,568.06	0.19
210	Truis t Finan	Truist 金 融 公 司	TFC US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	6,208	1,910,500.91	0.19



	cial Corp.							
211	Broadridge Financial Solutions, Inc.	布罗德里奇金融解决方案股份有限公司	BR US	美国纽约证券交易所	美国	1,098	1,910,250.50	0.19
212	Crown Castle Inc.	冠城股份有限公司	CCI US	美国纽约证券交易所	美国	2,595	1,908,370.73	0.19
213	Southwest Airlines Co.	西南航空	LUV US	美国纽约证券交易所	美国	8,216	1,907,960.47	0.19
214	Deere & Co.	迪尔	DE US	美国纽约证券交易所	美国	524	1,907,400.09	0.19
215	Valero Energy Corp.	Valero 能源	VLO US	美国纽约证券交易所	美国	1,975	1,900,461.55	0.19
216	W. W. Grainger Inc.	固安捷股份有限公司	GWW US	美国纽约证券交易所	美国	255	1,898,898.83	0.19
217	CDW Corporation	特拉华 CDW 公司	CDW US	纳斯达克证券交易所	美国	1,484	1,897,226.29	0.19
218	The TJx Companies, Inc.	TJX 公司	TJX US	美国纽约证券交易所	美国	2,144	1,895,329.26	0.19
219	Maste rcard Inc.	万事达股份有限公司	MA US	美国纽约证券交易所	美国	471	1,894,693.44	0.19
220	Aptiv PLC	安波福公共有限公司	APT V US	美国纽约证券交易所	美国	3,879	1,894,347.25	0.19
221	STERI	思泰瑞	STE US	美国纽	美国	1,101	1,893,322.42	0.19

	S plc	医疗公共有限公司		约 证 券 交 易 所				
222	American Tower Corp.	美国发射塔公司	AMT US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,196	1,892,303.75	0.19
223	NXP Semiconductors N.V.	恩智浦半导体公司	NXPI US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,209	1,890,975.76	0.19
224	Fifth Third Bancorp	五三银行	FITB US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	6,419	1,889,966.83	0.19
225	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd.	挪威邮轮控股有限公司	NCLH US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	13,010	1,888,745.07	0.19
226	Visa Inc.	维萨公司	V US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	743	1,888,454.07	0.19
227	American International Group Inc.	美国国际集团	AIG US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,077	1,885,291.97	0.19
228	Costco Wholesale Corporation	开市客	COST US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	266	1,885,031.47	0.19
229	Cincinnati Financial Corp.	辛辛那提金融	CINF US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,767	1,883,725.74	0.19

230	Blackstone Inc.	黑石集团股份有限公司	BX US	美国纽约证券交易所	美国	1,759	1,883,507.98	0.19
231	CVS Health Corporation	CVS 健康公司	CVS US	美国纽约证券交易所	美国	3,814	1,883,354.07	0.19
232	Centropoint Energy Inc.	中点能源	CNP US	美国纽约证券交易所	美国	7,158	1,882,603.85	0.19
233	The Cigna Group	信诺集团	CI US	美国纽约证券交易所	美国	795	1,881,359.54	0.19
234	Lockheed Martin Corp.	洛克希德马丁	LMT US	美国纽约证券交易所	美国	567	1,879,851.08	0.19
235	Travelers Companies Inc.	旅行家集团	TRV US	美国纽约证券交易所	美国	981	1,878,822.82	0.19
236	Paychex Inc.	Paychex 公司	PAYX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,804	1,878,487.08	0.19
237	Public Service Enterprise Group Incorporated	公共服务企业集团	PEG US	美国纽约证券交易所	美国	3,108	1,872,914.83	0.19
238	MSCI Inc.	MSCI 明晟	MSCI US	美国纽约证券交易所	美国	453	1,870,278.89	0.19
239	Ecolab	艺康集	ECL US	美国纽	美国	969	1,869,019.98	0.19

	b Inc.	团		约 证 券 交 易 所				
240	Teledyne Technologies Incorporated	Teledyne 科技股份有限公司	TDY US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	509	1,866,717.98	0.19
241	First Energy Corp	第一能源	FE US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	6,472	1,865,264.29	0.19
242	Xylem Inc.	赛莱默公司	XYL US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	2,013	1,864,111.47	0.19
243	Dominion Energy, Inc.	Dominion 能源股份有限公司	D US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	4,604	1,862,797.15	0.19
244	Apollon Global Management, Inc.	阿波罗全球管理股份有限公司	APO US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,833	1,861,577.54	0.19
245	Northrop Grumman Corp.	诺斯洛普格鲁门公司	NOC US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	520	1,861,161.55	0.18
246	Atmos Energy Corporation	Atmos 能源公司	ATO US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,680	1,853,395.90	0.18
247	Northern Corporation	诺信公司	NDSN US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,207	1,852,249.02	0.18
248	CoStar	CoStar	CSGP	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	3,217	1,851,548.98	0.18

	r Group, Inc.	集团股份有限公司	US	克 证 券 交 易 所				
249	Airbnb, Inc.	爱彼迎股份有限公司	ABNB US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,954	1,851,159.27	0.18
250	Henry Schein Inc.	亨利香恩公司	HSIC US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	3,536	1,849,100.74	0.18
251	Abbott Laboratories	雅培制药	ABT US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,898	1,847,970.97	0.18
252	Welltower Inc.	Welltower 股份有限公司	WELL US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,678	1,846,624.87	0.18
253	QUALCOMM Inc.	高通公司	QCOM US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,618	1,844,647.23	0.18
254	Tyler Technologies, Inc.	Tyler 科技公司	TYL US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	434	1,841,854.52	0.18
255	Jack Henry & Associates, Inc.	Jack Henry & Associates 公司	JKHY US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,428	1,841,784.37	0.18
256	FactSet Research Systems Inc.	FactSet 研究系统股份有限公司	FDS US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	575	1,841,091.70	0.18
257	Linde plc (Ireland)	Linde 公司	LIN US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	548	1,840,552.23	0.18
258	Evergy	Evergy 股份有	EVRG US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	3,730	1,840,539.77	0.18

