

# 嘉实美国成长股票型证券投资基金 2020 年中期报告

2020 年 06 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2020 年 08 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。本中期报告已经全部独立董事签字同意，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 2020 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 6 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>6</b>
2.1 基金基本情况 .....	6
2.2 基金产品说明 .....	6
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	6
2.4 境外资产托管人 .....	7
2.5 信息披露方式 .....	7
2.6 其他相关资料 .....	7
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	7
3.2 基金净值表现 .....	8
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	13
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 .....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	15

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	15
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.....	15
<b>§ 5 托管人报告 .....</b>	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	16
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.....	16
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 .....	16
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计） .....</b>	<b>16</b>
6.1 资产负债表 .....	16
6.2 利润表 .....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	19
6.4 报表附注.....	20
<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 .....	40
7.3 期末按行业分类的权益投资组合 .....	40
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	41
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	62
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....	64
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 .....	64
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 .....	64
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 .....	64

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 .....	64
7.11 投资组合报告附注 .....	65
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>65</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	65
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	66
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 .....	66
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>67</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>67</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	67
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 .....	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	68
10.4 基金投资策略的改变 .....	68
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	68
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 .....	68
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	68
10.8 其他重大事件 .....	69
<b>§ 11 备查文件目录 .....</b>	<b>70</b>
11.1 备查文件目录 .....	70
11.2 存放地点 .....	70
11.3 查阅方式 .....	70

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实美国成长股票型证券投资基金	
基金简称	嘉实美国成长股票（QDII）	
基金主代码	000043	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 6 月 14 日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	374,047,171.52 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实美国成长股票型证券投资基 金-人民币	嘉实美国成长股票型证券投资基 金-美元现汇
下属分级基金的交易代码	000043	000044
报告期末下属分级基金的份 额总额	370,262,426.65 份	3,784,744.87 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于美国大盘成长型股票，在股票选择及组合构建方面均运用量化投资方法并结合风险管理手段，力争获取长期资本增值。
投资策略	本基金采用主动的量化投资策略。本基金将依托内部自主研发的定量投资模型以及强大的数据库系统，构建投资组合。其中，核心模型包括成长性模型、多因子 Alpha 模型、风险预测模型、交易成本模型以及先进的投资组合优化器。嘉实量化投资团队将根据市场外在与内在变化趋势，定期或不定期地对模型进行复核，并做出相应调整，以不断改善模型的适用性。
业绩比较基准	95%×罗素 1000 成长指数收益率+5%×境内银行活期存款税后利率
风险收益特征	本基金主要投资于美国大盘成长型股票，属于主动投资的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金与混合型基金，为证券投资基金中的较高预期风险、较高预期收益的投资品种。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人姓名	胡勇钦	许俊

责人	联系电话	(010)65215588	010-66594319
	电子邮箱	service@jsfund.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-600-8800	95566
传真		(010)65215588	(010)66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期27楼09-14单元	北京西城区复兴门内大街1号
办公地址		北京市朝阳区建国门外大街21号北京国际俱乐部C座写字楼12A层	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码		100005	100818
法定代表人		经雷	刘连舸

## 2.4 境外资产托管人

本基金基金托管人尚未委托任何第三方机构担任本基金的境外托管人。本基金的境外资产托管业务由基金托管人中国银行股份有限公司承担。

## 2.5 信息披露方式

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

## 2.6 其他相关资料

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

# § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年01月01日-2020年06月30日)	
	嘉实美国成长股票型证券投资 基金-人民币	嘉实美国成长股票型证券投资 基金-美元现汇
本期已实现收益	2,215,620.37	-33,157.61
本期利润	112,353,362.13	3,732,113.80
加权平均基金份额本期利润	0.3314	0.9934

本期加权平均净值利润率	15.31%	7.54%
本期基金份额净值增长率	10.11%	8.52%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年06月30日)	
期末可供分配利润	107,313,734.75	9,571,723.53
期末可供分配基金份额利润	0.2898	2.5290
期末基金资产净值	886,985,075.85	55,297,544.46
期末基金份额净值	2.396	2.064
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	139.60%	106.40%

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）嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币份额以人民币申购获得人民币份额，赎回获得人民币赎回款；嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇份额以美元申购获得美元份额，赎回获得美元赎回款；（3）上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；（4）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；（5）嘉实美国成长股票（QDII）美元现汇的期末基金份额净值单位为美元。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.81%	1.60%	4.06%	1.61%	-0.25%	-0.01%
过去三个月	25.58%	1.73%	26.02%	1.81%	-0.44%	-0.08%
过去六个月	10.11%	2.69%	8.97%	2.76%	1.14%	-0.07%
过去一年	21.13%	1.95%	20.97%	2.00%	0.16%	-0.05%
过去三年	56.50%	1.42%	58.98%	1.40%	-2.48%	0.02%
自基金合同生	139.60%	1.11%	149.43%	1.08%	-9.83%	0.03%

效起至今						
嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇						
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	4.56%	1.57%	4.06%	1.61%	0.50%	-0.04%
过去三个月	25.70%	1.73%	26.02%	1.81%	-0.32%	-0.08%
过去六个月	8.52%	2.67%	8.97%	2.76%	-0.45%	-0.09%
过去一年	17.61%	1.94%	20.97%	2.00%	-3.36%	-0.06%
过去三年	48.92%	1.40%	58.98%	1.40%	-10.06%	0.00%
自基金合同生 效起至今	106.40%	1.09%	149.43%	1.08%	-43.03%	0.01%

注:本基金业绩比较基准为: 95%×罗素 1000 成长指数收益率+5%×境内银行活期存款税后利率

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算, 计算方式如下:

$$\text{Benchmark}(0) = 1000$$

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

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

其中  $t=1, 2, 3, \dots$ 。

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

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

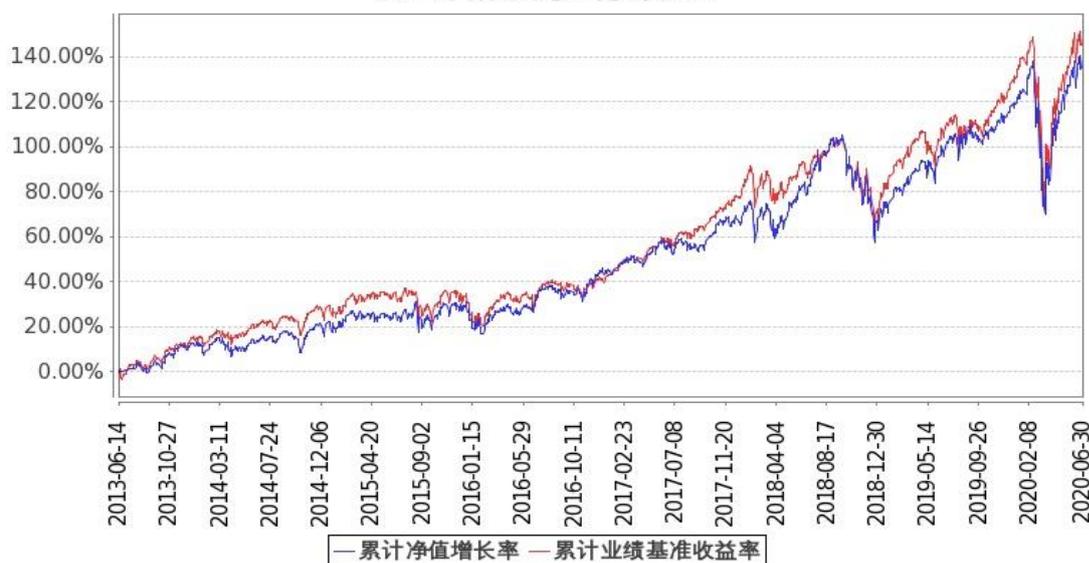


图 1：嘉实美国成长股票(QDII)人民币基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013 年 6 月 14 日至 2020 年 6 月 30 日)

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

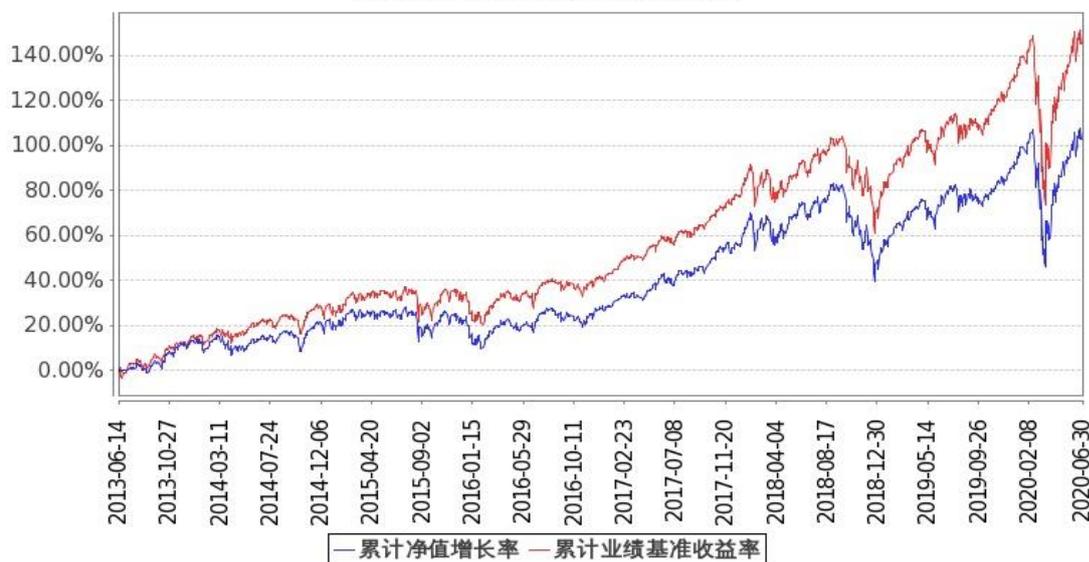


图 2：嘉实美国成长股票(QDII)美元现汇基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013 年 6 月 14 日至 2020 年 6 月 30 日)

注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结

束时本基金的各项投资比例符合基金合同“第十四部分（三）投资范围和（九）投资限制”的有关约定。

## § 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

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司，成立于 1999 年 3 月 25 日，是经中国证监会批准设立的第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，公司总部设在北京，在北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和 QDII、特定资产管理业务资格。

