

大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：2021 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2021 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	9
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	34
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	34

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	34
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	147
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	149
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	149
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	149
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	149
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	149
7.11 投资组合报告附注	149
§8 基金份额持有人信息	150
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	150
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	150
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	150
§9 开放式基金份额变动	151
§10 重大事件揭示	151
10.1 基金份额持有人大会决议	151
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	151
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	151
10.4 基金投资策略的改变	151
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	151
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	152
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	152
10.8 其他重大事件	153
§11 影响投资者决策的其他重要信息	154
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	154
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	154
§12 备查文件目录	154
12.1 备查文件目录	154
12.2 存放地点	154
12.3 查阅方式	154

§ 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	162,070,331.12 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	赵冰	许俊
	联系电话	0755-83183388	010-66594319
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008885558	95566
传真		0755-83199588	010-66594942
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518040	100818
法定代表人		吴庆斌	刘连舸

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	中国银行（香港）有限公司
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

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	深圳市福田区深南大道 7088 号 招商银行大厦 32 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	9,375,784.40
本期利润	38,279,991.67
加权平均基金份额本期利润	0.2741
本期加权平均净值利润率	13.09%
本期基金份额净值增长率	15.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	92,586,011.56
期末可供分配基金份额利润	0.5713
期末基金资产净值	356,752,052.68
期末基金份额净值	2.201
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	168.17%

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

2. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低

数（为期末余额，不是当期发生数）。

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

3.2 基金净值表现

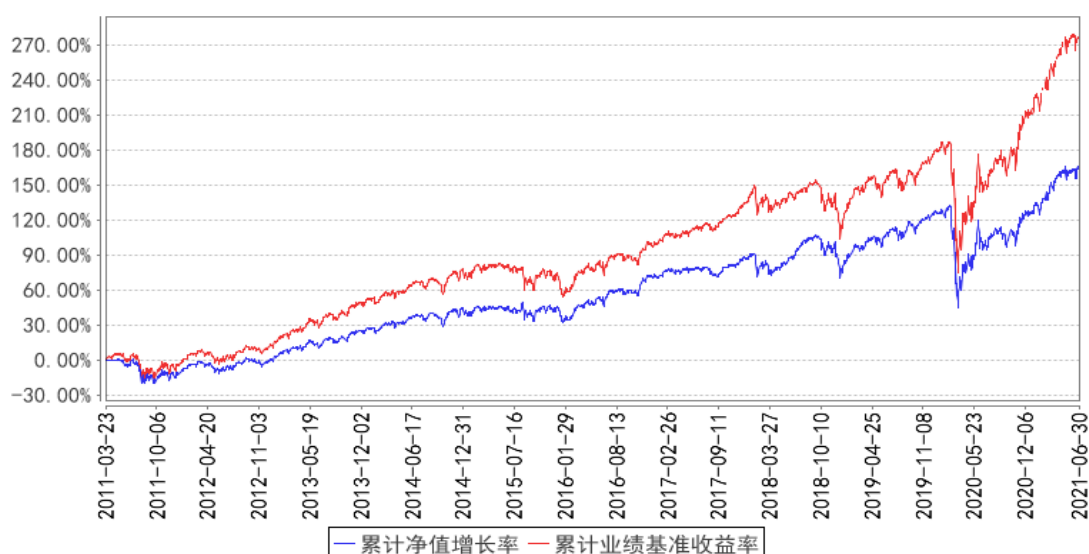
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.48%	0.72%	0.14%	0.71%	1.34%	0.01%
过去三个月	4.31%	0.78%	6.90%	0.76%	-2.59%	0.02%
过去六个月	15.68%	0.91%	19.18%	0.91%	-3.50%	0.00%
过去一年	32.39%	1.04%	50.71%	1.08%	-18.32%	-0.04%
过去三年	39.25%	1.53%	57.74%	1.61%	-18.49%	-0.08%
自基金合同生效起至今	168.17%	1.15%	276.73%	1.20%	-108.56%	-0.05%

注：同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应

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

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



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

2、同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10号文批准，于1999年4月12日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本2亿元人民币，注册地广东省深圳市。目前公司由三家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。主要业务是公募基金的募集、销售和管理，还具有全国社保基金投资管理、基本养老保险投资管理、受托管理保险资金、保险保障基金投资管理、特定客户资产管理和QDII业务资格。

经过二十二年的稳健发展，公司形成了强大稳固的综合实力。公司旗下基金产品齐全、风格多样，构建了涵盖股票型基金、混合型基金、指数型基金、债券型基金和货币市场基金的完备产品线。截至2021年6月30日，本基金管理人共管理9只ETF及3只ETF联接基金，8只QDII基金及107只开放式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
冉 凌 浩	本基金基金经理	2011 年 8 月 26 日	-	18 年	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。2011 年 8 月 26 日起任大成标普 500 等权重指数型证券投资基金基金经理。2014 年 11 月 13 日起任大成纳斯达克 100 指数证券投资基金基金经理。2016 年 12 月 2 日起任大成恒生综合中小型股指数基金(QDII-LOF)基金经理。2016 年 12 月 29 日至 2020 年 7 月 7 日任大成海外中国机会混合型证券投资基金(LOF)基金经理。2017 年 8 月 10 日起任大成恒生指数证券投资基金(LOF)基金经理。2019 年 3 月 20 日起任大成中华沪深港 300 指数证券投资基金(LOF)基金经理。2021 年 5 月 18 日起任大成恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

无。

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析。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市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别组合间的成交价格差异较大，但结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易不存在同日反向交易。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5% 的情形；主动投资组合间债券交易存在 2 笔同日反向交易，原因为流动性需要。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年 1 季度，多种新冠疫苗在美国推广接种，且接种速度较快，同时新冠疫情也正在持续缓解过程中。这使市场认为 2021 年欧美的疫情会逐步消除，未来疫情将不再是经济增长的显著拖累。

为了推动经济的恢复，美国政府推出了多项经济刺激政策，这些经济刺激政策有望在较长的时间内对美国经济产生积极作用。

随着疫情状况的逐步好转及经济刺激政策的实施，美国的宏观经济也在继续走好。六月底公布的美国 2021 年 1 季度的 GDP 环比折年率为 6.4%，保持在高速复苏的区间。从分项数据来看，消费仍然保持强劲的增长，是宏观经济增长的主要推动力，六月底公布的美国 2021 年 1 季度的个人消费增速为 11.4%，保持在非常高的区间内。从生产及供给的角度来看，二季度制造业 PMI 保持在 60 以上的水平，这意味着制造业保持在非常繁荣的区间，同时，二季度服务业也保持在 60 以上的水平，这意味着美国的出行逐渐恢复正常，服务业也回到了繁荣的状态中。这些较好的宏观经济数据说明，经济解封后美国的潜能开始恢复，积压的需求得以释放，经济也在迅速改善。

在上半年，美联储保持了宽松的货币政策环境。但是，持续宽松的货币政策环境使得市场开

始产生对通胀的担心，通胀数据也有一定幅度的抬升。虽然通货膨胀水平，但美联储认为当前的通胀仅是短期现象而长期通胀预期不变，因此维持当前的货币政策不变，这意味着美联储不会过早缩减量化宽松政策，也不会过早加息。

在较好的宏观经济环境下，美国上市公司利润大幅增长，并促使市场不断上调 2021 年全年的盈利预期，这也是本基金标的指数上半年表现较好的根本原因。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 2.201 元；本报告期基金份额净值增长率为 15.68%，业绩比较基准收益率为 19.18%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年以来，美股持续保持较好的上涨势头，不断创出历史新高。展望下半年，预计美国宏观经济保持高速增长，上市公司盈利也随之保持高速增长。高速增长的指数成份股盈利预计会对指数起到强烈的支撑作用。

本基金为被动型指数基金，其投资目标就是要复制指数的收益率。本基金将坚持被动型的指数化投资理念，持续实施高效的组合管理策略、交易策略及风险控制方法，以期更好地跟踪指数，力争将跟踪误差控制在较低的水平。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、研究部、固定收益总部、数量与指数投资部、大类资产配置部、交易管理部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括五名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、数量与指数投资部、大类资产配置部、风险管理部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；交易管理部负责关注相关投资品种的流动性状况，协助反馈其市场交易信息；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管行沟通估值调整事项；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项

的信息披露工作。

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内大成标普 500 等权重指数证券投资基金已分配利润 6,141,464.28 元（每十份基金份额分红 0.5580 元），符合基金合同规定的分红比例。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在大成标普 500 等权重指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责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：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.3.1	25,052,135.59	14,491,186.45
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.3.2	335,604,037.18	208,686,583.77
其中：股票投资		335,604,037.18	208,686,583.77
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.3.5	738.73	423.34
应收股利		318,223.12	253,532.40
应收申购款		2,181,949.23	856,800.52
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	122,048.34	196,351.92
资产总计		363,279,132.19	224,484,878.40
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-

应付赎回款		6,047,061.80	3,992,648.84
应付管理人报酬		294,308.70	187,436.06
应付托管费		73,577.17	46,858.97
应付交易费用	6.4.3.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	112,131.84	194,544.52
负债合计		6,527,079.51	4,421,488.39
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	162,070,331.12	112,448,859.42
未分配利润	6.4.3.10	194,681,721.56	107,614,530.59
所有者权益合计		356,752,052.68	220,063,390.01
负债和所有者权益总计		363,279,132.19	224,484,878.40

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.201 元，基金份额总额 162,070,331.12 份。

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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		40,353,127.78	-23,666,228.19
1. 利息收入		15,309.88	30,975.52
其中：存款利息收入	6.4.3.11	15,309.88	30,975.52
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		11,531,232.12	-83,458.35
其中：股票投资收益	6.4.3.12	9,177,014.00	-2,689,157.66
基金投资收益	6.4.3.13	-	-
债券投资收益	6.4.3.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.3.15	-	-
衍生工具收益	6.4.3.16	-	-

股利收益	6.4.3.17	2,354,218.12	2,605,699.31
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	28,904,207.27	-23,861,135.84
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-271,754.61	-19,490.70
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.19	174,133.12	266,881.18
减：二、费用		2,073,136.11	1,659,556.01
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	1,444,707.51	1,137,829.63
2. 托管费	6.4.6.2.2	361,176.95	284,457.44
4. 交易费用	6.4.3.20	55,273.93	54,299.91
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.3.21	211,977.72	182,969.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		38,279,991.67	-25,325,784.20
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		38,279,991.67	-25,325,784.20

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	112,448,859.42	107,614,530.59	220,063,390.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	38,279,991.67	38,279,991.67
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	49,621,471.70	54,928,663.58	104,550,135.28
其中：1. 基金申购款	117,974,210.85	129,314,843.40	247,289,054.25