	Inc.	限公司		交易所				
259	Caesars Entertainment, Inc.	凯撒娱乐集团	CZR US	纳斯达克证券交易所	美国	9,053	1,839,865.22	0.18
260	Dayforce, Inc.	Dayforce 股份有限公司	DAY US	美国纽约证券交易所	美国	4,637	1,838,639.38	0.18
261	Mondelez International Inc.	亿滋国际	MDLZ US	纳斯达克证券交易所	美国	3,806	1,837,445.40	0.18
262	Expedia Group, Inc.	亿客行集团股份有限公司	EXPE US	纳斯达克证券交易所	美国	1,521	1,836,626.74	0.18
263	Teradyne Inc.	泰瑞达	TER US	纳斯达克证券交易所	美国	2,851	1,835,192.44	0.18
264	Autozone Inc.	Autozone 股份有限公司	AZO US	美国纽约证券交易所	美国	69	1,833,631.51	0.18
265	Southern Company	南方公司	SO US	美国纽约证券交易所	美国	2,789	1,833,416.75	0.18
266	Hormel Foods Corp.	荷美尔食品有限公司	HRL US	美国纽约证券交易所	美国	8,464	1,832,859.31	0.18
267	T. Rowe Price Group Inc.	普徠仕	TROW US	纳斯达克证券交易所	美国	2,651	1,831,323.79	0.18
268	Invesco Ltd.	景顺有限公司	IVZ US	美国纽约证券交易所	美国	16,218	1,830,868.22	0.18
269	NiSource	NiSource	NI US	美国纽	美国	6,335	1,829,408.15	0.18

	rce Inc.	ce 公 司		约 证 券 交 易 所				
270	Sysco Corp.	Sysco 公司	SYU US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	3,358	1,820,681.96	0.18
271	Fair Isaac Corpo ratio n	费 埃 哲 公 司	FICO US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	139	1,818,903.19	0.18
272	Gener al Motor s Compa ny	通 用 汽 车 公 司	GM US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	5,163	1,818,794.31	0.18
273	Waste Manag ement Inc.	废 品 管 理	WM US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,109	1,816,576.21	0.18
274	Domin o's Pizza Inc.	达 美 乐 披 萨 公 司	DPZ US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	563	1,816,049.49	0.18
275	Walgr eens Boots Allia nce, I nc.	沃 博 联 股 份 有 限 公 司	WBA US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	22,083	1,814,797.02	0.18
276	PPG Indus tries Inc.	PPG 工 业	PPG US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	2,228	1,814,239.79	0.18
277	Solve ntum Corpo ratio n	Solven tum 公 司	SOLV US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	3,341	1,813,856.38	0.18
278	Realt y Incom e Corpo ratio	Realty Income 公 司	O US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	4,387	1,809,229.27	0.18

	n							
279	Arch Capital Group Ltd.	阿契资本集团	ACGL US	纳斯达克证券交易所	美国	2,774	1,808,066.93	0.18
280	Ingersoll Rand Inc.	英格索兰股份有限公司	IR US	美国纽约证券交易所	美国	3,035	1,807,197.88	0.18
281	AMETEK, Inc.	阿美特克股份有限公司	AME US	美国纽约证券交易所	美国	1,395	1,807,111.26	0.18
282	Chubb Limited	邱博保险集团	CB US	美国纽约证券交易所	美国	870	1,804,370.95	0.18
283	Exelon Corp.	Exelon 公司	EXC US	纳斯达克证券交易所	美国	5,804	1,804,036.50	0.18
284	Motorola Solutions, Inc.	摩托罗拉解决方案股份有限公司	MSI US	美国纽约证券交易所	美国	599	1,802,933.07	0.18
285	Pulte group, Inc.	Pulte 集团公司	PHM US	美国纽约证券交易所	美国	2,388	1,802,810.94	0.18
286	Las Vegas Sands Corp.	拉斯维加斯金沙公司	LVS US	美国纽约证券交易所	美国	5,780	1,800,300.57	0.18
287	Host Hotels & Resorts Inc.	Host 酒店及度假股份有限公司	HST US	纳斯达克证券交易所	美国	16,368	1,799,761.38	0.18
288	Verizon Communications Inc.	Verizon 通信股份有限公司	VZ US	美国纽约证券交易所	美国	5,807	1,798,733.48	0.18
289	VICI	VICI	VICI	美国纽	美国	7,707	1,798,585.36	0.18



	Properties Inc.	Properties 股份有限公司	US	约 证 券 交 易 所				
290	Globe Life Inc.	Globe Life 股份有限公司	GL US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	2,021	1,798,169.38	0.18
291	MetLife Inc.	大都会集团	MET US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	3,123	1,797,894.27	0.18
292	The Allstate Corporation	好事达 保险公司	ALL US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,247	1,797,048.91	0.18
293	Comcast Corp.	康卡斯特公司	CMCSA US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	7,028	1,795,586.77	0.18
294	Altria Group Inc.	高特利	MO US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	4,278	1,795,513.90	0.18
295	3m Company	3M 公司	MMM US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,646	1,793,852.38	0.18
296	Prudential Financial, Inc.	保德信 金融集团	PRU US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	2,331	1,792,818.68	0.18
297	Coca-Cola Co	可口可 乐	KO US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	3,536	1,790,881.28	0.18
298	Duke Energy Corp.	杜克能 源	DUK US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	2,120	1,790,795.38	0.18
299	Lamb Weston Holdings, Inc.	蓝威斯 顿控股 股份有 限公司	LW US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	4,820	1,789,055.84	0.18