截止 2020 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 190 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深 300ETF 联接（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票（QDII）混合、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数（LOF）、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势混合、嘉实 H 股指数（QDII）、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实黄金（QDII-FOF-LOF）、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产（QDII）、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数（LOF）、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票（QDII）、嘉实丰益策略定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝 A/B、嘉实活期宝货币、嘉实 1 个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券 A/E、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实快线货币、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航混合、嘉实新财富混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、

嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽混合（LOF）、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实研究增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安 6 个月定期债券、嘉实稳元纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实稳熙纯债债券、嘉实丰和混合、嘉实新添华定期混合、嘉实定期宝 6 个月理财债券、嘉实现金添利货币、嘉实沪港深回报混合、嘉实原油（QDII-LOF）、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实稳宏债券、嘉实中关村 A 股 ETF、嘉实稳华纯债债券、嘉实 6 个月理财债券、嘉实稳怡债券、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实创业板 ETF、嘉实新添泽定期混合、嘉实新添丰定期混合、嘉实新添辉定期混合、嘉实领航资产配置混合（FOF）、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康股票、嘉实润泽量化定期混合、嘉实核心优势股票、嘉实润和量化定期混合、嘉实金融精选股票、嘉实新添荣定期混合、嘉实致兴定期纯债债券、嘉实战略配售混合、嘉实瑞享定期混合、嘉实新添康定期混合、嘉实资源精选股票、嘉实致盈债券、嘉实恒生港股通新经济指数（LOF）、嘉实中短债债券、嘉实致享纯债债券、嘉实互通精选股票、嘉实互融精选股票、嘉实养老 2040 混合（FOF）、嘉实消费精选股票、嘉实新添元定期混合、嘉实中债 1-3 政金债指数、嘉实养老 2050 混合（FOF）、嘉实长青竞争优势股票、嘉实科技创新混合、嘉实基本面 50ETF、嘉实稳联纯债债券、嘉实汇达中短债债券、嘉实养老 2030 混合（FOF）、嘉实致元 42 个月定期债券、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF、嘉实新添益定期混合、嘉实融享货币、嘉实瑞虹三年定期混合、嘉实价值成长混合、嘉实央企创新驱动 ETF、嘉实新兴科技 100ETF、嘉实致安 3 个月定期债券、嘉实汇鑫中短债债券、嘉实新兴科技 100ETF 联接、嘉实致华纯债债券、嘉实商业银行精选债券、嘉实央企创新驱动 ETF 联接、嘉实致禄 3 个月定期纯债债券、嘉实民企精选一年定期债券、嘉实先进制造 100 ETF、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF 联接、嘉实安元 39 个月定期纯债债券、嘉实中债 3-5 年国开行指数、嘉实鑫和一年持有期混合、嘉实致融一年定期债券、嘉实瑞熙三年封闭运作混合、嘉实中证 500 指数增强、嘉实回报精选股票、嘉实致宁 3 个月定开纯债债券、嘉实中证 500 成长估值 ETF、嘉实瑞和两年持有期混合、嘉实基础产业优选股票、嘉实中证主要消费 ETF 联接 A/C、嘉实医药健康 100ETF、嘉实稳福混合、嘉实瑞成两年持有期混合、嘉实致益纯债债券、嘉实精选平衡混合、嘉实致信一年定期纯债债券。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券属于嘉实理财通系列基金。同时，基金管理人还管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

		任职日期	离任日期		
张自力	本基金、嘉实事件驱动股票基金经理	2013 年 6 月 14 日		24 年	曾任美国世纪投资管理公司（American Century Investments）资深副总经理，研究部总监暨基金经理，负责直接管理、支持公司旗下近二百亿美元的多项大型公募基金和对冲基金类产品。2012 年 2 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任定量投资部负责人，现任人工智能投资部负责人。理论物理学博士，毕业于美国德州大学奥斯汀分校和中国科学技术大学，美国国籍。

注：（1）任职日期是指本基金基金合同生效之日；（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单

边交易量超过该证券当日成交量的 5%的，合计 1 次，为旗下组合被动跟踪标的指数需要，与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 开年，美国股票市场整体上延续了多年牛市，继续稳健上行。在 2 月份经历了历史性的深度回调，美股熔断多次，并在一季度末反弹。

今年市场主要的风险驱动因素，是疫情对经济的影响，尤其是对疫情估计不足到发现疫情超预期发展的预期差导致一季度中下旬的市场快速下行。在美联储快速强力的刺激下，资本市场反弹，但宽松的货币政策对经济体内不同区域的作用有显著差异，导致上半年道指负收益，而纳斯达克在 V 型反弹后继续创出历史新高，并且在高科技企业的带动下，半年度达到超过 16% 的涨幅。

风险层面，中美贸易摩擦由于目前处于一阶段协议执行期内而较为稳定，导致市场情绪波动和估值回落的主要是疫情发展和预期分歧。风格层面，流动性的变化、实际无风险收益率的下行，利于成长股，导致高科技板块估值进一步提升。美股强势表现的主要驱动因素，除了本期内的流动性宽松变化以外，依然还有来自于企业层面盈利能力的持续性和稳健性，而非估值维度的单方面扩张。

投资业绩上，本基金纯股票头寸相对业绩基准取得了显著的正超额收益，受仓位水平、较高的交易成本和换汇成本的影响，组合净值层面的收益略有减损，费后净值依然显著战胜基准指数。

行业上，本基金主要配置于信息科技等行业，以高科技龙头企业为主要配置，除传统的几大科技公司外，还包括新兴人工智能的龙头公司，生物医药领域的高科技企业等，此外还配置非必须消费品等行业，并通过部分价值维度的补充来控制风格暴露的风险。

本报告期间，本基金运作主要包括应对净申赎造成的仓位波动和实现对美国成长股的筛选与投资过程。本基金资金运作流程较长，单向包括从人民币申购、确认、换汇和掉汇等一系列步骤，涉及国内外券商和银行的多个环节，在市场大幅震荡背景下，申赎的不确定性会直接影响仓位水平并影响投资业绩，本基金在保证 90% 股票仓位和 5% 现金仓位的合规约束下，成功实现了流动性操作。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币基金份额净值为 2.396 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.11%；截至本报告期末嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇基金份额净值为 2.064 美元，本报告期基金份额净值增长率为 8.52%；业绩比较基准收益率为 8.97%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为，站在当前时点，仍然是投资美股较好的进入机会，核心逻辑依旧是建立在美国上市公司企业盈利依然稳健的基础上，同时美联储创造的宽松的流动性环境，对本产品的主要方向即大盘成长股是利好方向。

在股票市场层面，随着美股整体上盈利能力在经过疫情风险预期的调整后继续向好的背景下，主要基于流动性的角度，相对于预期收益的预判而言，我们更加强调市场内部结构的特征，宽松的流动性环境利于成长股，并且在大类资产配置层面，黄金资产以及相关的股票标的也受益。

在风险层面，资本市场逐步消化美国疫情失控的预期，但下半年将迎来美国总统选战，美国两党之间的争斗以及为了竞选而打出了全球政治经济军事的超预期手段，将是资本市场较大的超预期来源，既是风险也是机会。。

在行业层面，我们依然倾向于成长风格，科技、生物等依然是投资者最关注的区域。

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

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构为纽约、纳斯达克交易所以及境内相关机构等。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同（十九（三）收益分配原则）约定，报告期内本基金未实施利润分配，符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：嘉实美国成长股票型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	90,650,478.15	43,948,155.63
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	892,035,365.26	544,350,717.17
其中：股票投资		887,265,767.64	541,140,957.44
基金投资		4,769,597.62	3,209,759.73
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,516,406.32	-
应收利息	6.4.7.5	5,287.40	6,402.98
应收股利		264,234.48	343,915.09
应收申购款		22,280,802.76	9,547,797.95
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,006,752,574.37	598,196,988.82
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年6月30日</b>	<b>上年度末 2019年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	7,398,444.62
应付赎回款		62,446,140.06	7,265,919.92
应付管理人报酬		1,402,269.95	838,841.06
应付托管费		272,663.61	163,107.98
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		29,352.53	17,049.60
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	319,527.91	212,617.87
负债合计		64,469,954.06	15,895,981.05
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	393,576,904.48	267,807,042.89
未分配利润	6.4.7.10	548,705,715.83	314,493,964.88
所有者权益合计		942,282,620.31	582,301,007.77
负债和所有者权益总计		1,006,752,574.37	598,196,988.82

注：报告截止日2020年6月30日，嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币基金份额净值2.396元，基金份额总额370,262,426.65份；嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇基金份额净值2.064美元，基金份额总额3,784,744.87份。基金份额总额合计为374,047,171.52份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉实美国成长股票型证券投资基金

本报告期：2020年1月1日至2020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
-----	-----	----	---------

		2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		125,158,425.70	92,845,282.75
1. 利息收入		133,023.81	68,386.88
其中：存款利息收入	6.4.7.11	133,023.81	68,386.88
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）		10,931,535.64	-2,672,393.49
其中：股票投资收益	6.4.7.12	6,796,723.52	-5,175,229.90
基金投资收益	6.4.7.13	486,860.31	-210,769.00
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	3,647,951.81	2,713,605.41
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	113,903,013.17	94,836,622.52
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.21	-1,216,612.81	55,534.27
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	1,407,465.89	557,132.57
减：二、费用		9,072,949.77	5,791,518.62
1. 管理人报酬		6,980,449.32	4,763,021.61
2. 托管费		1,357,309.62	926,143.06
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	617,987.52	6,566.00
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		4,990.86	2.96
7. 其他费用	6.4.7.20	112,212.45	95,784.99
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		116,085,475.93	87,053,764.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		116,085,475.93	87,053,764.13

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实美国成长股票型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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)	267,807,042.89	314,493,964.88	582,301,007.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	116,085,475.93	116,085,475.93
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)	125,769,861.59	118,126,275.02	243,896,136.61
其中：1. 基金申购款	587,670,080.27	645,811,473.32	1,233,481,553.59
2. 基金赎回款	-461,900,218.68	-527,685,198.30	-989,585,416.98
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	393,576,904.48	548,705,715.83	942,282,620.31
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日 至 2019 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)	308,021,491.99	208,139,954.51	516,161,446.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	87,053,764.13	87,053,764.13
三、本期基金份额交易产生的基	-49,983,055.01	-43,382,611.50	-93,365,666.51

金净值变动数 (净值减少以 “-”号填列)			
其中: 1. 基金申 购款	163,393,637.59	137,309,710.30	300,703,347.89
2. 基金赎 回款	-213,376,692.60	-180,692,321.80	-394,069,014.40
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)	-	-	-
五、期末所有者 权益(基金净值)	258,038,436.98	251,811,107.14	509,849,544.12