2. 基金赎回款	-68,352,739.15	-74,386,179.82	-142,738,918.97
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-6,141,464.28	-6,141,464.28
五、期末所有者权益（基金净值）	162,070,331.12	194,681,721.56	356,752,052.68
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	122,182,590.21	122,197,045.74	244,379,635.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-25,325,784.20	-25,325,784.20
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	24,732,106.14	14,643,402.76	39,375,508.90
其中：1. 基金申购款	149,828,028.18	96,717,952.04	246,545,980.22
2. 基金赎回款	-125,095,922.04	-82,074,549.28	-207,170,471.32
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-7,266,585.87	-7,266,585.87
五、期末所有者权益（基金净值）	146,914,696.35	104,248,078.43	251,162,774.78

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

周立新

刘亚林

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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。

6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。

(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费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	25,052,135.59

定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	25,052,135.59

注：于本期末，活期存款中包括的外币余额为美元活期存款 3,020,828.59 元，折合人民币 19,514,854.78 元。

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	274,482,781.29	335,604,037.18	61,121,255.89
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	274,482,781.29	335,604,037.18	61,121,255.89

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	738.73
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	—
应收债券利息	—
应收资产支持证券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
应收出借证券利息	—
其他	—
合计	738.73

6.4.3.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
其他应收款	—
待摊费用	122,048.34
合计	122,048.34

6.4.3.7 应付交易费用

无。

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	19,833.18
应付证券出借违约金	—
预提费用	89,260.15
其他	3,038.51
合计	112,131.84

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	112,448,859.42	112,448,859.42
本期申购	117,974,210.85	117,974,210.85

本期赎回（以“-”号填列）	-68,352,739.15	-68,352,739.15
- 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	162,070,331.12	162,070,331.12

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)。

6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	62,650,677.05	44,963,853.54	107,614,530.59
本期利润	9,375,784.40	28,904,207.27	38,279,991.67
本期基金份额交易产生的变动数	26,701,014.39	28,227,649.19	54,928,663.58
其中：基金申购款	63,592,598.31	65,722,245.09	129,314,843.40
基金赎回款	-36,891,583.92	-37,494,595.90	-74,386,179.82
本期已分配利润	-6,141,464.28	-	-6,141,464.28
本期末	92,586,011.56	102,095,710.00	194,681,721.56

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	15,309.88
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	15,309.88

6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	48,417,818.28
减：卖出股票成本总额	39,240,804.28
买卖股票差价收入	9,177,014.00

6.4.3.13 基金投资收益

无。

6.4.3.14 债券投资收益

无。

6.4.3.15 贵金属投资收益

无。

6.4.3.16 衍生工具收益

无。

6.4.3.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,354,218.12
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	2,354,218.12

6.4.3.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	28,904,207.27
股票投资	28,904,207.27
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	28,904,207.27

6.4.3.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	174,133.12
合计	174,133.12

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

6.4.3.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	55,273.93
银行间市场交易费用	—
合计	55,273.93

6.4.3.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
指数使用费	110,781.40
银行划款手续费	9,977.26
其他	1,958.91
合计	211,977.72

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

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

无。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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、基金销售机构、注册登记机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构

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。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

无。

6.4.6.1.2 债券交易

无。

6.4.6.1.3 债券回购交易

无。

6.4.6.1.4 基金交易

无。

6.4.6.1.5 权证交易

无。

6.4.6.1.6 应支付关联方的佣金

无。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,444,707.51	1,137,829.63
其中：支付销售机构的客户维护费	515,351.86	455,003.60

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。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	361,176.95	284,457.44

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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.6.4 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

6.4.6.4.1 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。

6.4.6.4.2 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。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 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。

6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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	5,537,696.78	15,309.88	6,857,283.80	30,975.52
中国银行（香港）有限公司	19,514,438.81	-	11,448,310.92	-

注：本基金的银行存款由基金托管人和境外资产托管人保管，存放于基金托管人的银行存款按银行同业利率计息，存放于境外资产托管人的银行存款不计息。

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益 登记	除息日		每 10 份基金	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					

	日			份额分 红数				
1	2021 年 01 月 18 日	-	2021 年 1 月 15 日	0.558	2,964,070.69	3,177,393.59	6,141,464.28	-
合计	-	-	-	0.558	2,964,070.69	3,177,393.59	6,141,464.28	-

6.4.8 期末(2021 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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同责任,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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行——中国银行及境外次托管行中银香港,因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算,违约风险发生的可能性很小;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。

于本期末,本基金无债券投资(上年度末:同)。

6.4.9.3 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。

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.4 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。

6.4.9.4.1 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。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,537,696.78	-	-	19,514,438.81	25,052,135.59
交易性金融资产	-	-	-	335,604,037.18	335,604,037.18
应收利息	-	-	-	738.73	738.73
应收股利	-	-	-	318,223.12	318,223.12
应收申购款	32,480.57	-	-	2,149,468.66	2,181,949.23
其他资产	-	-	-	122,048.34	122,048.34
资产总计	5,570,177.35	-	-	357,708,954.84	363,279,132.19
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,047,061.80	6,047,061.80
应付管理人报酬	-	-	-	294,308.70	294,308.70
应付托管费	-	-	-	73,577.17	73,577.17
其他负债	-	-	-	112,131.84	112,131.84
负债总计	-	-	-	6,527,079.51	6,527,079.51
利率敏感度缺口	5,570,177.35	-	-	351,181,875.33	356,752,052.68
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,711,770.39	-	-	6,779,416.06	14,491,186.45
交易性金融资产	-	-	-	208,686,583.77	208,686,583.77
应收利息	-	-	-	423.34	423.34
应收股利	-	-	-	253,532.40	253,532.40
应收申购款	-	-	-	856,800.52	856,800.52
其他资产	-	-	-	196,351.92	196,351.92
资产总计	7,711,770.39	-	-	216,773,108.01	224,484,878.40
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,992,648.84	3,992,648.84
应付管理人报酬	-	-	-	187,436.06	187,436.06
应付托管费	-	-	-	46,858.97	46,858.97
其他负债	-	-	-	194,544.52	194,544.52
负债总计	-	-	-	4,421,488.39	4,421,488.39
利率敏感度缺口	7,711,770.39	-	-	212,351,619.62	220,063,390.01

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

者予以分类。

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.9.4.2 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。

6.4.9.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 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				
银行存款	19,514,854.78	-	-	19,514,854.78
交易性金融资产	335,604,037.18	-	-	335,604,037.18
应收股利	318,223.12	-	-	318,223.12
资产合计	355,437,115.08	-	-	355,437,115.08
以外币计价的负债				
其他负债	3,038.51	-	-	3,038.51
负债合计	3,038.51	-	-	3,038.51
资产负债表外汇风险敞口净	355,434,076.57	-	-	355,434,076.57

额	76.57			
项目	上年度末 2020 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				
银行存款	6,779,828.50	-	-	6,779,828.50
交易性金融资产	208,686,583.77	-	-	208,686,583.77
应收股利	253,532.40	-	-	253,532.40
应收利息	1.83	-	-	1.83
资产合计	215,719,946.50	-	-	215,719,946.50
以外币计价的负债				
其他负债	2,177.69	-	-	2,177.69
负债合计	2,177.69	-	-	2,177.69
资产负债表外汇风险敞口净额	215,717,768.81	-	-	215,717,768.81

6.4.9.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除美元以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	美元相对人民币升值 5%	17,772,007.70	10,785,888.44
	美元相对人民币贬值 5%	-17,772,007.66	-10,785,888.44

6.4.9.4.3 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。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	335,604,037.18	94.07	208,686,583.77	94.83
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	335,604,037.18	94.07	208,686,583.77	94.83

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准上升 5%	16,850,921.91	10,417,531.48
	业绩比较基准下降 5%	-16,850,921.91	-10,417,531.48

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	335,604,037.18	92.38
	其中：普通股	335,604,037.18	92.38
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	25,052,135.59	6.90
8	其他各项资产	2,622,959.42	0.72
9	合计	363,279,132.19	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	335,604,037.18	94.07
合计	335,604,037.18	94.07

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（%）
金融	43,105,611.88	12.08
通信服务	14,826,510.56	4.16
房地产	19,041,920.61	5.34
能源	14,412,681.95	4.04
公用事业	18,339,345.14	5.14
非日常生活消费品	42,111,109.37	11.80
工业	49,726,813.39	13.94
日常消费品	21,141,529.00	5.93
信息技术	50,810,005.30	14.24
医疗保健	43,942,389.31	12.32
原材料	18,146,120.67	5.09
合计	335,604,037.18	94.07

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）

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	Enphase Energy Inc	Enphase 能源公司	ENP	纳	美	709	841,064	0.2

			H UQ	斯达克 证券交易所	国		. 13	4
2	ETSY INC	Etsy 股份有限公司	ETSY UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	629	836,410 .85	0.2 3
3	Generac Holdings Inc	Generac 控股公司	GNR C UN	美国 纽约 证券交易所	美国	302	809,936 .98	0.2 3
4	NIKE INC -CL B	耐克公司	NKE UN	美国 纽约 证券交易所	美国	791	789,434 .49	0.2 2
5	TWITTER INC	推特公司	TWTR UN	美国 纽约 证券	美国	1,725	766,796 .10	0.2 1

				交易所				
6	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	Chipotle Mexican Grill 股份	CMG UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	76	761,166 .71	0.2 1
7	RESMED INC	瑞思迈股份有限公司	RMD UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	477	759,643 .42	0.2 1
8	SKYWORKS SOLUTIONS INC	思佳讯解决方案公司	SWK S UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	610	755,621 .75	0.2 1
9	NVIDIA CORP	英伟达	NVD A UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	146	754,634 .00	0.2 1
10	ADVANCED MICRO	AMD 公司	AMD	纳 美	美	1,24	752,428	0.2

	DEVICES		UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	0	.52	1
11	COPART INC	Copart 股份有限公司	CPR T UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	882	751,142 .06	0.2 1
12	TESLA INC	特斯拉公司	TSL A UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	171	750,849 .02	0.2 1
13	Charles River Laboratories International Inc.	查理斯河实验室国际有限公司	CRL UN	美国 纽约 证券交易所	美国	314	750,372 .14	0.2 1
14	PAYPAL HOLDINGS INC	Paypal 控股股份有限公司	PYP L UQ	纳斯达克 证券	美国	398	749,430 .00	0.2 1

				交易所				
15	MSCI INC	MSCI 明晟	MSCI UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	217	747,293 .77	0.2 1
16	IHS MARKIT LTD	IHS Markit 有限公司	IHS UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,026	746,717 .53	0.2 1
17	CARMAX INC	CarMax 股份有限公司	KMX UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	893	745,049 .47	0.2 1
18	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	西方石油	OXY UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	3,685	744,397 .00	0.2 1
19	DIAMONDBACK ENERGY	Diamondback 能源股份有	FAN	纳	美	1,22	743,010	0.2