300	Ross Stores Inc.	罗斯百货股份有限公司	ROST US	纳斯达克证券交易所	美国	1,954	1,784,576.84	0.18
301	DTE Energy Co.	DTE 能源	DTE US	美国纽约证券交易所	美国	1,882	1,784,565.39	0.18
302	Tractor Supply Company	拖拉机供应公司	TSCO US	纳斯达克证券交易所	美国	4,723	1,784,157.28	0.18
303	American Electric Power Co. Inc.	美国电力	AEP US	纳斯达克证券交易所	美国	2,402	1,784,148.76	0.18
304	Keurig Dr Pepper Inc.	Keurig Dr Pepper 有限公司	KDP US	纳斯达克证券交易所	美国	7,538	1,783,968.08	0.18
305	Dover Corp.	都福	DOV US	美国纽约证券交易所	美国	1,360	1,783,871.58	0.18
306	Aflac Inc.	家庭人寿保险	AFL US	美国纽约证券交易所	美国	2,362	1,783,182.35	0.18
307	Kimco Realty Corp.	Kimco Realty 公司	KIM US	美国纽约证券交易所	美国	11,850	1,783,114.20	0.18
308	Lennox International, Inc.	雷诺士国际有限公司	LII US	美国纽约证券交易所	美国	434	1,780,960.60	0.18
309	Entergy Corp.	Entergy 公司	ETR US	美国纽约证券交易所	美国	2,992	1,780,308.31	0.18
310	Incyt	因赛特	INCY	纳斯达克	美国	3,651	1,779,864.91	0.18

	e Corpo ratio n	公司	US	克 证 券 交 易 所				
311	Home Depot Inc.	家得宝	HD US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	678	1,779,498.53	0.18
312	Match Group , Inc.	Match 集团股 份有限 公司	MTCH US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	8,045	1,778,984.04	0.18
313	D. R. Horto n Inc.	霍顿房 屋公司	DHI US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,922	1,773,788.26	0.18
314	Akama i Techn ologi es Inc.	阿卡迈 技术公 司	AKAM US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	3,104	1,772,290.68	0.18
315	Colga te-pa lmoli ve Compa ny	高露洁 棕榄	CL US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,723	1,771,901.68	0.18
316	Genui ne Parts Co.	原配部 件	GPC US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,038	1,769,819.10	0.18
317	Roper Techn ologi es, In c.	儒博技 术公司	ROP US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	436	1,769,192.44	0.18
318	DaVit a Inc.	DaVita 股份有 限公司	DVA US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,734	1,768,233.62	0.18
319	Smith (A.O.) Corpo ratio n	AO 史 密斯公 司	AOS US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,767	1,768,189.88	0.18
320	PPL	PPL 公	PPL US	美 国 纽	美国	7,280	1,766,164.07	0.18

	Corp.	司		约 证 券 交 易 所				
321	C. H. Robin son World wide, Inc.	罗 宾 逊 全 球 物 流 有 限 公 司	CHRW US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,571	1,765,936.78	0.18
322	WEC Energ y Group , Inc.	WEC 能 源 集 团 股 份 有 限 公 司	WEC US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	2,361	1,761,131.57	0.18
323	Corpa y, Inc.	Corpay 股 份 有 限 公 司	CPAY US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	740	1,757,771.32	0.17
324	Workd ay, Inc.	Workda y 股 份 有 限 公 司	WDAY US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,023	1,757,579.47	0.17
325	Invit ation Homes Inc.	邀 请 家 园 公 司	INVH US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	7,472	1,754,441.14	0.17
326	Otis World wide Corp	奥 的 斯 电 梯 公 司	OTIS US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	2,475	1,754,390.32	0.17
327	Avery Denni son Corp.	艾 利 丹 尼 森	AVY US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,396	1,753,542.88	0.17
328	Nucor Corpo ratio n	纽 柯 公 司	NUE US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,890	1,752,644.33	0.17
329	Regen cy Cente rs Corpo ratio n	Regenc y Center s 公 司	REG US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	3,435	1,751,530.81	0.17
330	Cummi ns	康 明 斯	CMI US	美 国 纽 约 证 券	美 国	747	1,751,297.80	0.17

	Inc.			交易所				
331	Xcel Energy Inc.	Xcel 能源	XEL US	纳斯达克证券交易所	美国	3,592	1,751,102.37	0.17
332	Extra Space Storage Inc.	Extra Space Storage 有限公司	EXR US	美国纽约证券交易所	美国	1,657	1,748,903.82	0.17
333	Exxon Mobil Corp.	埃克森美孚石油公司	XOM US	美国纽约证券交易所	美国	2,266	1,748,665.58	0.17
334	American Water Works Company, Inc.	美国自来水股份有限公司	AWK US	美国纽约证券交易所	美国	1,755	1,747,686.64	0.17
335	Old Dominion Freight Line, Inc.	Old Dominion Freight Line 股份有限公司	ODFL US	纳斯达克证券交易所	美国	1,503	1,746,246.69	0.17
336	Ameren Corp	Ameren 公司	AEE US	美国纽约证券交易所	美国	2,538	1,744,905.31	0.17
337	NVR, Inc.	NVR 股份有限公司	NVR US	美国纽约证券交易所	美国	33	1,744,742.53	0.17
338	Agilent Technologies, Inc.	安捷伦	A US	美国纽约证券交易所	美国	2,063	1,742,794.31	0.17
339	Equinix, Inc.	Equinix 有限公司	EQIX US	纳斯达克证券交易所	美国	306	1,742,502.17	0.17
340	Illinois Tool Works	伊利诺伊工具股份有限公司	ITW US	美国纽约证券交易所	美国	984	1,741,644.43	0.17