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

经雷

基金管理人负责人

罗丽丽

主管会计工作负责人

罗丽丽

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

嘉实美国成长股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]14 号《关于核准嘉实美国成长股票型证券投资基金募集的批复》核准,由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《嘉实美国成长股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 476,918,336.37 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(2013)第 352 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《嘉实美国成长股票型证券投资基金基金合同》于 2013 年 6 月 14 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 477,029,933.09 份基金份额,其中认购资金利息折合 111,596.72 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《嘉实美国成长股票型证券投资基金基金合同》和《嘉实美国成长股票型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金根据认购、申购、赎回所使用货币的不同,将基金份额分为不同的类别。以人民币计价并进行认购、申购、赎回的份额类别,称为人民币份额;以美

元计价并进行认购、申购、赎回的份额类别，称为美元份额。本基金对人民币基金份额和美元基金份额分别设置代码，分别计算基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值。投资者在认购、申购基金份额时可自行选择基金份额类别，并交付相应币种的款项。

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《嘉实美国成长股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金可投资于下列金融产品或工具：银行存款、可转让存单、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金；中国证监会认可的境外交易所上市交易的金融衍生产品；法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关要求）。本基金投资组合中股票及其他权益类证券市值占基金资产的比例不低于 90%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金主要投资于美国发行、上市的大盘成长型股票，所投资比例不低于权益类资产的 80%。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{罗素 1000 成长指数收益率} + 5\% \times \text{境内银行活期存款税后利率}$ 。

#### 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》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实美国成长股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和基金净值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 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

## 6.4.6 税项

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

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

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

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

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

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	90,650,478.15
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 个月及以上	-
其他存款	-
合计	90,650,478.15

注：定期存款的存款期限指票面存期。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	674,732,729.87	887,265,767.64	212,533,037.77
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	3,825,820.20	4,769,597.62	943,777.42
其他	-	-	-
合计	678,558,550.07	892,035,365.26	213,476,815.19

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	5,275.08
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	12.32
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	5,287.40

#### 6.4.7.6 其他资产

无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

无。

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	225,046.25
应付证券出借违约金	-
预提费用	94,481.66
合计	319,527.91

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	243,668,694.53	243,668,694.53
本期申购	577,813,847.07	577,813,847.07
本期赎回（以“-”号填列）	-451,220,114.95	-451,220,114.95
本期末	370,262,426.65	370,262,426.65

嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,918,028.61	24,138,348.36
本期申购	1,600,280.57	9,856,233.20
本期赎回（以“-”号填列）	-1,733,564.31	-10,680,103.73
本期末	3,784,744.87	23,314,477.83

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	70,006,127.58	216,639,938.42	286,646,066.00
本期利润	2,215,620.37	110,137,741.76	112,353,362.13
本期基金份额交易产生的变动数	35,091,986.80	82,631,234.27	117,723,221.07
其中：基金申购款	157,440,294.56	476,507,198.47	633,947,493.03
基金赎回款	-122,348,307.76	-393,875,964.20	-516,224,271.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	107,313,734.75	409,408,914.45	516,722,649.20
嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,850,888.27	17,997,010.61	27,847,898.88
本期利润	-33,157.61	3,765,271.41	3,732,113.80
本期基金份额交易产生的变动数	-246,007.13	649,061.08	403,053.95
其中：基金申购款	3,954,565.79	7,909,414.50	11,863,980.29
基金赎回款	-4,200,572.92	-7,260,353.42	-11,460,926.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,571,723.53	22,411,343.10	31,983,066.63

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	132,481.91
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	541.90
合计	133,023.81

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	323,533,959.64
减：卖出股票成本总额	316,710,251.49
减：买卖股票差价收入应缴纳增值税额	26,984.63
买卖股票差价收入	6,796,723.52

注：“买卖股票差价收入应缴纳增值税额”为买卖房地产信托凭证(简称“REITs”)产生。

## 6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	3,160,947.47
减：卖出/赎回基金成本总额	2,659,481.37
减：基金投资收益应缴纳增值税额	14,605.79
基金投资收益	486,860.31

## 6.4.7.14 债券投资收益

无。

## 6.4.7.15 衍生工具收益

无。

## 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,643,821.26
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	4,130.55
合计	3,647,951.81

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	113,903,013.17
股票投资	113,006,710.88
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	896,302.29
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	113,903,013.17

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,407,465.89
合计	1,407,465.89

## 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	617,987.52
银行间市场交易费用	-
合计	617,987.52

## 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	34,809.32
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	17,730.79
合计	112,212.45

## 6.4.7.21 汇兑收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日
汇兑收益	-1,216,612.81
合计	-1,216,612.81

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 6.4.8.1 或有事项

无。

## 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

## 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、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、基金代销机构

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

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 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,980,449.32	4,763,021.61
其中：支付销售机构的客户维护费	2,631,256.73	1,761,276.92

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.8%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×1.8%/当年天数。

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

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,357,309.62	926,143.06

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

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

无。

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

无。

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

无。

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无。

**6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

无。

**6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司_活期	90,650,478.15	132,481.91	51,085,911.73	68,275.99

注：本基金的活期银行存款由基金托管人保管，按适用利率计息。

**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。

**6.4.11 利润分配情况**

本期（2020年1月1日至2020年6月30日），本基金未实施利润分配。

**6.4.12 期末(2020年06月30日)本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

无。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

无。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金主要投资于美国大盘成长型股票，属于主动投资的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金与混合型基金，为证券投资基金中的较高预期风险、较高预期收益的投资品种。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是主要投资于美国大盘成长型股票，在股票选择及组合构建等方面均运用量化投资方法并结合风险管理手段，力争获取长期资本增值。本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，公司董事会对公司建立内部控制制度和维持其有效性承担最终责任。董事会下设风险控制与内审委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

为了有效控制基金运作和管理中存在的风险，本基金的基金管理人设立风险控制委员会，由公司总经理、督察长以及部门总监组成，负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。监察稽核部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。公司管理层重视和支持监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确监察稽核部门及其各岗位的职责和 workflows、组织纪律。业务部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察

稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

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

#### **6.4.13.2 信用风险**

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

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

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

于本报告期末，本基金未持有债券投资、资产支持证券投资、同业存单投资(上年度末：同)。

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

无。

##### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

##### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

无。

##### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

无。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金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于开放日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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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。

于本报告期末，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在 1 个月内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不得超过基金净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构 10%以上具有投票权的证券发行总量。本基金持有非流动性资产市值不得超过基金资产净值的 10%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场或柜台市场交易，因此

除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

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

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 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	90,650,478.15	-	-	-	90,650,478.15
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	892,035,365.26	892,035,365.26

衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,516,406.32	1,516,406.32
应收利息	-	-	-	5,287.40	5,287.40
应收股利	-	-	-	264,234.48	264,234.48
应收申购款	42,920.66	-	-	22,237,882.10	22,280,802.76
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	90,693,398.81	-	-	916,059,175.56	1,006,752,574.37
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	62,446,140.06	62,446,140.06
应付管理人报酬	-	-	-	1,402,269.95	1,402,269.95
应付托管费	-	-	-	272,663.61	272,663.61
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应付税费	-	-	-	29,352.53	29,352.53
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	319,527.91	319,527.91
负债总计	-	-	-	64,469,954.06	64,469,954.06
利率敏感度缺口	90,693,398.81	-	-	851,589,221.50	942,282,620.31
上年度末 2019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	43,948,155.63	-	-	-	43,948,155.63
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	544,350,717.17	544,350,717.17
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	6,402.98	6,402.98
应收股利	-	-	-	343,915.09	343,915.09
应收申购款	60,450.70	-	-	9,487,347.25	9,547,797.95
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	44,008,606.33	-	-	554,188,382.49	598,196,988.82
负债	-	-	-	-	-

短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	7,398,444.62	7,398,444.62
应付赎回款	-	-	-	7,265,919.92	7,265,919.92
应付管理人报酬	-	-	-	838,841.06	838,841.06
应付托管费	-	-	-	163,107.98	163,107.98
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应付税费	-	-	-	17,049.60	17,049.60
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	212,617.87	212,617.87
负债总计	-	-	-	15,895,981.05	15,895,981.05
利率敏感度缺口	44,008,606.33	-	-	538,292,401.44	582,301,007.77

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2020年6月30日，本基金未持有交易性债券投资（2019年12月31日，本基金未持有交易性债券投资），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2019年12月31日：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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020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				
银行存款	46,352,152.99	-	-	46,352,152.99

存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	892,035,365.26	-	-	892,035,365.26
衍生金融资产	-	-	-	-
应收股利	264,234.48	-	-	264,234.48
应收利息	1,921.59	-	-	1,921.59
应收申购款	457,411.59	-	-	457,411.59
应收证券清算款	1,516,406.32	-	-	1,516,406.32
其它资产	-	-	-	-
资产合计	940,627,492.23	-	-	940,627,492.23
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	531,866.48	-	-	531,866.48
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
其他负债	898.18	-	-	898.18
负债合计	532,764.66	-	-	532,764.66
资产负债表外汇风险敞口净额	940,094,727.57	-	-	940,094,727.57
项目	上年度末 2019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	10,796,981.45	-	-	10,796,981.45
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	544,350,717.17	-	-	544,350,717.17
衍生金融资产	-	-	-	-
应收股利	343,915.09	-	-	343,915.09
应收利息	1,957.31	-	-	1,957.31

应收申购款	669,732.15	-	-	669,732.15
应收证券清算款	-	-	-	-
其它资产	-	-	-	-
资产合计	556,163,303.17	-	-	556,163,303.17
以外币计价的负债				
应付证券清算款	7,398,444.62	-	-	7,398,444.62
应付赎回款	401,418.99	-	-	401,418.99
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
其他负债	510.31	-	-	510.31
负债合计	7,800,373.92	-	-	7,800,373.92
资产负债表外汇风险敞口净额	548,362,929.25	-	-	548,362,929.25

#### 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		
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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）	
分析	所有外币相对人民币升值 5%	47,004,736.38	27,418,146.46
	所有外币相对人民币贬值 5%	-47,004,736.38	-27,418,146.46

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

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

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019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	887,265,767.64	94.16	541,140,957.44	92.93
交易性金融资产—基金投资	4,769,597.62	0.51	3,209,759.73	0.55
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	892,035,365.26	94.67	544,350,717.17	93.48