	INC	限公司	G UQ	斯达克 证 券 交 易 所	国	5	.02	1
20	L BRANDS INC	蕾碧裳股份有限公司	LB UN	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,596	742,961 .63	0.2 1
21	XILINX INC	赛灵思	XLN X UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	795	742,839 .15	0.2 1
22	AUTOZONE INC	AutoZone 公司	AZO UN	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	77	742,271 .56	0.2 1
23	BIO-RAD LABORATORIES-A	伯乐生命医学产品有限公 司	BIO UN	美国 纽 约 证 券	美国	178	740,867 .65	0.2 1

				交易所				
24	CBOE GLOBAL MARKETS INC	Cboe 环球市场公司	CBO E UF	巴 兹 全 球 市 场	美国	963	740,619 .13	0.2 1
25	MICROSOFT CORP	微软	MSF T UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	423	740,267 .38	0.2 1
26	DEXCOM INC	DexCom 股份有限公司	DXC M UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	267	736,509 .54	0.2 1
27	ADVANCE AUTO PARTS INC	领先汽车配件公司	AAP UN	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	555	735,499 .83	0.2 1
28	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	O'Reilly 汽车股份有限 公司	ORL Y UQ	纳 斯 达 克	美国	201	735,212 .42	0.2 1

				证 券 交 易 所				
29	T ROWE PRICE GROUP INC	普信集团公司	TRO W UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	574	734,092 .04	0.2 1
30	TERADYNE INC	泰瑞达	TER UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	848	733,854 .96	0.2 1
31	LENNAR CORP-A	Lennar 公司	LEN UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,14 3	733,589 .90	0.2 1
32	DANAHER CORP	丹纳赫	DHR UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	422	731,592 .89	0.2 1

33	PAYCHEX INC	Paychex 公司	PAY X UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,05 5	731,293 .01	0.2 0
34	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	是德科技公司	KEY S UN	美国 纽约证 券交易 所	美国	733	731,170 .46	0.2 0
35	APPLE INC	苹果公司	AAP L UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	824	729,054 .84	0.2 0
36	NRG ENERGY INC	NRG 能源股份有限公司	NRG UN	美国 纽约证 券交易 所	美国	2,79 9	728,697 .34	0.2 0
37	DISH NETWORK CORP-A	DISH 网络公司	DIS H UQ	纳斯 达克	美国	2,69 7	728,276 .79	0.2 0

				证 券 交 易 所				
38	NXP SEMICONDUCTORS NV	恩智浦半导体公司	NXP I UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	548	728,276 .53	0.2 0
39	CINTAS CORP	CINTAS 公司	CTA S UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	295	727,988 .67	0.2 0
40	SERVICENOW INC	ServiceNow 公司	NOW UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	205	727,780 .33	0.2 0
41	DR HORTON INC	霍顿房屋公司	DHI UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,24 6	727,413 .85	0.2 0

42	CENTENE CORP	Centene 公司	CNC UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,543	726,961 .45	0.2 0
43	NETFLIX INC	奈飞公司	NFL X UQ	纳斯 达克 证券 交易所	美国	213	726,817 .65	0.2 0
44	SMITH (A.O.) CORP	AO 史密斯公司	AOS UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,561	726,668 .61	0.2 0
45	ADOBE INC	奥多比	ADB E UQ	纳斯 达克 证券 交易所	美国	192	726,392 .25	0.2 0
46	IDEXX LABORATORIES INC	爱德士股份有限公司	IDX X UQ	纳斯 达克	美国	178	726,217 .96	0.2 0

				证 券 交 易 所				
47	UNITEDHEALTH GROUP INC	联合健康	UNH UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	280	724,327 .08	0.2 0
48	LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	美国实验控股	LH UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	406	723,499 .55	0.2 0
49	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	查特通信公司	CHT R UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	155	722,399 .07	0.2 0
50	STERIS PLC	STERIS PLC	STE UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	542	722,333 .50	0.2 0

51	FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	Fortune Brands 家居与安全有限	FBH S UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,12 2	721,996 .41	0.2 0
52	MICRON TECHNOLOGY INC	美光科技股份有限公司	MU UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,31 5	721,907 .78	0.2 0
53	ACCENTURE PLC-CL A	埃森哲公司	ACN UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	379	721,757 .32	0.2 0
54	AMERICAN EXPRESS CO	美国运通	AXP UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	676	721,563 .97	0.2 0
55	ILLUMINA INC	Illumina 公司	ILM N UQ	纳 斯 达 克	美国	236	721,448 .21	0.2 0

				证 券 交 易 所				
56	PAYCOM SOFTWARE INC	Paycom 软件股份有限公司	PAY C UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	307	720,852 .13	0.2 0
57	WASTE MANAGEMENT INC	废品管理	WM UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	796	720,479 .19	0.2 0
58	VIACOMCBS INC – CLASS B	维亚康姆哥伦比亚广播公 司	VIA C UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,46 5	719,771 .42	0.2 0
59	MARATHON OIL CORP	Marathon 石油公司	MRO UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	8,17 7	719,466 .12	0.2 0

60	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	国际香料	IFF UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	745	719,028 .51	0.2 0
61	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	斑马技术公司	ZBR A UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	210	718,317 .25	0.2 0
62	BOSTON SCIENTIFIC CORP	波士顿科学	BSX UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	2,58 7	714,617 .04	0.2 0
63	REGENERON PHARMACEUTICALS	再生元制药股份有限公司	REG N UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	198	714,428 .40	0.2 0
64	Pool Corp	Pool 公司	POO L UQ	纳 斯 达 克	美国	241	714,080 .46	0.2 0

				证 券 交 易 所				
65	PULTEGROUP INC	Pulte 集团公司	PHM UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	2,024	713,515 .98	0.2 0
66	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	雅诗兰黛	EL UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	347	713,025 .53	0.2 0
67	INTUITIVE SURGICAL INC	直觉外科手术公司	ISR G UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	120	712,915 .96	0.2 0
68	COOPER COS INC/THE	库柏股份有限公司	COO UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	278	711,664 .38	0.2 0

69	CARRIER GLOBAL CORP	Carrier Global Corp	CAR R UN	美国 纽约 证券 交易 所	美国	2,264	710,807 .39	0.2 0
70	ANSYS INC	ANSYS 股份有限公司	ANS S UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	317	710,727 .41	0.2 0
71	ABBOTT LABORATORIES	雅培制药	ABT UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	949	710,724 .50	0.2 0
72	ANALOG DEVICES INC	模拟器件	ADI UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	639	710,677 .15	0.2 0
73	WELLS FARGO & CO	富国银行	WFC UN	美国 纽约	美国	2,428	710,379 .21	0.2 0

				证 券 交 易 所				
74	ELI LILLY & CO	礼来	LLY UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	479	710,223 .91	0.2 0
75	KLA CORP	KLA 公司	KLA C UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	339	710,011 .44	0.2 0
76	HOLOGIC INC	豪洛捷公司	HOL X UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,64 7	709,886 .44	0.2 0
77	PERKINELMER INC	珀金埃尔默	PKI UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	711	709,225 .37	0.2 0

78	CDW CORP/DE	特拉华 CDW 公司	CDW UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	628	708,545 .06	0.2 0
79	NORTHERN TRUST CORP	北美信托	NTR S UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	948	708,077 .09	0.2 0
80	LOWE'S COS INC	劳氏	LOW UN	美国 纽约 证券交易所	美国	565	707,982 .06	0.2 0
81	FACEBOOK INC-CLASS A	Facebook 公司	FB UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	315	707,566 .03	0.2 0
82	DARDEN RESTAURANTS INC	达登饭店	DRI UN	美国 纽约	美国	750	707,332 .50	0.2 0

				证 券 交 易 所				
83	TYLER TECHNOLOGIES INC	Tyler 科技公司	TYL UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	242	707,210 .02	0.2 0
84	AUTODESK INC	欧特克	ADS K UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	375	707,138 .70	0.2 0
85	MOODY'S CORP	穆迪	MCO UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	302	706,965 .82	0.2 0
86	MARKETAXESS HOLDINGS INC	MarketAxess 控股公司	MKT X UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	236	706,781 .71	0.2 0

87	HUMANA INC	Humana 公司	HUM UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	247	706,423 .82	0.2 0
88	ALLSTATE CORP	全州保险	ALL UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	838	706,145 .26	0.2 0
89	MORGAN STANLEY	摩根士丹利	MS UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,19 2	706,053 .27	0.2 0
90	DOLLAR GENERAL CORP	达乐公司	DG UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	505	705,940 .02	0.2 0
91	BANK OF AMERICA CORP	美国银行控股公司	BAC UN	美国 纽约	美国	2,65 0	705,827 .30	0.2 0

				证 券 交 易 所				
92	AUTOMATIC DATA PROCESSING	ADP 公司	ADP UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	550	705,707 .78	0.2 0
93	SYNOPSYS INC	新思科技公司	SNP S UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	396	705,525 .87	0.2 0
94	S&P GLOBAL INC	标普全球	SPG I UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	266	705,311 .78	0.2 0
95	EBAY INC	eBay 公司	EBA Y UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,55 5	705,291 .43	0.2 0

96	OLD DOMINION FREIGHT LINE	Old Dominion Freight Line 股份有限公司	ODF L UQ	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	430	705,016 .55	0.2 0
97	TRANE TECHNOLOGIES PLC	特灵科技公共有限公司	TT UN	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	592	704,221 .19	0.2 0
98	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	福泰制药	VRT X UQ	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	540	703,376 .98	0.2 0
99	QUEST DIAGNOSTICS INC	Quest Diagnostics 股份 有限公	DGX UN	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	825	703,345 .00	0.2 0
10 0	UNITED RENTALS INC	联合租赁公司	URI UN	美国 纽 约	美国	341	702,745 .25	0.2 0

				证 券 交 易 所				
10 1	PFIZER INC	辉瑞制药	PFE UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	2,77 7	702,518 .56	0.2 0
10 2	NEWELL BRANDS INC	纽威尔品牌公司	NWL UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	3,95 8	702,382 .51	0.2 0
10 3	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	布罗德里奇金融解决方案 股份有	BR UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	673	702,275 .47	0.2 0
10 4	APPLIED MATERIALS INC	应用材料	AMA T UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	763	701,897 .62	0.2 0

10 5	FORTINET INC	飞塔股份有限公司	FTN T UQ	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	456	701,661 .44	0.2 0
10 6	KROGER CO	克罗格公司	KR UN	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,83 5	701,624 .03	0.2 0
10 7	GOLDMAN SACHS GROUP INC	高盛	GS UN	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	286	701,215 .30	0.2 0
10 8	GILEAD SCIENCES INC	吉利德科学	GIL D UQ	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	1,57 6	701,071 .76	0.2 0
10 9	GARTNER INC	高德纳咨询股份有限公司	IT UN	美国 纽 约	美国	448	700,957 .03	0.2 0