	Inc.							
341	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	760	1,741,624.38	0.17
342	The Sherwin-Williams Company	宣伟公司	SHW US	美国纽约证券交易所	美国	707	1,737,789.67	0.17
343	Cognizant Technology Solutions Corp	高知特科技解决方案公司	CTSH US	纳斯达克证券交易所	美国	3,111	1,737,759.67	0.17
344	Pinnacle West Capital Corp.	Pinnacle 西部资本	PNW US	美国纽约证券交易所	美国	2,711	1,736,341.12	0.17
345	Humana Inc.	Humana 股份有限公司	HUM US	美国纽约证券交易所	美国	992	1,736,133.45	0.17
346	Assurant Inc.	安信龙集团	AIZ US	美国纽约证券交易所	美国	1,226	1,733,259.85	0.17
347	Equity Residential	公寓物业权益信托	EQR US	美国纽约证券交易所	美国	3,586	1,732,518.22	0.17
348	Berkshire Hathaway Inc.	伯克希尔哈撒韦公司	BRK/B US	美国纽约证券交易所	美国	498	1,731,761.69	0.17
349	Federal Realty	联邦房地产投资信托	FRT US	美国纽约证券交易所	美国	2,546	1,731,268.32	0.17

	y Investment Trust	公司						
350	Consolidated Edison Inc.	联合爱迪生	ED US	美国纽约证券交易所	美国	2,409	1,730,542.51	0.17
351	Everest Group, Ltd.	Everest 集团有限公司	EG US	美国纽约证券交易所	美国	711	1,729,756.50	0.17
352	West Pharmaceutical Services, Inc.	西氏医药服务公司	WST US	美国纽约证券交易所	美国	1,103	1,727,630.75	0.17
353	McDonald's Corp.	麦当劳	MCD US	美国纽约证券交易所	美国	826	1,727,602.26	0.17
354	Expeditors International of Washington Inc.	华盛顿康捷国际物流公司	EXPD US	美国纽约证券交易所	美国	2,112	1,727,341.55	0.17
355	Smurfit WestRock plc	Smurfit WestRock 公共有限公司	SW US	美国纽约证券交易所	美国	5,589	1,726,406.27	0.17
356	CMS Energy Corp.	CMS 能源	CMS US	美国纽约证券交易所	美国	3,474	1,722,922.68	0.17
357	Alliant Energy	Alliant 能源公司	LNT US	纳斯达克证券交易所	美国	3,977	1,721,565.92	0.17

	Corporation							
358	Gilead Sciences Inc.	吉利德科学	GILD US	纳斯达克证券交易所	美国	2,169	1,721,478.87	0.17
359	Lowe's Companies Inc.	劳氏	LOW US	美国纽约证券交易所	美国	1,083	1,720,105.70	0.17
360	Hershey Co	好时公司	HSY US	美国纽约证券交易所	美国	1,446	1,717,804.14	0.17
361	Simon Property Group Inc.	西蒙房地产集团公司	SPG US	美国纽约证券交易所	美国	1,491	1,715,867.46	0.17
362	Avalonbay Communities Inc.	Avalon Bay 社区股份有限公司	AVB US	美国纽约证券交易所	美国	1,177	1,714,624.29	0.17
363	Union Pacific Corporation	联合太平洋	UNP US	美国纽约证券交易所	美国	1,041	1,714,579.77	0.17
364	Principal Financial Group, Inc.	信安金融	PFG US	纳斯达克证券交易所	美国	3,015	1,714,351.91	0.17
365	Garmin Ltd	佳明有限公司	GRMN US	美国纽约证券交易所	美国	1,147	1,713,782.01	0.17
366	Essex Property Trust	埃塞克斯房地产信托公司	ESS US	美国纽约证券交易所	美国	844	1,712,262.67	0.17



	Inc.							
367	Public Storage	公共存储	PSA US	美国纽约证券交易所	美国	815	1,711,888.28	0.17
368	Viatris Inc.	晖致	VTRS US	纳斯达克证券交易所	美国	26,767	1,711,115.22	0.17
369	Kellanova	Kellanova 公司	K US	美国纽约证券交易所	美国	3,005	1,710,816.99	0.17
370	NIKE Inc.	耐克公司	NKE US	美国纽约证券交易所	美国	3,361	1,709,226.28	0.17
371	IDEX Corporation	艺达思集团	IEX US	美国纽约证券交易所	美国	1,359	1,708,039.31	0.17
372	Mettler-Toledo International, Inc.	梅特勒-托利多国际股份有限公司	MTD US	美国纽约证券交易所	美国	203	1,707,098.17	0.17
373	Zoetis Inc.	硕腾股份有限公司	ZTS US	美国纽约证券交易所	美国	1,529	1,706,950.63	0.17
374	Danaher Corp.	丹纳赫	DHR US	美国纽约证券交易所	美国	1,206	1,705,416.47	0.17
375	EOG Resources Inc.	EOG 资源	EOG US	美国纽约证券交易所	美国	1,990	1,703,917.89	0.17
376	Phillips 66	菲利普 66	PSX US	美国纽约证券交易所	美国	1,994	1,702,917.83	0.17
377	Hess Corp.	赫斯公司	HES US	美国纽约证券交易所	美国	1,717	1,702,838.95	0.17
378	Progressive Corp	前进保险公司	PGR US	美国纽约证券交易所	美国	891	1,702,116.50	0.17

379	YUM! BRAND S INC.	百胜餐 饮集团	YUM US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,601	1,698,278.92	0.17
380	Sales force , Inc.	Salesf orce 股份有 限公司	CRM US	美国纽 约证券 交易所	美国	869	1,696,356.33	0.17
381	Air Produ cts and Chemi cals Inc.	空气产 品公司	APD US	美国纽 约证券 交易所	美国	839	1,694,070.81	0.17
382	Snap- On Inc.	实耐宝	SNA US	美国纽 约证券 交易所	美国	759	1,690,758.38	0.17
383	Packa ging Corpo ratio n of Ameri ca	美国包 装公司	PKG US	美国纽 约证券 交易所	美国	1,253	1,690,344.83	0.17
384	Willi s Tower s Watso n Publi c Limit ed Compa ny	韦莱韬 睿惠悦 公共有 限公司	WTW US	纳斯达 克证券 交易所	美国	770	1,689,465.39	0.17
385	Medtr onic plc	美敦力	MDT US	美国纽 约证券 交易所	美国	2,702	1,686,088.97	0.17
386	Nexte ra Ener gy Inc.	新纪元 能源公 司	NEE US	美国纽 约证券 交易所	美国	3,391	1,685,157.49	0.17
387	Venta s Inc.	Ventas 公司	VTR US	美国纽 约证券	美国	3,727	1,684,848.45	0.17