#### 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		
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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）	
分析	业绩比较基准上升 5%	45,555,167.14	28,139,189.90
	业绩比较基准下降 5%	-45,555,167.14	-28,139,189.90

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 892,035,365.26 元，无属于第二层次的余额，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次 544,350,717.17 元，无属于第二层次的余额，无属于第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，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	887,265,767.64	88.13
	其中：普通股	871,033,327.15	86.52
	存托凭证	3,507,464.08	0.35
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	12,724,976.41	1.26
2	基金投资	4,769,597.62	0.47
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	90,650,478.15	9.00
8	其他各项资产	24,066,730.96	2.39
9	合计	1,006,752,574.37	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	887,265,767.64	94.16
合计	887,265,767.64	94.16

### 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
信息技术	399,565,187.28	42.40
非必需消费品	134,979,931.19	14.32
通信服务	102,115,825.85	10.84
医疗保健	115,050,284.39	12.21
必需消费品	28,947,098.74	3.07
工业	50,891,595.04	5.40
金融	31,408,309.76	3.33

原材料	7,379,941.52	0.78
公用事业	1,582,774.93	0.17
能源	2,294,063.90	0.24
房地产	325,778.63	0.03
房地产信托特殊类	12,355,243.29	1.31
房地产信托工业类	191,234.00	0.02
房地产信托酒店及度假村类	139,132.00	0.01
房地产信托住宅类	39,367.12	0.00
合计	887,265,767.64	94.16

注:本基金持有的权益投资采用全球行业分类标准 (GICS) 进行行业分类。

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

金额单位: 人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家 (地区)	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	Microsoft Corp	微软	MSFT UW	纳斯达克证券交易所	美国	60,354	86,954,967.86	9.23
2	Apple Inc	苹果公司	AAPL UW	纳斯达克证券交易所	美国	33,605	86,788,326.77	9.21
3	Amazon.com Inc	亚马逊公司	AMZN UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,360	65,624,382.40	6.96
4	Alphabet Inc	Alphabet 公司	GOOGL UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,491	45,085,530.62	4.78
5	Facebook Inc	Facebook 公司	FB UW	纳斯达克证券交易所	美国	19,256	30,954,830.00	3.29
6	NVIDIA Corp	英伟达	NVDA UW	纳斯达克证券交易所	美国	9,701	26,091,546.17	2.77
7	Visa Inc	维萨公司	V UN	纽约证券交易所	美国	13,418	18,349,745.85	1.95
8	UnitedHealthGroup Inc	联合健康	UNH UN	纽约证券交易所	美国	7,543	15,750,527.17	1.67
9	Mastercard Inc	万事达股份有限公司	MA UN	纽约证券交易所	美国	6,857	14,354,499.68	1.52
10	Adobe Inc	奥多比	ADBE UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,476	13,794,034.50	1.46
11	PayPal Holdings Inc	Paypal 控股股份有	PYPL UW	纳斯达克证券交易所	美国	10,613	13,090,724.62	1.39

		限公司						
12	Netflix Inc	奈飞公司	NFLX UW	纳斯达克证 券交易所	美国	3,588	11,558,582.98	1.23
13	Tesla Inc	特斯拉公 司	TSLA UW	纳斯达克证 券交易所	美国	1,510	11,543,217.49	1.23
14	Costco Wholesale Corp	好市多批 发	COST UW	纳斯达克证 券交易所	美国	4,038	8,667,870.64	0.92
15	AbbVie Inc	艾伯维生 物制药公 司	ABBV UN	纽约证券交 易所	美国	11,999	8,340,088.65	0.89
16	salesforce.com Inc	Salesfor ce.com 股份有 限公司	CRM UN	纽约证券交 易所	美国	5,533	7,337,879.73	0.78
17	Amgen Inc	AMGEN-T	AMGN UW	纳斯达克证 券交易所	美国	4,259	7,111,554.14	0.75
18	Lockheed Martin Corp	洛克希德 马丁	LMT UN	纽约证券交 易所	美国	2,677	6,915,898.70	0.73
19	Eli Lilly and Co	礼来	LLY UN	纽约证券交 易所	美国	5,845	6,793,715.45	0.72
20	American Tower Corp	美国发射 塔公司	AMT UN	纽约证券交 易所	美国	3,685	6,744,780.53	0.72
21	NIKE Inc	耐克公司	NKE UN	纽约证券交 易所	美国	9,203	6,388,216.20	0.68
22	Lowe's Cos Inc	劳氏	LOW UN	纽约证券交 易所	美国	6,480	6,198,651.62	0.66
23	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM UW	纳斯达克证 券交易所	美国	9,239	5,965,818.12	0.63
24	PepsiCo Inc	百事可乐	PEP UW	纳斯达克证 券交易所	美国	6,298	5,897,035.75	0.63
25	Home Depot Inc/The	家得宝	HD UN	纽约证券交 易所	美国	3,298	5,848,955.33	0.62
26	Lam Research Corp	泛林集团	LRCX UW	纳斯达克证 券交易所	美国	2,544	5,825,594.82	0.62
27	Merck & Co Inc	默克	MRK UN	纽约证券交 易所	美国	9,918	5,429,685.82	0.58
28	S&P Global Inc	标普全球	SPGI UN	纽约证券交 易所	美国	2,247	5,241,248.07	0.56
29	Thermo Fisher Scientific Inc	Thermo Fisher Scientif ic 公司	TMO UN	纽约证券交 易所	美国	2,018	5,176,545.41	0.55
30	Advanced Micro Devices Inc	AMD 公司	AMD UR	纳斯达克证 券交易所	美国	13,502	5,028,853.59	0.53

31	Union Pacific Corp	联合太平洋	UNP UN	纽约证券交易所	美国	4,032	4,826,026.05	0.51
32	Accenture PLC	埃森哲公司	ACN UN	纽约证券交易所	美国	3,160	4,803,548.36	0.51
33	Broadcom Inc	博通股份有限公司	AVGO UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,098	4,687,689.37	0.50
34	Cisco Systems Inc	思科-T	CSCO UW	纳斯达克证券交易所	美国	13,491	4,454,564.69	0.47
35	Applied Materials Inc	应用材料	AMAT UW	纳斯达克证券交易所	美国	10,070	4,309,514.65	0.46
36	Texas Instruments Inc	德州仪器	TXN UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,784	4,300,261.61	0.46
37	Vertex Pharmaceuticals Inc	Vertex 制药股份有限公司	VRTX UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,058	4,229,703.77	0.45
38	Coca-Cola Co/The	可口可乐	KO UN	纽约证券交易所	美国	13,001	4,112,373.09	0.44
39	ServiceNow Inc	ServiceNow 公司	NOW UN	纽约证券交易所	美国	1,430	4,100,699.85	0.44
40	Zoetis Inc	硕腾股份有限公司	ZTS UN	纽约证券交易所	美国	3,943	3,825,398.76	0.41
41	Cadence Design Systems Inc	Cadence 设计系统股份有限公司	CDNS UW	纳斯达克证券交易所	美国	5,522	3,751,364.18	0.40
42	KLA Corp	KLA 公司	KLAC UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,710	3,731,185.34	0.40
43	Charter Communications Inc	查特通信公司	CHTR UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,016	3,668,601.43	0.39
44	Abbott Laboratories	雅培制药	ABT UN	纽约证券交易所	美国	5,614	3,633,822.54	0.39
45	Dollar General Corp	达乐公司	DG UN	纽约证券交易所	美国	2,686	3,622,649.95	0.38
46	TJX Cos Inc/The	TJX 公司	TJX UN	纽约证券交易所	美国	10,058	3,600,155.69	0.38
47	Clorox Co/The	高乐氏公司	CLX UN	纽约证券交易所	美国	2,262	3,512,953.67	0.37
48	Trade Desk Inc/The	Trade Desk 股份有限公司	TTD UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,154	3,321,000.53	0.35
49	Johnson & Johnson	强生	JNJ UN	纽约证券交易所	美国	3,255	3,240,645.73	0.34
50	DocuSign Inc	DocuSign 股份有限	DOCU UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,577	3,141,777.11	0.33

		公司						
51	Lululemon Athletica Inc	Lululemon Athletica 股份有限公司	LULU UN	纳斯达克证券交易所	美国	1,398	3,088,006.96	0.33
52	Square Inc	Square 股份有限公司	SQ UN	纽约证券交易所	美国	4,129	3,067,527.95	0.33
53	Humana Inc	Humana 公司	HUM UN	纽约证券交易所	美国	1,116	3,063,504.96	0.33
54	Moody's Corp	穆迪	MCO UN	纽约证券交易所	美国	1,562	3,038,013.52	0.32
55	Bristol-Myers Squibb Co	百时美施贵宝	BMJ UN	纽约证券交易所	美国	7,149	2,975,947.12	0.32
56	ASML Holding NV	阿斯麦控股公司	ASML UN	纳斯达克证券交易所	美国	1,138	2,965,023.02	0.31
57	Global Payments Inc	环汇有限公司	GPN UN	纽约证券交易所	美国	2,441	2,931,213.31	0.31
58	Splunk Inc	Splunk 公司	SPLK UN	纳斯达克证券交易所	美国	2,058	2,894,981.71	0.31
59	eBay Inc	eBay 公司	EBAY UN	纳斯达克证券交易所	美国	7,780	2,888,867.85	0.31
60	Electronic Arts Inc	电子艺界	EA UN	纳斯达克证券交易所	美国	2,998	2,802,674.23	0.30
61	Crown Castle International Corp	冠城国际公司	CCI UN	纽约证券交易所	美国	2,349	2,782,987.91	0.30
62	Stryker Corp	史赛克	SYK UN	纽约证券交易所	美国	2,177	2,777,101.16	0.29
63	Autodesk Inc	欧特克	ADSK UN	纳斯达克证券交易所	美国	1,639	2,775,393.45	0.29
64	Fortinet Inc	飞塔股份有限公司	FTNT UN	纳斯达克证券交易所	美国	2,810	2,730,766.33	0.29
65	Intuit Inc	Intuit 公司	INTU UN	纳斯达克证券交易所	美国	1,300	2,725,940.24	0.29
66	Veeva Systems Inc	Veeva Systems 股份有限公司	VEEV UN	纽约证券交易所	美国	1,529	2,537,492.30	0.27
67	Okta Inc	Okta Inc	OKTA UN	纳斯达克证券交易所	美国	1,768	2,506,190.01	0.27
68	Intuitive Surgical Inc	直觉外科手术公司	ISRG UN	纳斯达克证券交易所	美国	621	2,505,183.23	0.27
69	Shopify Inc	Shopify	SHOP UN	纽约证券交	美国	367	2,466,189.13	0.26