				证 券 交 易 所				
11 0	TRACTOR SUPPLY COMPANY	拖拉机供应公司	TSC O UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	583	700,746 .30	0.2 0
11 1	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	西氏医药服务公司	WST UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	302	700,586 .22	0.2 0
11 2	ANTHEM INC	Anthem 股份有限公司	ANT M UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	284	700,476 .40	0.2 0
11 3	QORVO INC	Qorvo 股份有限公司	QRV O UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	554	700,210 .89	0.2 0

11 4	INTUIT INC	Intuit 公司	INT U UQ	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	221	699,806 .93	0.2 0
11 5	TARGET CORP	塔吉特公司	TGT UN	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	448	699,625 .73	0.2 0
11 6	EQUIFAX INC	Equifax 公司	EFX UN	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	452	699,360 .87	0.2 0
11 7	ULTA BEAUTY INC	Ulta 美容产品公司	ULT A UQ	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	313	699,150 .85	0.2 0
11 8	UDR INC	UDR 公司	UDR UN	美国 纽 约	美国	2,20 9	698,962 .28	0.2 0

				证 券 交 易 所				
11 9	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	爱德华生命科学公司	EW UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	1,04 4	698,511 .75	0.2 0
12 0	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	梅特勒-托利多国际股份 有限公	MTD UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	78	698,055 .92	0.2 0
12 1	COSTCO WHOLESALE CORP	好市多批发	COS T UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	273	697,806 .50	0.2 0
12 2	PEPSICO INC	百事可乐	PEP UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	729	697,793 .71	0.2 0

12 3	FIRST REPUBLIC BANK/CA	第一共和银行/加州旧金山	FRC UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	577	697,672 .00	0.2 0
12 4	Monolithic Power Systems	芯源系统有限公司	MPW R UQ	纳斯 达克 证券 交易所	美国	289	697,219 .54	0.2 0
12 5	IPG PHOTONICS CORP	IPG 光子公司	IPG P UQ	纳斯 达克 证券 交易所	美国	512	697,136 .78	0.2 0
12 6	LOCKHEED MARTIN CORP	洛克希德马丁	LMT UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	285	696,590 .97	0.2 0
12 7	DEERE & CO	迪尔	DE UN	美国 纽约	美国	305	694,955 .27	0.1 9

				证 券 交 易 所				
12 8	KIMBERLY-CLARK CORP	金佰利	KMB UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	804	694,842 .67	0.1 9
12 9	ROCKWELL AUTOMATION INC	罗克韦尔自动化	ROK UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	376	694,741 .89	0.1 9
13 0	VERISIGN INC	威瑞信股份有限公司	VRS N UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	472	694,264 .88	0.1 9
13 1	AGILENT TECHNOLOGIES INC	安捷伦	A UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	727	694,188 .59	0.1 9

13 2	SCHWAB (CHARLES) CORP	嘉信理财	SCH W UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	1,47 4	693,310 .46	0.1 9
13 3	GENERAL DYNAMICS CORP	通用动力	GD UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	570	693,221 .70	0.1 9
13 4	DOMINO'S PIZZA INC	达美乐披萨公司	DPZ UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	230	693,121 .57	0.1 9
13 5	WELLTOWER INC	Welltower 股份有限公司	WEL L UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	1,29 1	693,053 .09	0.1 9
13 6	STANLEY BLACK & DECKER INC	史丹利百得公司	SWK UN	美国 纽约	美国	523	692,585 .84	0.1 9

				证 券 交 易 所				
13 7	WATERS CORP	沃特世公司	WAT UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	310	692,129 .30	0.1 9
13 8	EXTRA SPACE STORAGE INC	额外空间仓储公司	EXR UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	654	692,124 .00	0.1 9
13 9	FEDEX CORP	联邦快递	FDX UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	359	691,879 .75	0.1 9
14 0	FIRSTENERGY CORP	第一能源	FE UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	2,87 8	691,814 .56	0.1 9

14 1	3M CO	3M 公司	MMM UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	539	691,628 .45	0.1 9
14 2	AMERIPRISE FINANCIAL INC	阿默普莱斯金融公司	AMP UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	430	691,349 .57	0.1 9
14 3	INCYTE CORP	因赛特公司	INC Y UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,27 2	691,317 .01	0.1 9
14 4	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	Thermo Fisher Scientific 公司	TMO UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	212	690,892 .45	0.1 9
14 5	IDEX CORP	艺达思集团	IEX UN	美国 纽约	美国	486	690,870 .87	0.1 9

				证 券 交 易 所				
14 6	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	百时美施贵宝公司	BM UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	1,60 0	690,662 .21	0.1 9
14 7	HOME DEPOT INC	家得宝	HD UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	335	690,120 .53	0.1 9
14 8	ALBEMARLE CORP	雅保公司	ALB UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	634	689,962 .19	0.1 9
14 9	ZOETIS INC	硕腾股份有限公司	ZTS UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	573	689,837 .13	0.1 9

150	ROPER TECHNOLOGIES INC	儒博技术公司	ROP UN	美国 纽约 证券 交易 所	美国	227	689,521 .36	0.1 9
151	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	联合包裹服务股份有限公司	UPS UN	美国 纽约 证券 交易 所	美国	513	689,219 .09	0.1 9
152	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	纽约梅隆银行股份有限公司	BK UN	美国 纽约 证券 交易 所	美国	2,080	688,377 .92	0.1 9
153	Organon & Co	Organon & Co	OGN UN	美国 纽约 证券 交易 所	美国	3,521	688,294 .33	0.1 9
154	CLOROX COMPANY	高乐氏公司	CLX UN	美国 纽约	美国	592	688,044 .06	0.1 9

				证 券 交 易 所				
15 5	TELEFLEX INC	泰利福公司	TFX UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	265	687,834 .95	0.1 9
15 6	MOTOROLA SOLUTIONS INC	摩托罗拉解决方案股份有 限公司	MSI UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	491	687,828 .49	0.1 9
15 7	JOHNSON CONTROLS INTERNATION	江森自控国际有限公司	JCI UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	1,54 8	686,316 .11	0.1 9
15 8	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	美信	MXI M UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,00 7	685,400 .59	0.1 9

159	JACOBS ENGINEERING GROUP INC	雅各布工程集团	J UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	795	685,215 .70	0.1 9
160	SALESFORCE.COM INC	Salesforce.com 股份有限公司	CRM UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	434	684,855 .74	0.1 9
161	NASDAQ INC	纳斯达克股份有限公司	NDAQ UQ	纳斯达克 证券 交易所	美国	603	684,818 .40	0.1 9
162	GAP INC/THE	Gap 公司	GPS UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	3,150	684,754 .45	0.1 9
163	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	捷迈邦美控股股份有限公司	ZBH UN	美国 纽约	美国	659	684,643 .85	0.1 9

				证 券 交 易 所				
16 4	OTIS WORLDWIDE CORP	Otis Worldwide Corp	OTI S UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,29 6	684,602 .12	0.1 9
16 5	Trimble Inc	天宝股份有限公司	TRM B UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,29 5	684,575 .83	0.1 9
16 6	TEXAS INSTRUMENTS INC	德州仪器	TXN UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	551	684,494 .75	0.1 9
16 7	XYLEM INC	Xylem 公司/纽约	XYL UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	883	684,284 .03	0.1 9

168	HCA HEALTHCARE INC	HCA 医疗保健有限公司	HCA UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	512	683,807 .27	0.1 9
169	PUBLIC STORAGE	公共存储公司	PSA UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	352	683,755 .59	0.1 9
170	FEDERAL REALTY INVS TRUST	联邦房地产投资信托公司	FRT UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	903	683,507 .72	0.1 9
171	EATON CORP PLC	伊顿	ETN UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	714	683,481 .94	0.1 9
172	MARSH & MCLENNAN COS	Marsh & McLennan 股份有 限公司	MMC UN	美国 纽约	美国	751	682,513 .96	0.1 9

				证 券 交 易 所				
17 3	AMGEN INC	AMGEN-T	AMG N UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	433	681,823 .18	0.1 9
17 4	CABOT OIL & GAS CORP	卡伯特石油天然气公司	COG UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	6,04 2	681,497 .40	0.1 9
17 5	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	亚力兄制药公司	ALX N UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	574	681,214 .57	0.1 9
17 6	LAM RESEARCH CORP	泛林集团	LRC X UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	162	680,981 .11	0.1 9

17 7	CISCO SYSTEMS INC	思科-T	CSC O UQ	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	1,98 8	680,661 .98	0.1 9
17 8	SEALED AIR CORP	希悦尔包装	SEE UN	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,77 8	680,548 .92	0.1 9
17 9	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	Raymond James 金融股份 有限公	RJF UN	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	810	679,725 .26	0.1 9
18 0	QUALCOMM INC	高通公司	QCO M UQ	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	736	679,579 .78	0.1 9
18 1	MARATHON PETROLEUM CORP	马拉松石油公司	MPC UN	美国 纽 约	美国	1,74 1	679,545 .80	0.1 9

				证 券 交 易 所				
18 2	AES CORP	爱伊斯	AES UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	4,03 4	679,385 .33	0.1 9
18 3	AMERICAN TOWER CORP	美国发射塔公司	AMT UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	389	678,856 .12	0.1 9
18 4	EXPEDITORS INTL WASH INC	华盛顿康捷国际物流公司	EXP D UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	830	678,814 .39	0.1 9
18 5	LEGGETT & PLATT INC	礼恩派	LEG UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	2,02 8	678,767 .10	0.1 9

18 6	MEDTRONIC PLC	美敦力	MDT UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	846	678,400 .81	0.1 9
18 7	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	CF 工业控股股份有限公司	CF UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	2,04 1	678,371 .55	0.1 9
18 8	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	空气产品公司	APD UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	365	678,331 .17	0.1 9
18 9	PROCTER & GAMBLE CO/THE	宝洁	PG UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	778	678,152 .49	0.1 9
19 0	TEXTRON INC	德事隆	TXT UN	美国 纽约	美国	1,52 6	677,942 .40	0.1 9

				证 券 交 易 所				
19 1	CBRE GROUP INC - A	世邦魏理仕	CBRE UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	1,224	677,881.03	0.19
19 2	AMERICAN ELECTRIC POWER	美国电力	AEP UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,240	677,610.23	0.19
19 3	ATMOS ENERGY CORP	美国阿特摩斯能源公司	ATO UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	1,091	677,380.31	0.19
19 4	SBA COMMUNICATIONS CORP	SBA 通信公司	SBA C UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	329	677,356.34	0.19

19 5	CROWN CASTLE INTL CORP	冠城国际公司	CCI UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	537	676,816 .28	0.1 9
19 6	MERCK & CO. INC.	默克	MRK UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	1,34 7	676,735 .46	0.1 9
19 7	ALLEGION PLC	安朗杰公共有限公司	ALL E UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	752	676,718 .73	0.1 9
19 8	REPUBLIC SERVICES INC	公共服务公司	RSG UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	952	676,563 .17	0.1 9
19 9	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	PNC 财务服务	PNC UN	美国 纽约	美国	549	676,548 .44	0.1 9