				交易所				
388	Camden Property Trust	Camden 房地产信托公司	CPT US	美国纽约证券交易所	美国	2,088	1,684,395.10	0.17
389	Marsh & McLennan Companies Inc.	Marsh & McLennan 股份有限公司	MMC US	美国纽约证券交易所	美国	1,076	1,684,108.18	0.17
390	UDR, Inc.	UDR 公司	UDR US	美国纽约证券交易所	美国	5,755	1,682,103.85	0.17
391	Procter & Gamble Co	宝洁	PG US	美国纽约证券交易所	美国	1,468	1,674,265.97	0.17
392	Eli Lilly & Co.	礼来	LLY US	美国纽约证券交易所	美国	300	1,674,103.04	0.17
393	Molina Healthcare Inc.	Molina Healthcare 股份有限公司	MOH US	美国纽约证券交易所	美国	785	1,674,049.35	0.17
394	Elevance Health, Inc.	Elevance 健康股份有限公司	ELV US	美国纽约证券交易所	美国	601	1,673,429.84	0.17
395	Brown & Brown, Inc.	Brown & Brown 股份有限公司	BRO US	美国纽约证券交易所	美国	2,108	1,673,064.75	0.17
396	Apple Inc.	苹果公司	AAPL US	纳斯达克证券交易所	美国	1,139	1,672,883.43	0.17
397	Pfizer Inc.	辉瑞制药	PFE US	美国纽约证券交易所	美国	9,620	1,669,305.34	0.17
398	Chevr	雪佛龙	CVX US	美国纽	美国	1,620	1,660,564.69	0.17

	on Corpo ratio n			约 证 券 交 易 所				
399	Johns on & Johns on	强生	JNJ US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,518	1,659,896.80	0.16
400	Diamon dbac k Ener gy, Inc.	Diamon dbac 能 源 股 份 有 限 公 司	FANG US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,687	1,659,319.10	0.16
401	Epam Syste ms, Inc.	EPAM 系 统 公 司	EPAM US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,307	1,654,379.23	0.16
402	Water s Corp.	沃 特 世 公 司	WAT US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	662	1,654,098.19	0.16
403	Willia ms-S onoma , Inc.	Willia ms-Son oma 股 份 有 限 公 司	WSM US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,414	1,653,673.68	0.16
404	FedEx Corp.	联 邦 快 递	FDX US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,015	1,651,629.69	0.16
405	Coterra Ener gy Inc.	Coterra 能 源 股 份 有 限 公 司	CTRA US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	9,083	1,650,247.29	0.16
406	T-Mobi le US, Inc.	T-Mobi le US 股 份 有 限 公 司	TMUS US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	967	1,649,322.97	0.16
407	APA Corpo ratio n	APA 公 司	APA US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	12,586	1,647,894.97	0.16
408	Targa Resou rces Corp.	Targa 资 源 公 司	TRGP US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,322	1,647,435.53	0.16

409	Edison International	爱迪生国际	EIX US	美国纽约证券交易所	美国	4,458	1,646,712.80	0.16
410	Tyson Foods Inc.	泰森食品公司	TSN US	美国纽约证券交易所	美国	4,112	1,646,658.97	0.16
411	Lennar Corp	Lennar 公司	LEN US	美国纽约证券交易所	美国	2,079	1,646,178.70	0.16
412	J. B. Hunt Transport Services, Inc.	JB Hunt 运输服务股份有限公司	JBHT US	纳斯达克证券交易所	美国	1,601	1,645,787.91	0.16
413	McCormick & Co Inc.	味好美股份有限公司	MKC US	美国纽约证券交易所	美国	3,032	1,645,663.64	0.16
414	The Interpublic Group of Companies, Inc.	Interpublic 集团	IPG US	美国纽约证券交易所	美国	9,386	1,644,826.37	0.16
415	PACCAR Inc.	帕卡	PCAR US	纳斯达克证券交易所	美国	2,416	1,644,079.58	0.16
416	Centene Corporation	Centene 公司	CNC US	美国纽约证券交易所	美国	4,231	1,644,034.63	0.16
417	Starbucks Corporation	星巴克	SBUX US	纳斯达克证券交易所	美国	2,506	1,643,791.95	0.16
418	CarMax	CarMax	KMX US	美国纽	美国	3,409	1,640,170.49	0.16

	x Inc.	股份有 限公司		约 证 券 交 易 所				
419	Amcor plc.	安姆科 公共有 限公司	AMCR US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	24,907	1,638,570.11	0.16
420	Copart, Inc.	Copart 股份有 限公司	CPRT US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	4,663	1,637,983.68	0.16
421	Inter natio nal Paper Co	国际纸 业	IP US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	4,885	1,637,633.91	0.16
422	Inter natio nal Flavo rs & Frag rances Inc.	国际香 料	IFF US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,109	1,636,935.23	0.16
423	Mohaw k Indus tries , Inc.	Mohawk 工业股 份有限 公司	MHK US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,180	1,636,106.62	0.16
424	Best Buy Co., Inc.	百思买	BBY US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,404	1,635,815.41	0.16
425	Kimbe rly-C lark Corp.	金佰利	KMB US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,767	1,630,740.82	0.16
426	Accen ture Plc	埃森哲 公司	ACN US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	762	1,630,401.07	0.16
427	Targe t Corp	塔吉特 公司	TGT US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,305	1,627,781.53	0.16
428	Conoc oPhil lips	康菲石 油	COP US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,530	1,625,304.29	0.16
429	Devon Energ	戴文能 源	DVN US	美 国 纽 约 证 券	美国	7,117	1,620,648.12	0.16