		股份有限 公司		易所				
70	MercadoLibre Inc	MercadoLibre 股份 有限公司	MELI UW	纳斯达克证 券交易所	美国	347	2,421,629.27	0.26
71	Regeneron Pharmaceuticals Inc	再生元制 药股份有 限公司	REGN UW	纳斯达克证 券交易所	美国	522	2,304,697.95	0.24
72	Chipotle Mexican Grill Inc	Chipotle Mexican Grill 股份 股份	CMG UN	纽约证券交 易所	美国	307	2,287,206.06	0.24
73	Equinix Inc	Equinix 有 限公司	EQIX UW	纳斯达克证 券交易所	美国	455	2,262,229.45	0.24
74	Illinois Tool Works Inc	伊利诺伊 工具	ITW UN	纽约证券交 易所	美国	1,802	2,230,606.74	0.24
75	Lattice Semiconductor Corp	莱迪斯半 导体公司	LSCC UW	纳斯达克证 券交易所	美国	10,975	2,205,832.38	0.23
76	Equifax Inc	Equifax 公 司	EFX UN	纽约证券交 易所	美国	1,805	2,196,368.15	0.23
77	Synopsys Inc	新思科技 公司	SNPS UW	纳斯达克证 券交易所	美国	1,577	2,177,052.44	0.23
78	Sherwin-Williams Co/The	宣威威廉 斯	SHW UN	纽约证券交 易所	美国	528	2,159,989.43	0.23
79	ResMed Inc	瑞思迈股 份有限公 司	RMD UN	纽约证券交 易所	美国	1,558	2,117,733.31	0.22
80	Rockwell Automation Inc	罗克韦尔 自动化	ROK UN	纽约证券交 易所	美国	1,380	2,080,948.23	0.22
81	Boeing Co/The	波音	BA UN	纽约证券交 易所	美国	1,551	2,012,689.81	0.21
82	Coupa Software Inc	Coupa 软 件股份有 限公司	COUP UW	纳斯达克证 券交易所	美国	1,017	1,994,646.86	0.21
83	MSCI Inc	MSCI 明 晟	MSCI UN	纽约证券交 易所	美国	837	1,978,064.26	0.21
84	DexCom Inc	DexCom 股 份有限公 司	DXCM UW	纳斯达克证 券交易所	美国	689	1,977,450.19	0.21
85	XPO Logistics Inc	XPO 物流 公司	XPO UN	纽约证券交 易所	美国	3,475	1,900,447.53	0.20
86	American Express Co	美国运通	AXP UN	纽约证券交 易所	美国	2,753	1,855,435.01	0.20
87	Teradyne Inc	泰瑞达	TER UW	纳斯达克证	美国	3,077	1,840,933.85	0.20

				券交易所				
88	RingCentral Inc	RingCentral 股份有限公司	RNG UN	纽约证券交易所	美国	909	1,834,115.02	0.19
89	Marsh & McLennan Cos Inc	Marsh & McLennan 股份有限公司	MMC UN	纽约证券交易所	美国	2,394	1,819,741.44	0.19
90	IHS Markit Ltd	IHS Markit 有限公司	INFO UN	纽约证券交易所	美国	3,329	1,779,357.99	0.19
91	Lennar Corp	Lennar 公司	LEN UN	纽约证券交易所	美国	3,962	1,728,378.09	0.18
92	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	MACOM 技术解决方案控股股份有	MTSI UW	纳斯达克证券交易所	美国	7,073	1,720,017.98	0.18
93	Fair Isaac Corp	费埃哲公司	FICO UN	纽约证券交易所	美国	581	1,719,477.74	0.18
94	Fidelity National Information Services Inc	繁德信息技术有限公司	FIS UN	纽约证券交易所	美国	1,798	1,706,823.70	0.18
95	Comcast Corp	康卡斯特	CMCSA UW	纳斯达克证券交易所	美国	6,028	1,663,480.31	0.18
96	RH	RH	RH UN	纽约证券交易所	美国	938	1,652,838.12	0.18
97	Rambus Inc	Rambus 股份有限公司	RMBS UW	纳斯达克证券交易所	美国	15,259	1,641,996.58	0.17
98	Ecolab Inc	艺康集团	ECL UN	纽约证券交易所	美国	1,154	1,625,370.37	0.17
99	Ameriprise Financial Inc	阿默普莱斯金融公司	AMP UN	纽约证券交易所	美国	1,528	1,623,054.10	0.17
100	ANSYS Inc	ANSYS 股份有限公司	ANSS UW	纳斯达克证券交易所	美国	781	1,613,001.28	0.17
101	Cintas Corp	CINTAS 公司	CTAS UW	纳斯达克证券交易所	美国	842	1,587,755.71	0.17
102	BioMarin Pharmaceutical Inc	BioMarin 制药股份有限公司	BMRN UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,816	1,585,704.92	0.17

103	Fastenal Co	快扣公司	FAST UN	纳斯达克证 券交易所	美国	5,214	1,581,332.06	0.17
104	West Pharmaceu tical Services Inc	西氏医药 服务公司	WST UN	纽约证券交 易所	美国	963	1,548,744.76	0.16
105	Blackstone Gro up Inc/The	Blacksto ne 集团股 份有限公司	BX UN	纽约证券交 易所	美国	3,762	1,509,030.26	0.16
106	Citrix Systems Inc	思杰系统	CTXS UN	纳斯达克证 券交易所	美国	1,423	1,490,064.35	0.16
107	Howmet Aerospa ce Inc	Howmet 航 空航天股 份有限公司	HWM UN	纽约证券交 易所	美国	13,271	1,489,139.91	0.16
108	Masimo Corp	Masimo 公 司	MASI UN	纳斯达克证 券交易所	美国	903	1,457,491.85	0.15
109	Advanced Drain age Systems I nc	先进排水 系统公司	WMS UN	纽约证券交 易所	美国	4,109	1,437,029.48	0.15
110	Starbucks Corp	星巴克	SBUX UN	纳斯达克证 券交易所	美国	2,697	1,405,084.15	0.15
111	Quidel Corp	Quidel 有 限公司	QDEL UN	纳斯达克证 券交易所	美国	883	1,398,643.15	0.15
112	Twilio Inc	Twilio 股 份有限公司	TWLO UN	纽约证券交 易所	美国	894	1,388,725.20	0.15
113	Zoom Video Co mmunications I nc	Zoom Vi deo Com municati ons In	ZM UN	纳斯达克证 券交易所	美国	769	1,380,306.11	0.15
114	DaVita Inc	DaVita 股 份有限公司	DVA UN	纽约证券交 易所	美国	2,360	1,322,241.05	0.14
115	Old Dominion Freight Line Inc	Old Dom inion F reight Line 股	ODFL UN	纳斯达克证 券交易所	美国	1,072	1,287,056.50	0.14
116	Best Buy Co Inc	百思买	BBY UN	纽约证券交 易所	美国	2,082	1,286,317.82	0.14
117	EPAM Systems Inc	EPAM 系 统公司	EPAM UN	纽约证券交 易所	美国	715	1,275,634.93	0.14
118	Danaher Corp	丹纳赫	DHR UN	纽约证券交 易所	美国	1,017	1,273,149.74	0.14

119	IAC/InterActive Corp	IAC/InterActive Corp	IAC UW	纳斯达克证券交易所	美国	553	1,266,099.20	0.13
120	Generac Holdings Inc	Generac 控股公司	GNRC UN	纽约证券交易所	美国	1,428	1,232,654.51	0.13
121	Procter & Gamble Co/The	宝洁	PG UN	纽约证券交易所	美国	1,441	1,219,800.47	0.13
122	Teleflex Inc	泰利福公司	TFX UN	纽约证券交易所	美国	470	1,211,094.31	0.13
123	Kroger Co/The	克罗格公司	KR UN	纽约证券交易所	美国	5,025	1,204,196.40	0.13
124	Skyworks Solutions Inc	思佳讯解决方案公司	SWKS UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,313	1,188,507.73	0.13
125	Microchip Technology Inc	微芯科技股份有限公司	MCHP UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,574	1,173,483.34	0.12
126	Goldman Sachs Group Inc/The	高盛	GS UN	纽约证券交易所	美国	832	1,164,010.26	0.12
127	FormFactor Inc	FormFactor 股份有限公司	FORM UW	纳斯达克证券交易所	美国	5,575	1,157,602.67	0.12
128	BWX Technologies Inc	BWX 科技公司	BWXT UN	纽约证券交易所	美国	2,880	1,154,830.69	0.12
129	Horizon Therapeutics Plc	Horizon Therapeutic 公共有限	HZNP UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,915	1,146,990.15	0.12
130	Entegris Inc	Entegris 股份有限公司	ENTG UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,741	1,145,859.91	0.12
131	Inphi Corp	Inphi 公司	IPHI UN	纽约证券交易所	美国	1,368	1,137,958.83	0.12
132	TransDigm Group Inc	TransDigm 集团公司	TDG UN	纽约证券交易所	美国	362	1,132,876.46	0.12
133	Artisan Partners Asset Management Inc	阿尔笛生合伙人资产管理股份有	APAM UN	纽约证券交易所	美国	4,803	1,105,092.25	0.12
134	Chemed Corp	Chemed 公司	CHE UN	纽约证券交易所	美国	344	1,098,512.42	0.12