				证 券 交 易 所				
20 0	MGM RESORTS INTERNATIONAL	美高梅国际酒店集团	MGM UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	2,45 5	676,409 .62	0.1 9
20 1	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	菲利普莫里斯国际集团公 司	PM UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	1,05 6	676,115 .10	0.1 9
20 2	EXELON CORP	Exelon 公司	EXC UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,36 0	675,542 .99	0.1 9
20 3	HOWMET AEROSPACE INC	Howmet 航空航天股份有限 公司	HWM UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	3,03 3	675,387 .37	0.1 9

204	COLGATE-PALMOLIVE CO	高露洁棕榄	CL UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,285	675,304.94	0.19
205	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	Take-Two 互动软件股份有限公司	TTW O UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	590	674,704.47	0.19
206	NVR INC	NVR 股份有限公司	NVR UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	21	674,688.32	0.19
207	WHIRLPOOL CORP	惠而浦	WHR UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	479	674,638.45	0.19
208	PENTAIR PLC	Pentair 公共有限公司	PNR UN	美国 纽约	美国	1,547	674,479.85	0.19

				证 券 交 易 所				
20 9	LINDE PLC	Linde PLC	LIN UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	361	674,208 .98	0.1 9
21 0	AON PLC-CLASS A	Aon PLC	AON UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	437	674,034 .69	0.1 9
21 1	GARMIN LTD	佳明有限公司	GRM N UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	721	673,694 .37	0.1 9
21 2	VF CORP	VF 公司	VFC UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	1,27 1	673,612 .97	0.1 9

21 3	GENERAL MILLS INC	通用磨坊	GIS UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,71 1	673,473 .37	0.1 9
21 4	EMERSON ELECTRIC CO	艾默生电气	EMR UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,08 2	672,701 .07	0.1 9
21 5	CADENCE DESIGN SYS INC	Cadence 设计系统股份有 限公司	CDN S UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	761	672,625 .74	0.1 9
21 6	BEST BUY CO INC	百思买	BBY UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	905	672,217 .98	0.1 9
21 7	AMEREN CORPORATION	Ameren 公司	AEE UN	美国 纽约	美国	1,30 0	672,186 .33	0.1 9

				证 券 交 易 所				
21 8	MASTERCARD INC - A	万事达股份有限公司	MA UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	285	672,177 .60	0.1 9
21 9	DEVON ENERGY CORP	戴文能源	DVN UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	3,56 4	672,064 .62	0.1 9
22 0	APTIV PLC	Aptiv 公共有限公司	APT V UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	661	671,818 .94	0.1 9
22 1	T-MOBILE US INC	T-Mobile US 有限公司	TMU S UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	718	671,772 .49	0.1 9

22 2	HERSHEY CO/THE	好时食品	HSY UN	美国 纽约 证券 交易 所	美国	597	671,756 .47	0.1 9
22 3	CORTEVA INC	Corteva Inc	CTV A UN	美国 纽约 证券 交易 所	美国	2,34 4	671,568 .74	0.1 9
22 4	ILLINOIS TOOL WORKS	伊利诺伊工具	ITW UN	美国 纽约 证券 交易 所	美国	465	671,562 .28	0.1 9
22 5	BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	布朗福曼	BF/ B UN	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,38 7	671,474 .29	0.1 9
22 6	ALIGN TECHNOLOGY INC	Align 科技股份有限公司	ALG N UQ	纳 斯 达 克	美国	170	671,010 .59	0.1 9

				证 券 交 易 所				
22 7	JACK HENRY & ASSOCIATES INC	Jack Henry & Associates 公司	JKH Y UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	635	670,744 .75	0.1 9
22 8	ESSEX PROPERTY TRUST INC	埃塞克斯房地产信托公司	ESS UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	346	670,580 .73	0.1 9
22 9	IQVIA HOLDINGS INC	IQVIA 控股股份有限公司	IQV UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	428	669,996 .09	0.1 9
23 0	LKQ CORP	LKQ 公司	LKQ UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,10 7	669,954 .62	0.1 9

23 1	BALL CORP	波尔	BLL UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,28 0	669,948 .55	0.1 9
23 2	FORTIVE CORP	福迪威公司	FTV UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,48 7	669,934 .21	0.1 9
23 3	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	伯克希尔哈撒韦公司	BRK /B UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	373	669,680 .84	0.1 9
23 4	ARISTA NETWORKS INC	Arista网络股份有限公司	ANE T UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	286	669,399 .83	0.1 9
23 5	DOVER CORP	多佛	DOV UN	美国 纽约	美国	687	668,376 .16	0.1 9

				证 券 交 易 所				
23 6	STARBUCKS CORP	星巴克	SBU X UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	925	668,131 .00	0.1 9
23 7	CONOCOPHILLIPS	康菲石油	COP UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,69 8	668,027 .31	0.1 9
23 8	INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	洲际交易所(ICE)	ICE UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	871	667,894 .88	0.1 9
23 9	FASTENAL CO	快扣公司	FAS T UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,98 8	667,819 .30	0.1 9

24 0	WALT DISNEY CO/THE	华特迪士尼公司	DIS UN	美国 纽约 证券 交易 所	美国	588	667,669 .16	0.1 9
24 1	OMNICOM GROUP	奥姆尼康	OMC UN	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,29 2	667,632 .47	0.1 9
24 2	SEMPRA ENERGY	桑普拉能源	SRE UN	美国 纽约 证券 交易 所	美国	780	667,550 .56	0.1 9
24 3	LEIDOS HOLDINGS INC	Leidos 控股公司	LDO S UN	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,02 2	667,484 .66	0.1 9
24 4	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	公共服务企业集团	PEG UN	美国 纽约	美国	1,72 9	667,266 .70	0.1 9

				证 券 交 易 所				
24 5	BLACKROCK INC	贝莱德有限公司	BLK UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	118	666,982 .46	0.1 9
24 6	CAMPBELL SOUP CO	金宝汤	CPB UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	2,26 4	666,784 .13	0.1 9
24 7	AMAZON.COM INC	亚马逊公司	AMZ N UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	30	666,713 .33	0.1 9
24 8	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	信安金融	PFG UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,63 3	666,613 .00	0.1 9

24 9	ONEOK INC	Oneok 股份有限公司	OKE UN	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,85 4	666,401 .69	0.1 9
25 0	STRYKER CORP	史赛克	SYK UN	美国 纽约 证券 交易 所	美国	397	666,119 .06	0.1 9
25 1	CSX CORP	CSX 公司	CSX UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	3,21 3	665,862 .15	0.1 9
25 2	XCEL ENERGY INC	Xcel 能源	XEL UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,56 3	665,199 .34	0.1 9
25 3	HUNTINGTON BANCSHARES INC	杭庭顿银行	HBA N UQ	纳 斯 达 克	美国	7,21 5	665,119 .30	0.1 9

				证 券 交 易 所				
25 4	CATERPILLAR INC	卡特彼勒	CAT UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	473	664,996 .17	0.1 9
25 5	KELLOGG CO	家乐氏	K UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	1,60 0	664,925 .17	0.1 9
25 6	LOEWS CORP	罗斯	L UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	1,88 2	664,429 .68	0.1 9
25 7	Caesars Entertainment, Inc.	凯撒娱乐集团	CZR UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	991	664,203 .26	0.1 9

25 8	KIMCO REALTY CORP	Kimco 房地产公司	KIM UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	4,92 9	663,902 .22	0.1 9
25 9	TE CONNECTIVITY LTD	泰科电子公司	TEL UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	760	663,837 .29	0.1 9
26 0	MARTIN MARIETTA MATERIALS	Martin Marietta 材料股 份有限	MLM UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	292	663,636 .51	0.1 9
26 1	DAVITA INC	DaVita 股份有限公司	DVA UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	853	663,625 .34	0.1 9
26 2	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	阿卡迈技术公司	AKA M UQ	纳 斯 达 克	美国	881	663,611 .19	0.1 9

				证 券 交 易 所				
26 3	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	宣威威廉斯	SHW UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	377	663,540 .45	0.1 9
26 4	QUANTA SERVICES INC	Quanta 服务股份有限公 司	PWR UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	1,13 4	663,493 .49	0.1 9
26 5	Honeywell Intl Inc	霍尼韦尔	HON UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	468	663,166 .73	0.1 9
26 6	BECTON DICKINSON AND CO	碧迪	BDX UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	422	662,975 .39	0.1 9

26 7	TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	Teledyne 科技股份有限公司	TDY UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	245	662,892 .50	0.1 9
26 8	DOLLAR TREE INC	Dollar Tree 公司	DLT R UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,03 1	662,706 .13	0.1 9
26 9	SYNCHRONY FINANCIAL	同步金融公司	SYF UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	2,11 4	662,620 .73	0.1 9
27 0	ELECTRONIC ARTS INC	电子艺界	EA UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	713	662,488 .36	0.1 9
27 1	AMETEK INC	阿美特克股份有限公司	AME UN	美国 纽约	美国	768	662,341 .13	0.1 9

				证 券 交 易 所				
27 2	STATE STREET CORP	道富集团	STT UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	1,24 6	662,295 .14	0.1 9
27 3	MCKESSON CORP	McKesson 公司	MCK UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	536	662,190 .22	0.1 9
27 4	AT&T INC	美国电话电报公司	T UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	3,56 0	661,881 .17	0.1 9
27 5	CONSTELLATION BRANDS INC-A	星座公司	STZ UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	438	661,797 .32	0.1 9

27 6	NETAPP INC	网域存储技术	NTAP UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	1,252	661,763.86	0.19
27 7	PROGRESSIVE CORP	前进保险公司	PGR UN	美国 纽约 证券交易所	美国	1,043	661,727.62	0.19
27 8	ROBERT HALF INTL INC	罗致恒富国际公司	RHI UN	美国 纽约 证券交易所	美国	1,151	661,543.12	0.19
27 9	MONSTER BEVERAGE CORP	怪兽饮料公司	MNST UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	1,121	661,535.88	0.19
28 0	MID-AMERICA APARTMENT COMM	Mid-America Apartment Commun	MAA UN	美国 纽约	美国	608	661,510.11	0.19

				证 券 交 易 所				
28 1	GENERAL ELECTRIC CO	通用电气	GE UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	7,60 7	661,451 .06	0.1 9
28 2	ABIOMED INC	Abiomed 股份有限公司	ABM D UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	328	661,333 .87	0.1 9
28 3	GENUINE PARTS CO	原配部件	GPC UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	809	660,960 .16	0.1 9
28 4	MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	味好美股份有限公司/马 里兰州	MKC UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	1,15 8	660,703 .89	0.1 9

28 5	WR BERKLEY CORP	WR Berkley 公司	WRB UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	1,37 4	660,653 .88	0.1 9
28 6	DTE ENERGY COMPANY	DTE 能源	DTE UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	789	660,573 .65	0.1 9
28 7	VERISK ANALYTICS INC	Verisk 分析公司	VRS K UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	585	660,294 .57	0.1 9
28 8	CELANESE CORP	塞拉尼斯公司	CE UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	674	660,082 .68	0.1 9
28 9	CIGNA CORP	信诺集团	CI UN	美国 纽约	美国	431	660,074 .74	0.1 9