	y Corp.			交易所				
430	Mid-America Apartment Communities Inc.	MID-AMERICA APARTMENT COMM 公司	MAA US	美国纽约证券交易所	美国	1,528	1,618,983.82	0.16
431	Occidental Petroleum Corp	西方石油	OXY US	美国纽约证券交易所	美国	5,365	1,613,431.40	0.16
432	ProLogis, Inc.	安博	PLD US	美国纽约证券交易所	美国	2,137	1,608,118.21	0.16
433	DuPont de Nemours, Inc.	杜邦公司	DD US	美国纽约证券交易所	美国	3,275	1,608,052.42	0.16
434	Kenvue Inc.	Kenvue 公司	KVUE US	美国纽约证券交易所	美国	10,720	1,606,172.22	0.16
435	Masco Corp.	马斯可	MAS US	美国纽约证券交易所	美国	3,477	1,601,949.50	0.16
436	Baker Hughes Company	贝克休斯公司	BKR US	纳斯达克证券交易所	美国	5,822	1,597,910.34	0.16
437	Builders FirstSource, Inc.	Builders FirstSource 股份有限公司	BLDR US	美国纽约证券交易所	美国	1,910	1,595,493.73	0.16
438	The Cooper Companies,	库柏股份有限公司	COO US	纳斯达克证券交易所	美国	3,127	1,592,912.49	0.16

	Inc.							
439	Omnicom Group Inc.	Omnicom 集团	OMC US	美国纽约证券交易所	美国	3,091	1,591,833.11	0.16
440	Vertex Pharmaceuticals Inc.	福泰制药	VRTX US	纳斯达克证券交易所	美国	499	1,590,317.35	0.16
441	Biogen Inc.	渤健公司	BIIB US	纳斯达克证券交易所	美国	1,764	1,585,921.68	0.16
442	Aon Plc	怡安公共有限公司	AON US	美国纽约证券交易所	美国	620	1,583,419.32	0.16
443	Amgen Inc.	安进公司	AMGN US	纳斯达克证券交易所	美国	791	1,581,013.39	0.16
444	PepsiCo, Inc.	百事可乐	PEP US	纳斯达克证券交易所	美国	1,669	1,577,574.76	0.16
445	The AES Corporation	爱伊斯科公司	AES US	美国纽约证券交易所	美国	20,907	1,574,474.22	0.16
446	Charles River Laboratories International, Inc.	查里斯河实验室国际有限公司	CRL US	美国纽约证券交易所	美国	1,449	1,573,866.67	0.16
447	Constellation Brands Inc.	星座品牌股份有限公司	STZ US	美国纽约证券交易所	美国	1,345	1,566,334.61	0.16
448	The J.M.	JM 斯马克公	SJM US	美国纽约证	美国	2,227	1,565,524.26	0.16



	Smucker Company	司		交易所				
449	GE HealthCare Technologies Inc.	GE HealthCare Technologies 公司	GEHC US	纳斯达克证券交易所	美国	2,951	1,564,730.87	0.16
450	Church & Dwight Company, Inc.	切迟杜威股份有限公司	CHD US	美国纽约证券交易所	美国	2,268	1,560,413.59	0.16
451	Adobe Inc.	奥多比	ADBE US	纳斯达克证券交易所	美国	563	1,559,239.29	0.15
452	Baxter International Inc.	百特	BAX US	美国纽约证券交易所	美国	7,187	1,557,871.43	0.15
453	Oneok Inc.	Oneok 股份有限公司	OKE US	美国纽约证券交易所	美国	2,660	1,554,388.34	0.15
454	Gartner, Inc.	Gartner 公司	IT US	美国纽约证券交易所	美国	537	1,553,889.67	0.15
455	Weyerhaeuser Co.	惠好	WY US	美国纽约证券交易所	美国	8,449	1,553,808.56	0.15
456	Zimmer Biomet Holdings, Inc.	捷迈邦美控股股份有限公司	ZBH US	美国纽约证券交易所	美国	2,377	1,552,028.65	0.15
457	United	联合包裹服务	UPS US	美国纽约证券交易所	美国	2,145	1,549,953.59	0.15

	Parcel Service Inc.	股份有限公司		交易所				
458	Abbvie Inc.	艾伯维股份有限公司	ABBV US	美国纽约证券交易所	美国	1,166	1,549,356.70	0.15
459	Pool Corporation	Pool 公司	POOL US	纳斯达克证券交易所	美国	741	1,546,162.25	0.15
460	LKQ Corporation	LKQ 公司	LKQ US	纳斯达克证券交易所	美国	5,814	1,540,359.92	0.15
461	Revvity, Inc.	Revvity 股份有限公司	RVTY US	美国纽约证券交易所	美国	2,217	1,535,006.00	0.15
462	Healthpeak Properties, Inc.	Healthpeak Properties 公司	DOC US	美国纽约证券交易所	美国	12,244	1,534,749.72	0.15
463	General Mills, Inc.	通用磨坊	GIS US	美国纽约证券交易所	美国	4,120	1,528,054.71	0.15
464	Global Payments Inc.	环汇有限公司	GPN US	美国纽约证券交易所	美国	2,662	1,525,257.70	0.15
465	Albemarle Corporation	雅保公司	ALB US	美国纽约证券交易所	美国	3,396	1,523,545.65	0.15
466	PG&E Corporation	太平洋煤气电力	PCG US	美国纽约证券交易所	美国	15,248	1,521,611.40	0.15
467	HP Inc.	惠普	HPQ US	美国纽约证券交易所	美国	8,687	1,521,088.11	0.15