135	Monolithic Power Systems Inc	芯源系统有限公司	MPWR UW	纳斯达克证券交易所	美国	643	1,078,852.08	0.11
136	Fiserv Inc	Fiserv 公司	FISV UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,545	1,067,750.72	0.11
137	3M Co	3M 公司	MMM UN	纽约证券交易所	美国	937	1,034,758.34	0.11
138	Aon PLC	Aon PLC	AON UN	纽约证券交易所	美国	750	1,022,633.78	0.11
139	Trex Co Inc	Trex 公司	TREX UN	纽约证券交易所	美国	1,107	1,019,359.44	0.11
140	Micron Technology Inc	美光科技股份有限公司	MU UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,778	1,013,236.16	0.11
141	SVB Financial Group	硅谷银行金融集团	SIVB UW	纳斯达克证券交易所	美国	659	1,005,531.61	0.11
142	Cloudflare Inc	Cloudflare Inc	NET UN	纽约证券交易所	美国	3,905	993,853.84	0.11
143	MarketAxess Holdings Inc	MarketAxess 控股公司	MKTX UW	纳斯达克证券交易所	美国	280	992,953.68	0.11
144	IDEXX Laboratories Inc	爱德士股份有限公司	IDXX UW	纳斯达克证券交易所	美国	420	981,694.44	0.10
145	Choice Hotels International Inc	精品国际酒店集团	CHH UN	纽约证券交易所	美国	1,675	935,609.02	0.10
146	Intercontinental Exchange Inc	洲际交易所 (ICE)	ICE UN	纽约证券交易所	美国	1,422	922,141.69	0.10
147	Cardinal Health Inc	康德乐公司	CAH UN	纽约证券交易所	美国	2,487	918,894.53	0.10
148	Alteryx Inc	Alteryx 股份有限公司	AYX UN	纽约证券交易所	美国	774	900,177.68	0.10
149	Seattle Genetics Inc	西雅图遗传学股份有限公司	SGEN UW	纳斯达克证券交易所	美国	748	899,805.58	0.10
150	Laboratory Corp of America Holdings	美国实验控股	LH UN	纽约证券交易所	美国	758	891,389.61	0.09
151	Fortune Brands Home & Security Inc	Fortune Brands 家居与安	FBHS UN	纽约证券交易所	美国	1,946	880,744.88	0.09

		全有限						
152	Moderna Inc	Moderna 股份有限公司	MRNA UW	纳斯达克证 券交易所	美国	1,885	856,873.30	0.09
153	Molina Healthc are Inc	Molina Healthca re 股份有 限公	MOH UN	纽约证券交 易所	美国	665	837,906.26	0.09
154	CoStar Group Inc	CoStar 集 团股份有 限公司	CSGP UW	纳斯达克证 券交易所	美国	166	835,177.25	0.09
155	Akamai Technol ogies Inc	阿卡迈技 术公司	AKAM UW	纳斯达克证 券交易所	美国	1,095	830,167.30	0.09
156	Automatic Data Processing I nc	ADP 公司	ADP UW	纳斯达克证 券交易所	美国	787	829,550.54	0.09
157	Atlassian Corp PLC	Atlassia n 公共有 限公司	TEAM UW	纳斯达克证 券交易所	美国	649	828,267.73	0.09
158	Paycom Softwar e Inc	Paycom 软 件股份有 限公司	PAYC UN	纽约证券交 易所	美国	374	820,082.34	0.09
159	Cigna Corp	信诺集团	CI UN	纽约证券交 易所	美国	616	818,336.40	0.09
160	Zynga Inc	Zynga 股 份有限公 司	ZNGA UW	纳斯达克证 券交易所	美国	11,987	809,583.16	0.09
161	CDW Corp/DE	特 拉 华 CDW 公司	CDW UW	纳斯达克证 券交易所	美国	984	809,336.37	0.09
162	Northrop Grumm an Corp	诺斯洛普 格鲁门公 司	NOC UN	纽约证券交 易所	美国	371	807,489.47	0.09
163	Arch Capital Group Ltd	阿契资本 集团	ACGL UW	纳斯达克证 券交易所	美国	3,952	801,574.97	0.09
164	Guidewire Soft ware Inc	Guidewir e 软件 公司	GWRE UN	纽约证券交 易所	美国	1,011	793,394.96	0.08
165	Nordson Corp	诺信公司	NDSN UW	纳斯达克证 券交易所	美国	589	791,057.60	0.08
166	Twitter Inc	推特公司	TWTR UN	纽约证券交 易所	美国	3,707	781,800.02	0.08
167	Charles River Laboratories International	查理斯河 实验室国 际有限公	CRL UN	纽约证券交 易所	美国	626	772,678.58	0.08

	Inc	司						
168	American Water Works Co Inc	美国自来水股份有限公司	AWK UN	纽约证券交易所	美国	834	759,647.62	0.08
169	Livongo Health Inc	Livongo Health Inc	LVGO UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,419	755,344.49	0.08
170	Kansas City Southern	Kansas City Southern	KSU UN	纽约证券交易所	美国	713	753,568.67	0.08
171	Match Group Inc	Match Group 股份有限公司	MTCH UW	纳斯达克证券交易所	美国	978	741,187.54	0.08
172	CACI International Inc	CACI 国际公司	CACI UN	纽约证券交易所	美国	482	740,063.74	0.08
173	Citigroup Inc	花旗集团	C UN	纽约证券交易所	美国	2,040	737,995.40	0.08
174	Crown Holdings Inc	Crown 控股股份有限公司	CCK UN	纽约证券交易所	美国	1,555	716,991.58	0.08
175	Cable One Inc	Cable One 股份有限公司	CABO UN	纽约证券交易所	美国	57	716,207.88	0.08
176	SiteOne Landscape Supply Inc	SiteOne Landscape Supply 股份	SITE UN	纽约证券交易所	美国	887	715,676.50	0.08
177	Wendy's Co/The	温迪快餐公司	WEN UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,583	706,659.69	0.07
178	Callaway Golf Co	卡拉威高尔夫公司	ELY UN	纽约证券交易所	美国	5,578	691,460.29	0.07
179	T-Mobile US Inc	T-Mobile US 有限公司	TMUS UW	纳斯达克证券交易所	美国	936	690,140.81	0.07
180	Teledyne Technologies Inc	Teledyne 科技股份有限公司	TDY UN	纽约证券交易所	美国	305	671,418.01	0.07
181	Kimberly-Clark Corp	金佰利	KMB UN	纽约证券交易所	美国	665	665,457.07	0.07
182	PulteGroup Inc	Pulte 集团公司	PHM UN	纽约证券交易所	美国	2,747	661,794.56	0.07
183	Papa John's International Inc	棒约翰国际股份有限公司	PZZA UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,176	661,127.32	0.07

184	Honeywell International Inc	霍尼韦尔	HON UN	纽约证券交易所	美国	639	654,096.31	0.07
185	Domino's Pizza Inc	达美乐披萨公司	DPZ UN	纽约证券交易所	美国	248	648,631.72	0.07
186	Royal Gold Inc	皇家黄金股份有限公司	RGLD UW	纳斯达克证券交易所	美国	728	640,729.86	0.07
187	Five9 Inc	Five9 公司	FIVN UQ	纳斯达克证券交易所	美国	812	636,192.47	0.07
188	Analog Devices Inc	模拟器件	ADI UW	纳斯达克证券交易所	美国	728	632,071.35	0.07
189	Raytheon Technologies Corp	雷神技术公司	RTX UN	纽约证券交易所	美国	1,448	631,673.77	0.07
190	JPMorgan Chase & Co	摩根大通	JPM UN	纽约证券交易所	美国	931	619,950.82	0.07
191	Monster Beverage Corp	怪兽饮料公司	MNST UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,262	619,327.69	0.07
192	Baxter International Inc	百特	BAX UN	纽约证券交易所	美国	1,014	618,078.58	0.07
193	Valero Energy Corp	Valero 能源	VLO UN	纽约证券交易所	美国	1,477	615,046.71	0.07
194	Linde PLC	Linde PLC	LIN UN	纽约证券交易所	美国	409	614,167.79	0.07
195	Mr Cooper Group Inc	Mr Cooper 集团股份有限公司	COOP UR	纳斯达克证券交易所	美国	6,967	613,576.58	0.07
196	Vicor Corp	Vicor 公司	VICR UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,184	603,094.11	0.06
197	Take-Two Interactive Software Inc	Take-Two 互动软件股份有限公司	TTWO UW	纳斯达克证券交易所	美国	608	600,756.18	0.06
198	CrowdStrike Holdings Inc	CrowdStrike 控股股份有限公司	CRWD UW	纳斯达克证券交易所	美国	841	597,112.57	0.06
199	Quest Diagnostics Inc	Quest Diagnostics 股份有限公司	DGX UN	纽约证券交易所	美国	734	592,176.39	0.06
200	Werner Enterprises Inc	沃纳企业公司	WERN UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,901	585,832.38	0.06
201	Sunoco LP	Sunoco 有	SUN UN	纽约证券交	美国	3,579	578,455.82	0.06

		限合伙企业		易所				
202	TopBuild Corp	TopBuild 公司	BLD UN	纽约证券交易所	美国	717	577,496.69	0.06
203	Estee Lauder Cos Inc/The	雅诗兰黛	EL UN	纽约证券交易所	美国	432	577,048.35	0.06
204	Alnylam Pharmaceuticals Inc	Alnylam 制药股份有限公司	ALNY UW	纳斯达克证券交易所	美国	548	574,602.52	0.06
205	Medtronic PLC	美敦力	MDT UN	纽约证券交易所	美国	882	572,585.71	0.06
206	Marten Transport Ltd	Marten 运输有限公司	MRTN UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,206	571,053.43	0.06
207	Capital One Financial Corp	第一资本金融	COF UN	纽约证券交易所	美国	1,281	567,618.66	0.06
208	SBA Communications Corp	SBA 通信公司	SBAC UW	纳斯达克证券交易所	美国	268	565,245.40	0.06
209	Cannae Holdings Inc	Cannae Holdings Inc	CNNE UN	纽约证券交易所	美国	1,925	560,112.34	0.06
210	Encompass Health Corp	南方保健公司	EHC UN	纽约证券交易所	美国	1,271	557,248.90	0.06
211	Tyler Technologies Inc	Tyler 科技公司	TYL UN	纽约证券交易所	美国	223	547,629.34	0.06
212	Churchill Downs Inc	丘吉尔唐斯股份有限公司	CHDN UW	纳斯达克证券交易所	美国	577	543,900.64	0.06
213	Maxim Integrated Products Inc	美信	MXIM UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,257	539,364.24	0.06
214	Teladoc Health Inc	Teladoc 健康股份有限公司	TDOC UN	纽约证券交易所	美国	397	536,367.56	0.06
215	Marriott International Inc/MD	万豪国际	MAR UW	纳斯达克证券交易所	美国	860	521,955.96	0.06
216	Sturm Ruger & Co Inc	斯特姆-鲁格公司	RGR UN	纽约证券交易所	美国	951	511,677.94	0.05
217	Syneos Health Inc	Syneos 健康股份有限公司	SYNH UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,200	494,857.05	0.05
218	Qorvo Inc	Qorvo 股份有限公司	QRVO UW	纳斯达克证券交易所	美国	625	489,060.71	0.05