				证 券 交 易 所				
29 0	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	亿滋国际	MDL Z UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,63 6	659,911 .10	0.1 8
29 1	AMPHENOL CORP-CL A	安费诺公司	APH UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,49 3	659,809 .61	0.1 8
29 2	CME GROUP INC	芝加哥商业交易所集团股 份有限	CME UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	480	659,488 .35	0.1 8
29 3	CATALENT INC	康泰伦特股份有限公司	CTL T UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	943	658,653 .45	0.1 8

29 4	EQUINIX INC	Equinix 有限公司	EQI X UQ	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	127	658,479 .29	0.1 8
29 5	AMERISOURCEBERGEN CORP	美源伯根	ABC UN	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	890	658,259 .00	0.1 8
29 6	CVS HEALTH CORP	CVS 保健公司	CVS UN	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,22 1	658,156 .54	0.1 8
29 6	EOG RESOURCES INC	EOG 资源	EOG UN	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,22 1	658,156 .54	0.1 8
29 7	WEYERHAEUSER CO	惠好	WY UN	美国 纽 约	美国	2,95 6	657,286 .23	0.1 8

				证 券 交 易 所				
29 8	CONAGRA BRANDS INC	康尼格拉品牌股份有限公司	CAG UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	2,79 6	657,111 .55	0.1 8
29 9	CITRIX SYSTEMS INC	思杰系统	CTX S UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	867	656,818 .33	0.1 8
30 0	CUMMINS INC	康明斯	CMI UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	417	656,790 .42	0.1 8
30 1	HESS CORP	赫斯公司	HES UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	1,16 4	656,607 .66	0.1 8

30 2	APACHE CORP	阿帕契	APA UQ	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	4,69 9	656,600 .49	0.1 8
30 3	MCDONALD'S CORP	麦当劳	MCD UN	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	440	656,576 .14	0.1 8
30 4	SYSCO CORP	Sysco 公司	SYN UN	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,30 7	656,470 .52	0.1 8
30 5	PINNACLE WEST CAPITAL	Pinnacle 西部资本	PNW UN	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,23 9	656,093 .12	0.1 8
30 6	ROSS STORES INC	Ross 商店有限公司	ROS T UQ	纳 斯 达 克	美国	819	656,061 .92	0.1 8

				证 券 交 易 所				
30 7	FORD MOTOR CO	福特汽车	F UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	6,83 2	655,852 .09	0.1 8
30 8	EXXON MOBIL CORP	埃克森美孚石油	XOM UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	1,60 9	655,672 .50	0.1 8
30 9	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	高知特科技公司	CTS H UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,46 5	655,479 .86	0.1 8
31 0	REALTY INCOME CORP	Realty Income 公司	O UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	1,52 0	655,343 .55	0.1 8

31 1	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	繁德信息技术有限公司	FIS UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	716	655,284 .89	0.1 8
31 2	AVALONBAY COMMUNITIES INC	AvalonBay 社区股份有限 公司	AVB UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	486	655,204 .92	0.1 8
31 3	TJX COMPANIES INC	TJX 公司	TJX UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,50 4	655,052 .07	0.1 8
31 4	SIMON PROPERTY GROUP INC	西蒙房地产集团公司	SPG UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	777	654,944 .06	0.1 8
31 5	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	保德信金融集团	PRU UN	美国 纽约	美国	989	654,684 .82	0.1 8

				证 券 交 易 所				
31 6	PTC Inc	PTC 公司	PTC UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	717	654,301 .02	0.1 8
31 7	INTEL CORP	英特尔	INT C UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,80 4	654,256 .71	0.1 8
31 8	FISERV INC	Fiserv 公司	FIS V UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	947	653,922 .52	0.1 8
31 9	US BANCORP	美国合众银行	USB UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,77 6	653,624 .65	0.1 8

320	INTL BUSINESS MACHINES CORP	国际商业机器	IBM UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	690	653,420 .38	0.1 8
321	EVERSOURCE ENERGY	Eversource 能源公司	ES UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,260	653,131 .61	0.1 8
322	BOEING CO/THE	波音	BA UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	422	653,079 .42	0.1 8
323	BROADCOM INC	博通股份有限公司	AVGO UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	212	653,052 .03	0.1 8
324	DUKE ENERGY CORP	杜克能源	DUK UN	美国 纽约	美国	1,024	653,046 .86	0.1 8

				证 券 交 易 所				
32 5	GLOBAL PAYMENTS INC	环汇有限公司	GPN UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	539	653,013 .14	0.1 8
32 6	NORTHROP GRUMMAN CORP	诺斯洛普格鲁门公司	NOC UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	278	652,686 .77	0.1 8
32 7	ARTHUR J GALLAGHER & CO	亚瑟加拉格尔有限公司	AJG UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	721	652,455 .11	0.1 8
32 8	ENTERGY CORP	Entergy 公司	ETR UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	1,01 3	652,444 .91	0.1 8

329	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	Archer-Daniels-Midland 公司	ADM UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,666	652,209.11	0.18
330	L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	L3Harris Technologies 股份有限公司	LHX UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	467	652,095.74	0.18
331	ABBVIE INC	艾伯维生物制药公司	ABB V UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	896	651,988.43	0.18
332	INVESCO LTD	景顺有限公司	IVZ UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	3,775	651,861.24	0.18
333	PACCAR INC	帕卡	PCAR UQ	纳 斯 达 克	美国	1,130	651,517.24	0.18

				证 券 交 易 所				
33 4	WABTEC CORP	西屋制动公司	WAB UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	1,22 5	651,291 .13	0.1 8
33 5	VENTAS INC	Ventas 公司	VTR UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	1,76 4	650,689 .70	0.1 8
33 6	SVB FINANCIAL GROUP	硅谷银行金融集团	SIV B UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	181	650,621 .41	0.1 8
33 7	LINCOLN NATIONAL CORP	林肯国民	LNC UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	1,60 1	649,930 .25	0.1 8

33 8	CITIZENS FINANCIAL GROUP	公民金融集团	CFG UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	2,19 3	649,840 .26	0.1 8
33 9	COCA-COLA CO/THE	可口可乐	KO UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,85 9	649,824 .62	0.1 8
34 0	MASCO CORP	马斯可	MAS UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,70 7	649,623 .59	0.1 8
34 1	INTERNATIONAL PAPER CO	国际纸业	IP UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,64 0	649,552 .72	0.1 8
34 2	WALMART INC	沃尔玛股份有限公司	WMT UN	美国 纽约	美国	713	649,545 .35	0.1 8

				证 券 交 易 所				
34 3	HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	JB Hunt 运输服务股份有 限公司	JBH T UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	617	649,499 .42	0.1 8
34 4	AFLAC INC	家庭人寿保险	AFL UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,87 2	648,926 .86	0.1 8
34 5	ROLLINS INC	Rollins 公司	ROL UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	2,93 7	648,887 .33	0.1 8
34 6	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	第一资本金融	COF UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	649	648,554 .05	0.1 8

347	CERNER CORP	塞纳公司	CERN UN	纳斯达克证券交易所	美国	1,284	648,319.10	0.18
348	AMERICAN WATER WORKS CO INC	美国自来水股份有限公司	AWK UN	美国纽约证券交易所	美国	651	648,197.58	0.18
349	EQUITY RESIDENTIAL	公寓物业权益信托	EQR UN	美国纽约证券交易所	美国	1,303	648,148.29	0.18
350	KANSAS CITY SOUTHERN	Kansas City Southern	KSU UN	美国纽约证券交易所	美国	354	648,031.88	0.18
351	YUM! BRANDS INC	百胜全球餐饮	YUM UN	美国纽约	美国	872	647,987.82	0.18

				证 券 交 易 所				
35 2	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	Healthpeak 物业股份有限 公司	PEA K UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	3,01 3	647,965 .92	0.1 8
35 3	WYNN RESORTS LTD	永利渡假村有限公司	WYN N UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	820	647,857 .59	0.1 8
35 4	PERRIGO CO PLC	Perrigo 公共有限公司	PRG O UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	2,18 7	647,779 .74	0.1 8
35 5	DUKE REALTY CORP	杜克房地产公司	DRE UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	2,11 7	647,560 .10	0.1 8

356	RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	雷神技术公司	RTX UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	1,175	647,555 .58	0.18
357	HP INC	惠普	HPQ UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	3,320	647,500 .99	0.18
358	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	Discover 金融服务公司	DFS UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	847	647,247 .95	0.18
359	JOHNSON & JOHNSON	强生	JNJ UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	608	647,056 .02	0.18
360	WESTROCK CO	WestRock 公司	WRK UN	美国 纽约	美国	1,882	647,043 .87	0.18

				证 券 交 易 所				
36 1	BAXTER INTERNATIONAL INC	百特	BAX UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	1,24 4	646,927 .33	0.1 8
36 2	RALPH LAUREN CORP	Ralph Lauren 公司	RL UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	850	646,904 .72	0.1 8
36 3	ASSURANT INC	安信龙集团	AIZ UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	641	646,729 .53	0.1 8
36 4	COMERICA INC	Comerica 公司	CMA UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	1,40 3	646,591 .54	0.1 8

36 5	EVEREST RE GROUP LTD	安富来集团有限公司	RE UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	397	646,319 .89	0.1 8
36 6	PROLOGIS INC	安博	PLD UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	837	646,311 .11	0.1 8
36 7	PVH CORP	PVH 公司	PVH UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	929	645,694 .17	0.1 8
36 8	CINCINNATI FINANCIAL CORP	辛辛那提金融	CIN F UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	857	645,643 .97	0.1 8
36 9	TRUIST FINANCIAL CORP	Truist 金融公司	TFC UN	美国 纽约	美国	1,80 0	645,363 .99	0.1 8

				证 券 交 易 所				
37 0	AVERY DENNISON CORP	艾利丹尼森	AVY UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	475	645,131 .43	0.1 8
37 1	ZIONS BANCORP NA	ZB NA-用于基本面	ZIO N UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,88 9	645,057 .39	0.1 8
37 2	PPG INDUSTRIES INC	PPG 工业	PPG UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	588	644,877 .93	0.1 8
37 3	HANESBRANDS INC	汉佰有限公司	HBI UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	5,34 5	644,660 .81	0.1 8

37 4	WILLIAMS COS INC	威廉姆斯公司	WMB UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	3,75 6	644,212 .80	0.1 8
37 5	CHURCH & DWIGHT CO INC	切迟杜威股份有限公司	CHD UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,17 0	644,119 .77	0.1 8
37 6	TRANSDIGM GROUP INC	TransDigm 集团公司	TDG UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	154	643,959 .95	0.1 8
37 7	FREEPORT-MCMORAN INC	自由港迈克墨伦股份有限 公司	FCX UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	2,68 6	643,926 .36	0.1 8
37 8	SNAP-ON INC	Snap-On 公司	SNA UN	美国 纽约	美国	446	643,747 .54	0.1 8