				交易所				
468	Bio-Techne Corporation	Bio-technne 公司	TECH US	纳斯达克证券交易所	美国	4,106	1,512,280.74	0.15
469	The Kraft Heinz Company	卡夫亨氏公司	KHC US	纳斯达克证券交易所	美国	8,162	1,508,623.69	0.15
470	IQVIA Holdings Inc.	艾昆纬	IQV US	美国纽约证券交易所	美国	1,333	1,503,788.99	0.15
471	Merck & Co., Inc.	默克	MRK US	美国纽约证券交易所	美国	2,649	1,501,121.48	0.15
472	Deckers Outdoor Corporation	德克斯户外用品公司	DECK US	美国纽约证券交易所	美国	2,034	1,500,760.26	0.15
473	Schlumberger NV	斯伦贝谢公众有限公司	SLB US	美国纽约证券交易所	美国	6,175	1,494,107.20	0.15
474	Stanley Black & Decker Inc.	史丹利百得公司	SWK US	美国纽约证券交易所	美国	3,047	1,477,780.22	0.15
475	News Corp	新闻集团	NWSA US	纳斯达克证券交易所	美国	6,900	1,467,999.78	0.15
476	Erie Indemnity Company	伊利赔偿公司	ERIE US	纳斯达克证券交易所	美国	590	1,464,693.23	0.15
477	Halli	哈利伯	HAL US	美国纽	美国	10,009	1,460,235.71	0.15

	burton Co	顿		约 证 券 交 易 所				
478	Fiserv Inc.	Fiserv 股份有限公司	FI US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,170	1,444,030.64	0.14
479	The Clorox Co.	高乐氏公司	CLX US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,676	1,440,577.48	0.14
480	Molson Coors Beverage Company	莫尔森库尔斯饮料公司	TAP US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	4,165	1,433,830.71	0.14
481	Eastman Chemical Co.	伊士曼化工	EMN US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	2,676	1,430,217.84	0.14
482	Lyondellbasell Industries N.v.	利安德巴塞尔工业公司	LYB US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	3,426	1,419,037.54	0.14
483	The Campbell's Company	金宝汤公司	CPB US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	6,410	1,406,425.09	0.14
484	Thermo Fisher Scientific Inc.	Thermo Fisher Scientific 公司	TMO US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	482	1,399,017.51	0.14
485	Conagra Brands, Inc.	康尼格拉品牌股份有限公司	CAG US	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	9,545	1,398,691.29	0.14
486	M Moderna, Inc.	莫德纳公司	MRNA US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	7,064	1,395,180.79	0.14

	c.			交易所				
487	Brown-Forman Corporation	百富门公司	BF/US	美国纽约证券交易所	美国	7,231	1,392,964.84	0.14
488	Texas Pacific Land Corporation	德克萨斯州太平洋土地公司	TPL US	美国纽约证券交易所	美国	183	1,383,896.04	0.14
489	Bristol-Myers Squibb Co.	百时美施贵宝公司	BMY US	美国纽约证券交易所	美国	4,135	1,370,221.54	0.14
490	Becton, Dickinson & Co.	碧迪	BDX US	美国纽约证券交易所	美国	1,105	1,362,541.08	0.14
491	Regeneron Pharmaceuticals, Inc.	再生元制药股份有限公司	REGN US	纳斯达克证券交易所	美国	358	1,345,458.87	0.13
492	lululemon athletica inc.	Lululemon Athletica 股份有限公司	LULU US	纳斯达克证券交易所	美国	781	1,328,278.09	0.13
493	Dow Inc.	陶氏公司	DOW US	美国纽约证券交易所	美国	6,918	1,311,374.20	0.13
494	Alexandria Real Estate Equit	亚历山大房地产股份有限公司	ARE US	美国纽约证券交易所	美国	2,510	1,305,022.09	0.13

	ies, Inc.							
495	Coinbase Global, Inc.	Coinbase 全球股份有限公司	COIN US	纳斯达克证券交易所	美国	500	1,254,508.86	0.12
496	Fortive Corporation	福迪威公司	FTV US	美国纽约证券交易所	美国	3,347	1,249,026.16	0.12
497	Fox Corporation	福克斯公司	FOXA US	纳斯达克证券交易所	美国	3,029	1,215,137.70	0.12
498	Enphase Energy, Inc.	Enphase 能源股份有限公司	ENPH US	纳斯达克证券交易所	美国	4,229	1,200,352.97	0.12
499	UnitedHealth Group Inc.	联合健康集团	UNH US	美国纽约证券交易所	美国	514	1,147,899.98	0.11
500	Alphabet Inc.	Alphabet 公司	GOOGL US	纳斯达克证券交易所	美国	813	1,025,648.34	0.10
501	Alphabet Inc.	Alphabet 公司	GOOG US	纳斯达克证券交易所	美国	659	836,840.41	0.08
502	Fox Corporation	福克斯公司	FOX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,834	677,843.68	0.07
503	News Corp	新闻集团	NWS US	纳斯达克证券交易所	美国	2,038	500,556.37	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

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（%）
----	----------	----------	------	--------	----------	-------	------	--------------

	文)							
1	Ralliant Corporation	Ralliant 公司	RAL US	美国纽约证券交易所	美国	1,115	387,039.37	0.04

## 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	Expand Energy Corporation	EXE US	2,241,564.65	0.27
2	DoorDash, Inc.	DASH US	2,175,946.46	0.26
3	TKO Group Holdings, Inc.	TKO US	2,139,756.49	0.26
4	Williams-Sonoma, Inc.	WSM US	2,005,891.38	0.24
5	Capital One Financial Corp	COF US	2,005,125.68	0.24
6	Tesla, Inc.	TSLA US	1,348,807.84	0.16
7	Coinbase Global, Inc.	COIN US	1,259,877.81	0.15
8	ON Semiconductor Corporation	ON US	1,224,184.04	0.15
9	Western Digital Corp.	WDC US	1,208,688.23	0.15
10	Hewlett Packard Enterprise Company	HPE US	1,197,936.64	0.14
11	Deckers Outdoor Corporation	DECK US	1,197,475.24	0.14
12	Dayforce, Inc.	DAY US	1,170,013.17	0.14
13	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd.	NCLH US	1,164,401.60	0.14
14	Delta Air Lines, Inc.	DAL US	1,139,541.15	0.14
15	United Airlines Holdings, Inc.	UAL US	1,128,129.67	0.14
16	Align Technology, Inc.	ALGN US	1,102,548.31	0.13
17	Teradyne Inc.	TER US	1,101,522.33	0.13
18	Arista Networks, Inc.	ANET US	1,080,657.49	0.13