		司						
219	Jack in the Box Inc	Jack in the Box 公司	JACK UN	纳斯达克证券交易所	美国	932	488,852.78	0.05
220	Marriott Vacations Worldwide Corp	万豪环球度假	VAC UN	纽约证券交易所	美国	833	484,810.74	0.05
221	Builders First Source Inc	Builders FirstSource 股份有限	BLDR UN	纳斯达克证券交易所	美国	3,306	484,479.92	0.05
222	NVR Inc	NVR 股份有限公司	NVR UN	纽约证券交易所	美国	21	484,476.73	0.05
223	Medpace Holdings Inc	Medpace 控股股份有限公司	MEDP UN	纳斯达克证券交易所	美国	732	482,047.69	0.05
224	General Mills Inc	通用磨坊	GIS UN	纽约证券交易所	美国	1,092	476,604.68	0.05
225	Roper Technologies Inc	儒博技术公司	ROP UN	纽约证券交易所	美国	173	475,522.79	0.05
226	Waste Management Inc	废品管理	WM UN	纽约证券交易所	美国	632	473,867.18	0.05
227	Newmont Corp	纽蒙公司	NEM UN	纽约证券交易所	美国	1,084	473,803.75	0.05
228	BlackRock Inc	贝莱德有限公司	BLK UN	纽约证券交易所	美国	123	473,781.87	0.05
229	DR Horton Inc	霍顿房屋公司	DHI UN	纽约证券交易所	美国	1,205	473,032.72	0.05
230	Roche Holding AG	罗氏	RHHBY UV	纽约证券交易所	美国	1,520	466,805.24	0.05
231	Freshpet Inc	Freshpet 公司	FRPT UQ	纳斯达克证券交易所	美国	774	458,417.73	0.05
232	Repligen Corp	Repligen 公司	RGEN UN	纳斯达克证券交易所	美国	522	456,800.63	0.05
233	SEI Investments Co	信怡泰投资有限公司	SEIC UN	纳斯达克证券交易所	美国	1,144	445,280.16	0.05
234	Nordstrom Inc	诺德斯特龙公司	JWN UN	纽约证券交易所	美国	4,058	445,006.18	0.05
235	Morgan Stanley	摩根士丹利	MS UN	纽约证券交易所	美国	1,300	444,521.81	0.05
236	Align Technology Inc	Align 科技股份有	ALGN UN	纳斯达克证券交易所	美国	226	439,094.94	0.05

		限公司						
237	Nasdaq Inc	纳斯达克股份有限公司	NDAQ UW	纳斯达克证券交易所	美国	509	430,506.02	0.05
238	Marathon Petroleum Corp	马拉松石油公司	MPC UN	纽约证券交易所	美国	1,621	428,968.00	0.05
239	Walt Disney Co/The	华特迪士尼公司	DIS UN	纽约证券交易所	美国	541	427,084.36	0.05
240	Zimmer Biomet Holdings Inc	捷迈邦美控股股份有限公司	ZBH UN	纽约证券交易所	美国	502	424,194.58	0.05
241	Ross Stores Inc	Ross 商店有限公司	ROST UW	纳斯达克证券交易所	美国	686	413,971.21	0.04
242	Immunomedics Inc	Immunomedics 股份有限公司	IMMU UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,606	402,941.35	0.04
243	Qualys Inc	科力斯公司	QLYS UW	纳斯达克证券交易所	美国	531	391,033.49	0.04
244	General Electric Co	通用电气	GE UN	纽约证券交易所	美国	8,001	386,872.23	0.04
245	NXP Semiconductors NV	恩智浦半导体公司	NXPI UW	纳斯达克证券交易所	美国	479	386,718.82	0.04
246	Centene Corp	Centene 公司	CNC UN	纽约证券交易所	美国	854	384,216.50	0.04
247	VeriSign Inc	威瑞信股份有限公司	VRSN UW	纳斯达克证券交易所	美国	262	383,634.28	0.04
248	Marathon Oil Corp	Marathon 石油公司	MRO UN	纽约证券交易所	美国	8,833	382,703.33	0.04
249	Nevro Corp	Nevro 公司	NVRO UN	纽约证券交易所	美国	451	381,450.33	0.04
250	STERIS PLC	STERIS PLC	STE UN	纽约证券交易所	美国	347	376,938.63	0.04
251	Chegg Inc	Chegg 股份有限公司	CHGG UN	纽约证券交易所	美国	776	369,505.72	0.04
252	Allstate Corp/The	全州保险	ALL UN	纽约证券交易所	美国	532	365,292.86	0.04
253	SS&C Technologies Holdings Inc	SS&C 科技控股公司	SSNC UW	纳斯达克证券交易所	美国	909	363,463.80	0.04
254	Seagate Technology PLC	希捷科技公司	STX UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,045	358,140.93	0.04

255	Hilton Worldwide Holdings Inc	希尔顿全球控股股份有限公司	HLT UN	纽约证券交易所	美国	684	355,672.66	0.04
256	Paychex Inc	Paychex 公司	PAYX UW	纳斯达克证券交易所	美国	660	353,939.60	0.04
257	Activision Blizzard Inc	动视暴雪股份有限公司	ATVI UW	纳斯达克证券交易所	美国	650	349,267.13	0.04
258	Chewy Inc	Chewy Inc	CHWY UN	纽约证券交易所	美国	1,102	348,653.91	0.04
259	T Rowe Price Group Inc	普信集团公司	TROW UW	纳斯达克证券交易所	美国	398	347,978.66	0.04
260	McDonald's Corp	麦当劳	MCD UN	纽约证券交易所	美国	263	343,466.26	0.04
261	Kiniksa Pharmaceuticals Ltd	Kiniksa Pharmaceuticals Ltd	KNSA UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,903	343,273.91	0.04
262	Garmin Ltd	佳明有限公司	GRMN UW	纳斯达克证券交易所	美国	492	339,603.62	0.04
263	Gilead Sciences Inc	吉利德科学	GILD UW	纳斯达克证券交易所	美国	612	333,354.40	0.04
264	Bank of America Corp	美国银行控股公司	BAC UN	纽约证券交易所	美国	1,982	333,249.76	0.04
265	Novanta Inc	Novanta 股份有限公司	NOVT UW	纳斯达克证券交易所	美国	439	331,830.54	0.04
266	Redfin Corp	Redfin Corp	RDFN UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,098	325,778.63	0.03
267	Dover Corp	多佛	DOV UN	纽约证券交易所	美国	469	320,606.77	0.03
268	AutoZone Inc	AutoZone 公司	AZO UN	纽约证券交易所	美国	40	319,461.02	0.03
269	Tractor Supply Co	拖拉机供应公司	TSCO UW	纳斯达克证券交易所	美国	342	319,088.50	0.03
270	McCormick & Co Inc/MD	味好美股份有限公司 / 马里兰州	MKC UN	纽约证券交易所	美国	249	316,263.14	0.03
271	United Parcel Service Inc	联合包裹服务股份有限公司	UPS UN	纽约证券交易所	美国	398	313,265.33	0.03
272	Wayfair Inc	Wayfair	W UN	纽约证券交	美国	220	307,775.60	0.03

		股份有限 公司		易所				
273	Darling Ingred ients Inc	Darling Ingred ients 公 司	DAR UN	纽约证券交 易所	美国	1,754	305,717.45	0.03
274	Hologic Inc	豪洛捷公 司	HOLX UW	纳斯达克证 券交易所	美国	751	303,052.16	0.03
275	LHC Group Inc	LHC 集团 股份有限 公司	LHCG UW	纳斯达克证 券交易所	美国	245	302,354.12	0.03
276	Kellogg Co	家乐氏	K UN	纽约证券交 易所	美国	644	301,180.62	0.03
277	Alaska Air Gr oup Inc	阿拉斯加 航空集团 公司	ALK UN	纽约证券交 易所	美国	1,168	299,828.72	0.03
278	Lumentum Holdi ngs Inc	Lumentum 控股股份 有限公司	LITE UW	纳斯达克证 券交易所	美国	518	298,618.55	0.03
279	Wingstop Inc	Wingstop 股份有限 公司	WING UW	纳斯达克证 券交易所	美国	297	292,199.92	0.03
280	Axon Enterpris e Inc	Axon 企业 股份有限 公司	AAXN UW	纳斯达克证 券交易所	美国	418	290,389.34	0.03
281	Agilent Techno logies Inc	安捷伦	A UN	纽约证券交 易所	美国	459	287,157.48	0.03
282	Camping World Holdings Inc	Camping World 控股股份 有限公 司	CWH UN	纽约证券交 易所	美国	1,479	284,380.97	0.03
283	Parker-Hannifin Corp	派克汉尼 芬	PH UN	纽约证券交 易所	美国	218	282,846.27	0.03
284	Avalara Inc	Avalara Inc	AVLR UN	纽约证券交 易所	美国	299	281,720.99	0.03
285	Simpson Manufa cturing Co Inc	辛普森制 造有限公 司	SSD UN	纽约证券交 易所	美国	469	280,099.28	0.03
286	Incyte Corp	Incyte 有限公司	INCY UW	纳斯达克证 券交易所	美国	379	278,965.08	0.03
287	Cloudera Inc	Cloudera 公司	CLDR UN	纽约证券交 易所	美国	3,094	278,618.54	0.03
288	Arthur J Gall agher & Co	亚瑟加拉 格尔有限	AJG UN	纽约证券交 易所	美国	403	278,142.72	0.03