				证 券 交 易 所				
37 9	LAMB WESTON HOLDINGS INC	蓝威斯顿控股股份有限公 司	LW UN	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,23 5	643,523 .51	0.1 8
38 0	COMCAST CORP-CLASS A	康卡斯特	CMC SA UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,74 7	643,516 .01	0.1 8
38 1	CMS ENERGY CORP	CMS 能源	CMS UN	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,68 6	643,483 .33	0.1 8
38 2	VISA INC-CLASS A SHARES	维萨公司	V UN	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	426	643,473 .25	0.1 8

38 3	GENERAL MOTORS CO	通用汽车公司	GM UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,68 3	643,316 .85	0.1 8
38 4	JUNIPER NETWORKS INC	瞻博网络股份有限公司	JNP R UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	3,64 1	643,305 .48	0.1 8
38 5	HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	Huntington Ingalls 工业 公司	HII UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	472	642,611 .99	0.1 8
38 6	KINDER MORGAN INC	特拉华州金德摩根公司	KMI UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	5,45 4	642,304 .62	0.1 8
38 7	WW GRAINGER INC	固安捷公司	GWV UN	美国 纽约	美国	227	642,301 .90	0.1 8

				证 券 交 易 所				
38 8	WESTERN DIGITAL CORP	西部数据公司	WDC UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,39 7	642,292 .15	0.1 8
38 9	LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	Live Nation 娱乐公司	LYV UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,13 5	642,228 .58	0.1 8
39 0	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	Walgreens Boots Alliance 公司	WBA UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,88 9	642,006 .61	0.1 8
39 1	NORTONLIFELOCK INC	诺顿 LifeLock 股份有限 公司	NLO K UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	3,65 1	642,006 .16	0.1 8

39 2	ALLIANT ENERGY CORP	Alliant 能源公司	LNT UQ	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	1,78 2	641,903 .44	0.1 8
39 3	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	哈特福德金融服务	HIG UN	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,60 3	641,732 .83	0.1 8
39 4	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	Interpublic 集团	IPG UN	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,05 6	641,419 .71	0.1 8
39 5	Viatis Inc	Viatis Inc	VTR S UQ	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	6,94 7	641,311 .12	0.1 8
39 6	JM SMUCKER CO/THE	JM 斯马克公司	SJM UN	美国 纽 约	美国	766	641,168 .93	0.1 8

				证 券 交 易 所				
39 7	MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	万豪国际	MAR UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	727	641,165 .18	0.1 8
39 8	EASTMAN CHEMICAL CO	伊士曼化工	EMN UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	850	641,084 .17	0.1 8
39 9	JPMORGAN CHASE & CO	摩根大通	JPM UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	638	641,064 .92	0.1 8
40 0	CHUBB LTD	安达保险有限公司	CB UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	624	640,703 .42	0.1 8

40 1	EDISON INTERNATIONAL	爱迪生国际	EIX UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,71 3	639,844 .87	0.1 8
40 2	INGERSOLL-RAND INC	英格索兰股份有限公司	IR UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	2,02 7	639,148 .53	0.1 8
40 3	LAS VEGAS SANDS CORP	拉斯维加斯金沙集团	LVS UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,87 6	638,557 .89	0.1 8
40 4	FMC CORP	FMC 公司	FMC UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	913	638,171 .31	0.1 8
40 5	EXPEDIA GROUP INC	亿客行集团股份有限公司	EXP E UQ	纳 斯 达 克	美国	603	637,722 .53	0.1 8

				证 券 交 易 所				
40 6	MOHAWK INDUSTRIES INC	Mohawk 工业股份有限公 司	MHK UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	513	636,923 .68	0.1 8
40 7	PARKER HANNIFIN CORP	派克汉尼汾	PH UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	321	636,851 .58	0.1 8
40 8	NORFOLK SOUTHERN CORP	诺福克南方	NSC UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	371	636,107 .38	0.1 8
40 9	BOOKING HOLDINGS INC	Booking 控股股份有限公 司	BKN G UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	45	636,087 .61	0.1 8

410	PACKAGING CORP OF AMERICA	美国包装公司	PKG UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	727	635,999 .04	0.1 8
411	NISOURCE INC	NiSource 公司	NI UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	4,014	635,305 .61	0.1 8
412	FIFTH THIRD BANCORP	五三银行	FITB UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,572	635,205 .87	0.1 8
413	FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	FleetCor 技术股份有限公司	FLT UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	384	635,202 .51	0.1 8
414	HORMEL FOODS CORP	荷美尔食品有限公司	HRL UN	美国 纽 约	美国	2,059	635,139 .27	0.1 8

				证 券 交 易 所				
41 5	UNION PACIFIC CORP	联合太平洋	UNP UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	447	635,084 .10	0.1 8
41 6	EVERGY INC	Evergy 股份有限公司	EVR G UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	1,62 6	634,764 .13	0.1 8
41 7	VULCAN MATERIALS CO	Vulcan 材料	VMC UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	564	634,223 .42	0.1 8
41 8	C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	罗宾逊全球物流有限公司	CHR W UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,04 8	634,163 .21	0.1 8

41 9	HENRY SCHEIN INC	亨利香恩公司	HSI C UQ	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	1,32 3	634,080 .59	0.1 8
42 0	DXC TECHNOLOGY CO	DXC 技术公司	DXC UN	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,52 0	633,921 .86	0.1 8
42 1	CONSOLIDATED EDISON INC	联合爱迪生	ED UN	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,36 8	633,819 .53	0.1 8
42 2	ACTIVISION BLIZZARD INC	动视暴雪股份有限公司	ATV I UQ	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	1,02 8	633,815 .40	0.1 8
42 3	SOUTHERN CO/THE	南方公司	SO UN	美国 纽 约	美国	1,62 1	633,649 .96	0.1 8

				证 券 交 易 所				
42 4	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	亚历山大房地产股份有限 公司	ARE UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	539	633,513 .97	0.1 8
42 5	KRAFT HEINZ CO/THE	卡夫亨氏公司	KHC UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,40 4	633,316 .68	0.1 8
42 6	REGENCY CENTERS CORP	Regency Centers 公司	REG UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,53 0	633,264 .87	0.1 8
42 7	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	美国国际集团	AIG UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	2,05 9	633,144 .06	0.1 8

42 8	ORACLE CORP	甲骨文	ORCL UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,259	633,093 .42	0.1 8
42 9	TAPESTRY INC	TPR-DRS-RS	TPR UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	2,253	632,834 .24	0.1 8
43 0	PPL CORP	PPL 公司	PPL UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	3,502	632,772 .87	0.1 8
43 1	CENTERPOINT ENERGY INC	中点能源	CNP UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	3,992	632,339 .39	0.1 8
43 2	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	Pioneer 自然资源公司	PXD UN	美国 纽约	美国	602	632,037 .06	0.1 8

				证 券 交 易 所				
43 3	VERIZON COMMUNICATIONS INC	Verizon 通信股份有限公 司	VZ UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	1,74 4	631,257 .20	0.1 8
43 4	M & T BANK CORP	M&T 银行	MTB UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	672	630,817 .91	0.1 8
43 5	DENTSPLY SIRONA INC	登士柏西诺德公司	XRA Y UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,54 3	630,571 .52	0.1 8
43 6	UNUM GROUP	尤那姆集团	UNM UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	3,43 5	630,208 .60	0.1 8

43 7	KEYCORP	KeyCorp 公司	KEY UN	美国 纽约 证券 交易 所	美国	4,72 2	629,919 .83	0.1 8
43 8	WEC ENERGY GROUP INC	WEC 能源集团股份有限公司	WEC UN	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,09 6	629,789 .98	0.1 8
43 9	DUPONT DE NEMOURS INC	杜邦公司	DD UN	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,25 9	629,596 .11	0.1 8
44 0	LUMEN TECHNOLOGIES INC	世纪电信公司	LUM N UN	美国 纽约 证券 交易 所	美国	7,16 6	629,122 .91	0.1 8
44 1	CORNING INC	康宁公司	GLW UN	美国 纽约	美国	2,38 1	629,103 .27	0.1 8

				证 券 交 易 所				
44 2	NEXTERA ENERGY INC	新纪元能源公司	NEE UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	1,328	628,670 .06	0.18
44 3	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	微芯科技股份有限公司	MCH P UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	649	627,800 .66	0.18
44 4	DELTA AIR LINES INC	达美航空有限公司	DAL UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	2,245	627,396 .51	0.18
44 5	BOSTON PROPERTIES INC	波士顿地产公司	BXP UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	847	627,002 .64	0.18

44 6	DOMINION ENERGY INC	Dominion 能源公司	D UN	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,31 9	626,880 .55	0.1 8
44 7	BORGWARNER INC	博格华纳股份有限公司	BWA UN	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,99 7	626,205 .79	0.1 8
44 8	HALLIBURTON CO	哈利伯顿	HAL UN	美国 纽约 证券 交易 所	美国	4,18 5	625,061 .19	0.1 8
44 9	DIGITAL REALTY TRUST INC	数字房地产信托有限公司	DLR UN	美国 纽约 证券 交易 所	美国	643	624,987 .41	0.1 8
45 0	UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	美国联合航空控股股份有 限公司	UAL UQ	纳 斯 达 克	美国	1,84 7	623,914 .07	0.1 7

				证 券 交 易 所				
45 1	PHILLIPS 66	Phillips 66	PSX UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	1,12 5	623,706 .50	0.1 7
45 2	SOUTHWEST AIRLINES CO	西南航空	LUV UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	1,81 3	621,798 .64	0.1 7
45 3	NORWEGIAN CRUISE LINE HLDGS LTD	挪威邮轮控股有限公司	NCL H UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	3,27 1	621,462 .33	0.1 7
45 4	ALASKA AIR GROUP INC	阿拉斯加航空集团公司	ALK UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	1,59 4	621,036 .16	0.1 7

45 4	HILTON WORLDWIDE HLDGS INC	希尔顿全球控股股份有限 公司	HLT UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	797	621,036 .16	0.1 7
45 5	FRANKLIN RESOURCES INC	富兰克林资源	BEN UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	3,00 1	620,182 .46	0.1 7
45 6	MOSAIC CO/THE	Mosaic 公司	MOS UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	3,00 4	619,249 .94	0.1 7
45 7	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	慧与	HPE UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	6,57 0	618,816 .86	0.1 7
45 8	SCHLUMBERGER LTD	斯伦贝谢公众有限公司	SLB UN	美国 纽约	美国	2,99 2	618,709 .10	0.1 7