19	Carnival Corporation	CCL US	1,073,872.44	0.13
20	Lamb Weston Holdings, Inc.	LW US	1,072,129.41	0.13

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	CELANESE CORP	CE US	1,904,355.92	0.23
2	BORGWARNER INC	BWA US	1,836,816.90	0.22
3	TELEFLEX INC	TFX US	1,657,587.91	0.20
4	FMC CORP	FMC US	1,617,463.53	0.19
5	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	DFS US	1,518,944.75	0.18
6	CVS Health Corporation	CVS US	1,010,794.68	0.12
7	Gilead Sciences Inc.	GILD US	866,038.88	0.10
8	Palantir Technologies Inc.	PLTR US	863,215.65	0.10
9	Abbvie Inc.	ABBV US	834,030.62	0.10
10	Philip Morris International Inc.	PM US	808,126.90	0.10
11	General Electric Company	GE US	800,215.84	0.10
12	Exelon Corp.	EXC US	792,181.16	0.10
13	Globe Life Inc.	GL US	791,454.36	0.09
14	Uber Technologies, inc.	UBER US	788,953.92	0.09
15	Darden Restaurants Inc.	DRI US	758,292.88	0.09
16	Arthur J. Gallagher & Co.	AJG US	749,067.12	0.09
17	Tapestry, Inc.	TPR US	724,463.08	0.09
18	Abbott Laboratories	ABT US	717,499.00	0.09
19	Howmet Aerospace Inc.	HWM US	709,394.43	0.09
20	Amgen Inc.	AMGN US	697,684.41	0.08

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	326,657,325.54
卖出收入（成交）总额	168,701,888.47

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	4,589,018.45
3	应收股利	904,336.18
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,551,876.20
6	其他应收款	149,223.24
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	7,194,454.07

#### 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	107,272	2,980.43	76,847,176.09	24.04	242,869,470.25	75.96
大成标普 500 等权 重指 数 (QDII)C	87,175	780.03	3,352,897.90	4.93	64,646,106.29	95.07
合计	194,447	1,993.94	80,200,073.99	20.69	307,515,576.54	79.31

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	大成标普 500 等权重指数	45,561.87	0.0143

理人所有从业人员持有本基金	(QDII)A		
	大成标普 500 等权重指数 (QDII)C	20,389.58	0.0300
	合计	65,951.45	0.0170

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	285,403,996.15	36,580,649.22
本报告期基金总申购份额	186,195,452.69	99,984,122.24
减：本报告期基金总赎回份额	151,882,802.50	68,565,767.27
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	319,716,646.34	67,999,004.19

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，聘任边济东先生为资产托管部总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 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

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，自 2024 年 12 月 11 日起，改聘容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务至今。

### 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	1	381,090,896.	77.36	146,924.68	83.42	-

Stanley		25				
CLSA Limited	1	111,507,674. 76	22.64	29,209.03	16.58	-
Daiwa Capital Markets Hong Kong Limited	1	-	-	-	-	-

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

#### （一）筛选标准

大成基金管理有限公司（以下简称“公司”）严格按照《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》要求制定了证券公司筛选标准，建立了证券公司尽职调查、证券公司负面筛查、备选池筛选机制，选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易。

#### （二）筛选流程

1、经公司尽调符合条件的证券公司进入备选池，由股票投委会以公平、公正、公开为原则，结合定性及定量办法科学评估证券公司研究服务能力，形成证券公司白名单，并定期及不定期进行动态调整。

2、公司按照白名单与证券公司进行协议签署。

### 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	大成基金管理有限公司关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025年6月30日
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	2025年6月30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	2025年6月30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	2025年6月30日
5	大成标普 500 等权重指数证券投资基	中国证监会基金电子披	2025年6月30日

	金(人民币 A 类份额)基金产品资料概要更新	露网站、规定报刊及本公司网站	
6	关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金调整大额申购(含定期定额申购)业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 6 月 30 日
7	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 6 月 6 日
8	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 4 月 26 日
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	2025 年 4 月 23 日
10	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 4 月 22 日
11	关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金调整大额申购(含定期定额申购)业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 4 月 8 日
12	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2024 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 31 日
13	大成基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况(2024 年度)	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 31 日
14	大成标普 500 等权重指数证券投资基金(人民币 C 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 21 日
15	大成标普 500 等权重指数证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 21 日
16	大成标普 500 等权重指数证券投资基金(人民币 A 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 21 日
17	大成标普 500 等权重指数证券投资基金(美元 C 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 21 日
18	大成标普 500 等权重指数证券投资基金(美元 A 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 21 日
19	大成标普 500 等权重指数证券投资基金托管协议	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 20 日

20	大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 20 日
21	关于大成基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 3 月 19 日
22	大成标普 500 等权重指数证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 2 月 28 日
23	大成标普 500 等权重指数证券投资基金(美元 C 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 2 月 28 日
24	大成标普 500 等权重指数证券投资基金(人民币 A 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 2 月 28 日
25	大成标普 500 等权重指数证券投资基金(人民币 C 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 2 月 28 日
26	大成标普 500 等权重指数证券投资基金(美元 A 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 2 月 28 日
27	大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 2 月 27 日
28	大成标普 500 等权重指数证券投资基金托管协议	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 2 月 27 日
29	大成基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同和托管协议的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 2 月 27 日
30	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 1 月 22 日
31	大成基金管理有限公司关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2024 年度第 1 次分红的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 1 月 16 日
32	关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金暂停大额申购(含定期定额申购)业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 1 月 11 日
33	关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金恢复大额申购(含定期定额申购)业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2025 年 1 月 10 日
34	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金 2025 年境外(地区)主要市场节	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本	2025 年 1 月 4 日

假日暂停申购赎回安排的公告	公司网站	
---------------	------	--

## § 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

无。

### 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

2025 年 8 月 29 日