				证 券 交 易 所				
45 9	ECOLAB INC	艺康集团	ECL UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	464	617,392 .27	0.1 7
46 0	F5 NETWORKS INC	F5 Networks 公司	FFI V UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	512	617,391 .24	0.1 7
46 1	IRON MOUNTAIN INC	美国铁山公司	IRM UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	2,25 5	616,497 .68	0.1 7
46 2	DOW INC	Dow Inc	DOW UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	1,50 8	616,463 .05	0.1 7

46 3	HASBRO INC	孩之宝	HAS UQ	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	1,00 8	615,493 .52	0.1 7
46 4	Penn National Gaming Inc	Penn 国家博彩股份有限 公司	PEN N UQ	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	1,24 5	615,195 .65	0.1 7
46 5	CARDINAL HEALTH INC	康德乐公司	CAH UN	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,66 8	615,170 .26	0.1 7
46 6	UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	Universal Health Ser vices 公司	UHS UN	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	650	614,869 .09	0.1 7
46 7	METLIFE INC	大都会集团	MET UN	美国 纽 约	美国	1,58 8	613,979 .53	0.1 7

				证 券 交 易 所				
46 8	VORNADO REALTY TRUST	沃那多房地产信托	VNO UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	2,03 4	613,236 .49	0.1 7
46 9	Host Hotels & Resorts Inc	豪斯特酒店及度假村	HST UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	5,55 4	613,178 .87	0.1 7
47 0	TRAVELERS COS INC/THE	St Paul Travelers	TRV UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	634	613,167 .76	0.1 7
47 1	SEAGATE TECHNOLOGY	希捷科技公司	STX UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,07 8	612,343 .45	0.1 7

47 2	TYSON FOODS INC-CL A	泰森食品公司	TSN UN	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,28 5	612,298 .61	0.1 7
47 3	AMCOR PLC	Amcor PLC	AMC R UN	美国 纽约 证券 交易 所	美国	8,24 6	610,474 .02	0.1 7
47 4	VALERO ENERGY CORP	Valero 能源	VLO UN	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,21 0	610,329 .58	0.1 7
47 5	GLOBE LIFE INC	Globe Life 股份有限公司	GL UN	美国 纽约 证券 交易 所	美国	991	609,786 .60	0.1 7
47 6	CHEVRON CORP	雪佛龙	CVX UN	美国 纽约	美国	901	609,644 .42	0.1 7

				证 券 交 易 所				
47 7	BAKER HUGHES CO	贝克休斯公司	BKR UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	4,12 5	609,437 .76	0.1 7
47 8	LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV-CL A	利安德巴塞尔工业公司	LYB UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	917	609,392 .80	0.1 7
47 9	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	皇家加勒比海游轮有限公司	RCL UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	1,10 5	608,763 .65	0.1 7
48 0	NIELSEN HOLDINGS PLC	尼尔森控股公开有限公司	NLS N UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	3,81 6	608,158 .47	0.1 7

48 1	NEWMONT CORP	纽蒙公司	NEM UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,48 4	607,610 .65	0.1 7
48 2	NUCOR CORP	纽柯公司	NUE UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	979	606,703 .33	0.1 7
48 3	CITIGROUP INC	花旗集团	C UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,32 6	606,051 .05	0.1 7
48 4	ALTRIA GROUP INC	高特利	MO UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,96 7	605,870 .56	0.1 7
48 5	WESTERN UNION CO	西联汇款	WU UN	美国 纽约	美国	4,07 0	603,941 .18	0.1 7

				证 券 交 易 所				
48 6	MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	莫尔森库尔斯饮料公司	TAP UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	1, 74 1	603, 853 . 26	0. 1 7
48 7	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	人民联合金融股份有限公 司	PBC T UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	5, 44 9	603, 346 . 60	0. 1 7
48 8	WILLIS TOWERS WATSON PLC	韦莱韬睿惠悦公共有限公 司	WLT W UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	405	601, 810 . 64	0. 1 7
48 9	CARNIVAL CORP	嘉年华公司	CCL UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	3, 50 5	596, 860 . 27	0. 1 7

49 0	NOV INC	美国国民油井	NOV UN	美国 纽约 证券 交易 所	美国	6,02 0	595,791 .77	0.1 7
49 1	REGIONS FINANCIAL CORP	地区金融公司	RF UN	美国 纽约 证券 交易 所	美国	4,56 3	594,854 .66	0.1 7
49 2	AMERICAN AIRLINES GROUP INC	美国航空集团公司	AAL UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	4,30 2	589,454 .54	0.1 7
49 3	BIOGEN INC	百健	BII B UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	263	588,314 .91	0.1 6
49 4	NEWS CORP – CLASS A	新闻集团	NWS A UQ	纳 斯 达 克	美国	2,95 9	492,604 .78	0.1 4

				证 券 交 易 所				
49 5	FOX CORP - CLASS A	福克斯公司	FOX A UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,91 3	458,858 .90	0.1 3
49 6	DISCOVERY INC-C	探索通信公司	DIS CK UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,25 9	422,915 .74	0.1 2
49 7	UNDER ARMOUR INC-CLASS A	安德玛公司	UAA UN	美 国 纽 约 证 券 交 易 所	美 国	2,57 3	351,551 .86	0.1 0
49 8	ALPHABET INC-CL A	Alphabet 公司	GOO GL UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	21	331,258 .36	0.0 9

49 9	ALPHABET INC-CL C	Alphabet 公司	GOO G UQ	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	20	323,821 .56	0.0 9
50 0	UNDER ARMOUR INC-CLASS C	安德玛公司	UA UN	美国 纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,65 8	318,864 .46	0.0 9
50 1	DISCOVERY INC - A	探索通信公司	DIS CA UQ	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	1,26 7	251,114 .16	0.0 7
50 2	FOX CORP - CLASS B	福克斯公司	FOX UQ	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	879	199,880 .66	0.0 6
50 3	NEWS CORP - CLASS B	新闻集团	NWS UQ	纳斯达克	美国	934	146,921 .41	0.0 4

				证 券 交 易 所				
--	--	--	--	-----------------------	--	--	--	--

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	Enphase Energy Inc	ENPH UQ	873,647.63	0.40
2	TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	TDY UN	811,425.28	0.37
3	Penn National Gaming Inc	PENN UQ	789,475.36	0.36
4	Charles River Laboratories International Inc.	CRL UN	725,463.87	0.33
5	NXP SEMICONDUCTORS NV	NXPI UQ	716,767.38	0.33
6	PTC Inc	PTC UQ	666,496.90	0.30
7	Monolithic Power Systems	MPWR UQ	657,300.09	0.30
8	Organon & Co	OGN UN	642,229.05	0.29
9	Trimble Inc	TRMB UQ	628,767.18	0.29
10	CONOCOPHILLIPS	COP UN	617,574.97	0.28
11	Generac Holdings Inc	GNRC UN	614,387.81	0.28
12	Caesars Entertainment, Inc.	CZR UQ	573,587.51	0.26
13	MARKETAXESS HOLDINGS INC	MKTX UQ	428,193.30	0.19
14	NEWS CORP – CLASS B	NWS UQ	422,457.86	0.19
15	FOX CORP – CLASS B	FOX UQ	417,528.70	0.19
16	PAYCOM SOFTWARE INC	PAYC UN	416,450.22	0.19
17	VIACOMCBS INC –	VIAC UQ	412,013.92	0.19

	CLASS B			
18	HOLOGIC INC	HOLX UQ	398,462.97	0.18
19	PFIZER INC	PFE UN	388,084.21	0.18
20	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	VRTX UQ	384,777.55	0.17

注：本期累计买入金额指买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

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	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	VAR UN	651,726.67	0.30
2	FLIR SYSTEMS INC	FLIR UQ	617,615.16	0.28
3	HOLLYFRONTIER CORP	HFC UN	599,584.41	0.27
4	XEROX HOLDINGS CORP	XRX UN	562,233.32	0.26
5	SL GREEN REALTY CORP	SLG UN	542,260.88	0.25
6	FLOWSERVE CORP	FLS UN	542,257.62	0.25
7	VONTIER CORP	VNT UN	540,985.23	0.25
8	VIACOMCBS INC – CLASS B	VIAC UQ	538,652.41	0.24
9	CONCHO RESOURCES INC	CXO UN	509,014.37	0.23
10	CONOCOPHILLIPS	COP UN	447,845.82	0.20
11	TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	TDY UN	430,499.60	0.20
12	TIFFANY & CO	TIF UN	412,053.67	0.19
13	NEWS CORP – CLASS B	NWS UQ	411,663.61	0.19
14	NUCOR CORP	NUE UN	400,557.37	0.18
15	FOX CORP – CLASS B	FOX UQ	361,334.41	0.16
16	TECHNIPFMC PLC	FTI UN	360,247.61	0.16
17	DXC TECHNOLOGY CO	DXC UN	353,746.05	0.16
18	DISCOVERY INC – A	DISCA UQ	337,145.45	0.15
19	BIOGEN INC	BIIB UQ	313,637.42	0.14
20	ALPHABET INC-CL A	GOOGL UQ	308,362.90	0.14

注：本期累计卖出金额指卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

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	137,253,998.65
卖出收入（成交）总额	48,417,818.28

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），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未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	应收证券清算款	—
3	应收股利	318,223.12
4	应收利息	738.73

5	应收申购款	2,181,949.23
6	其他应收款	—
7	待摊费用	122,048.34
8	其他	—
9	合计	2,622,959.42

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

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 (%)
47,025	3,446.47	31,081,733.00	19.18	130,988,598.12	80.82

注：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	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	47,219.18	0.0291

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	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
----	--------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 3 月 23 日）基金份额总额	822,754,222.26
本报告期期初基金份额总额	112,448,859.42
本报告期基金总申购份额	117,974,210.85
减：本报告期基金总赎回份额	68,352,739.15
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	162,070,331.12

§ 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

基金管理人报告期内无重大人事变动。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

无

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

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

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

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	
摩根士丹利	1	182,609,667.65	100.00%	54,777.43	100.00%	-

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

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

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

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

券商服务出现重大失误或其他异常情况时，及时报公司监察稽核部及相关领导。可暂停与该券商

的合作，并对其失误所造成的损失进行追偿。

2、本报告期内本基金无新增或退租境外交易单元。

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	关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 6 月 30 日
2	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加平安银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 6 月 28 日
3	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加海银基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 5 月 27 日
4	大成标普 500 等权重指数证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 4 月 23 日
5	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 4 月 22 日
6	大成标普 500 等权重指数证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 30 日
7	大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 30 日
8	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 30 日
9	大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 30 日
10	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 23 日
11	关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金恢复大额申购（含定期定额申购）业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 11 日

12	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加鼎信汇金（北京）投资管理有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 11 日
13	大成标普 500 等权重指数证券投资基金第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 1 月 22 日
14	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加江苏银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 1 月 16 日
15	大成基金管理有限公司关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2020 年度第一次分红的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 1 月 14 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

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、本报告期内在指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

2021 年 8 月 31 日