		公司						
289	Apollo Global Management Inc	阿波罗全球管理股份有限公司	APO UN	纽约证券交易所	美国	780	275,658.74	0.03
290	Winnebago Industries Inc	温尼巴格实业公司	WGO UN	纽约证券交易所	美国	576	271,662.50	0.03
291	KBR Inc	KBR 股份有限公司	KBR UN	纽约证券交易所	美国	1,650	263,410.50	0.03
292	Momenta Pharmaceuticals Inc	Momenta 制药股份有限公司	MNTA UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,104	260,030.60	0.03
293	RPM International Inc	RPM 国际公司	RPM UN	纽约证券交易所	美国	483	256,660.05	0.03
294	AECOM	AECOM 公司	ACM UN	纽约证券交易所	美国	964	256,469.90	0.03
295	HCA Healthcare Inc	HCA 医疗保健有限公司	HCA UN	纽约证券交易所	美国	370	254,240.42	0.03
296	Cooper Cos Inc/The	库柏股份有限公司	COO UN	纽约证券交易所	美国	125	251,003.67	0.03
297	First Financial Bankshares Inc	第一金融银行股份有限公司	FFIN UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,219	249,318.11	0.03
298	Flex Ltd	伟创力国际有限公司	FLEX UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,382	245,414.41	0.03
299	Radian Group Inc	Radian 集团股份有限公司	RDN UN	纽约证券交易所	美国	2,188	240,249.06	0.03
300	DraftKings Inc	DraftKings Inc	DKNG UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,009	237,583.35	0.03
301	Jacobs Engineering Group Inc	雅各布工程集团	J UN	纽约证券交易所	美国	393	235,934.25	0.03
302	Southern Co/The	南方公司	SO UN	纽约证券交易所	美国	639	234,559.06	0.02
303	Big Lots Inc	Big Lots 公司	BIG UN	纽约证券交易所	美国	769	228,653.69	0.02
304	Campbell Soup Co	金宝汤	CPB UN	纽约证券交易所	美国	640	224,867.57	0.02
305	Paylocity Holding Corp	Paylocity 控股公	PCTY UW	纳斯达克证券交易所	美国	215	222,058.07	0.02

		司						
306	Hubbell Inc	哈贝尔公司	HUBB UN	纽约证券交易所	美国	250	221,871.53	0.02
307	Oracle Corp	甲骨文	ORCL UN	纽约证券交易所	美国	562	219,901.59	0.02
308	Intel Corp	英特尔	INTC UW	纳斯达克证券交易所	美国	519	219,831.01	0.02
309	PPG Industries Inc	PPG 工业	PPG UN	纽约证券交易所	美国	291	218,497.87	0.02
310	Phillips 66	Phillips 66	PSX UN	纽约证券交易所	美国	416	211,750.68	0.02
311	L3Harris Technologies Inc	L3Harris Technologies 股份有	LHX UN	纽约证券交易所	美国	169	202,999.21	0.02
312	FirstEnergy Corp	第一能源	FE UN	纽约证券交易所	美国	735	201,789.11	0.02
313	Brunswick Corp /DE	布伦兹威克	BC UN	纽约证券交易所	美国	443	200,749.35	0.02
314	B&G Foods Inc	B&G 食品公司	BGS UN	纽约证券交易所	美国	1,161	200,386.52	0.02
315	Globant SA	Globant 股份有限公司	GLOB UN	纽约证券交易所	美国	187	198,381.40	0.02
316	STAAR Surgical Co	STAAR S urgical 公司	STAA UQ	纳斯达克证券交易所	美国	453	197,359.61	0.02
317	Anthem Inc	Anthem 股份有限公司	ANTM UN	纽约证券交易所	美国	106	197,347.29	0.02
318	SYNNEX Corp	SYNNEX 公司	SNX UN	纽约证券交易所	美国	230	195,019.69	0.02
319	ServiceMaster Global Holdings Inc	ServiceMaster 全球控股公司	SERV UN	纽约证券交易所	美国	764	193,037.86	0.02
320	AdaptHealth Corp	AdaptHealth Corp	AHCO UR	纳斯达克证券交易所	美国	1,693	192,968.06	0.02
321	MKS Instruments Inc	MKS Instruments 股份有限公司	MKSI UW	纳斯达克证券交易所	美国	240	192,403.82	0.02
322	Penn National	Penn 国	PENN UW	纳斯达克证	美国	885	191,344.02	0.02

	Gaming Inc	家博彩股份有限公司		券交易所				
323	Rexford Industrial Realty Inc	Rexford Industrial Realty 股	REXR UN	纽约证券交易所	美国	652	191,234.00	0.02
324	LivePerson Inc	LivePerson 股份有限公司	LPSN UW	纳斯达克证券交易所	美国	645	189,180.88	0.02
325	Murphy USA Inc	Murphy 美国股份有限公司	MUSA UN	纽约证券交易所	美国	237	188,908.17	0.02
326	Stifel Financial Corp	斯迪富融资公司	SF UN	纽约证券交易所	美国	562	188,708.74	0.02
327	Martin Marietta Materials Inc	Martin Marietta 材料股份有限公司	MLM UN	纽约证券交易所	美国	129	188,651.19	0.02
328	SpartanNash Co	SpartanNash 公司	SPTN UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,247	187,597.90	0.02
329	Stamps.com Inc	Stamps.com 股份有限公司	STMP UW	纳斯达克证券交易所	美国	144	187,262.40	0.02
330	Thor Industries Inc	霍尔工业公司	THO UN	纽约证券交易所	美国	246	185,528.07	0.02
331	Stanley Black & Decker Inc	史丹利百得公司	SWK UN	纽约证券交易所	美国	187	184,520.51	0.02
332	Vulcan Materials Co	Vulcan 材料	VMC UN	纽约证券交易所	美国	220	180,435.22	0.02
333	Eldorado Resorts Inc	Eldorado 度假股份有限公司	ERI UW	纳斯达克证券交易所	美国	635	180,089.03	0.02
334	II-VI Inc	贰陆公司	IIVI UW	纳斯达克证券交易所	美国	532	177,844.40	0.02
335	ABM Industries Inc	ABM Industries 公司	ABM UN	纽约证券交易所	美国	682	175,264.35	0.02
336	Leidos Holdings Inc	Leidos 控股公司	LDOS UN	纽约证券交易所	美国	264	175,068.11	0.02
337	Texas Roadhouse Inc	Texas Roadhouse 股份有限公司	TXRH UW	纳斯达克证券交易所	美国	470	174,919.58	0.02

		公司						
338	Albemarle Corp	雅保公司	ALB UN	纽约证券交易所	美国	315	172,181.58	0.02
339	iRhythm Technologies Inc	iRhythm 科技股份有限公司	IRTC UW	纳斯达克证券交易所	美国	208	170,652.20	0.02
340	Globus Medical Inc	Globus 医疗公司	GMED UN	纽约证券交易所	美国	502	169,557.00	0.02
341	Gentex Corp	镜泰公司	GNTX UW	纳斯达克证券交易所	美国	900	164,194.84	0.02
342	Brown & Brown Inc	Brown & Brown 股份有限公司	BRO UN	纽约证券交易所	美国	547	157,842.55	0.02
343	Kohl's Corp	Kohl's 公司	KSS UN	纽约证券交易所	美国	1,011	148,658.67	0.02
344	Hawaiian Holdings Inc	夏威夷控股有限公司	HA UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,469	146,012.99	0.02
345	F5 Networks Inc	F5 Networks 公司	FFIV UW	纳斯达克证券交易所	美国	145	143,180.06	0.02
346	Republic Services Inc	公共服务公司	RSG UN	纽约证券交易所	美国	242	140,571.26	0.01
347	NextEra Energy Inc	新纪元能源公司	NEE UN	纽约证券交易所	美国	82	139,423.25	0.01
348	Ryman Hospitality Properties Inc	Ryman 酒店房地产股份有限公司	RHP UN	纽约证券交易所	美国	568	139,132.00	0.01
349	Dominion Energy Inc	Dominion 能源公司	D UN	纽约证券交易所	美国	241	138,506.03	0.01
350	Alliance Data Systems Corp	联合数据系统公司	ADS UN	纽约证券交易所	美国	423	135,117.64	0.01
351	Avery Dennison Corp	艾利丹尼森	AVY UN	纽约证券交易所	美国	164	132,462.83	0.01
352	Yum China Holdings Inc	百胜中国控股有限公司	YUMC UN	纽约证券交易所	美国	359	122,171.85	0.01
353	Genpact Ltd	简柏特有限公司	G UN	纽约证券交易所	美国	464	119,964.11	0.01
354	Etsy Inc	Etsy 股份有限公司	ETSY UW	纳斯达克证券交易所	美国	156	117,320.62	0.01
355	RBC Bearings Inc	RBC 轴承公司	ROLL UW	纳斯达克证券交易所	美国	119	112,923.41	0.01

356	Ingersoll Rand Inc	英格索兰股份有限公司	IR UN	纽约证券交易所	美国	558	111,084.15	0.01
357	Essential Utilities Inc	必需公用事业股份有限公司	WTRG UN	纽约证券交易所	美国	364	108,849.86	0.01
358	Boston Scientific Corp	波士顿科学	BSX UN	纽约证券交易所	美国	429	106,632.77	0.01
359	Cirrus Logic Inc	Cirrus Logic 股份有限公司	CRUS UW	纳斯达克证券交易所	美国	215	94,034.87	0.01
360	Switch Inc	Switch Inc	SWCH UN	纽约证券交易所	美国	704	88,814.31	0.01
361	ONEOK Inc	Oneok 股份有限公司	OKE UN	纽约证券交易所	美国	328	77,139.36	0.01
362	AstraZeneca PLC	阿斯利康公共有限公司	AZN UN	纽约证券交易所	美国	202	75,635.82	0.01
363	Target Corp	塔吉特公司	TGT UN	纽约证券交易所	美国	86	73,017.82	0.01
364	Anaplan Inc	Anaplan Inc	PLAN UN	纽约证券交易所	美国	227	72,815.28	0.01
365	Norfolk Southern Corp	诺福克南方	NSC UN	纽约证券交易所	美国	46	57,175.60	0.01
366	Equity Lifestyle Properties Inc	Equity Lifestyle 房地产公司	ELS UN	纽约证券交易所	美国	89	39,367.12	0.00
367	Carlisle Cos Inc	卡莱股份有限公司	CSL UN	纽约证券交易所	美国	46	38,971.37	0.00

注：本表所使用的证券代码为彭博代码。

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	Microsoft Corp	MSFT UW	24,125,685.15	4.14
2	Amazon.com Inc	AMZN UW	23,805,953.33	4.09
3	Apple Inc	AAPL UW	18,034,296.72	3.10
4	Alphabet Inc	GOOGL UW	16,396,008.34	2.82

5	NVIDIA Corp	NVDA UW	12,584,853.10	2.16
6	Facebook Inc	FB UW	12,158,192.47	2.09
7	Netflix Inc	NFLX UW	9,154,242.75	1.57
8	UnitedHealth Group Inc	UNH UN	6,521,905.88	1.12
9	Adobe Inc	ADBE UW	6,191,363.23	1.06
10	Costco Wholesale Corp	COST UW	5,279,859.61	0.91
11	Home Depot Inc/The	HD UN	4,690,966.55	0.81
12	Eli Lilly and Co	LLY UN	4,527,609.04	0.78
13	NIKE Inc	NKE UN	4,411,675.02	0.76
14	Mastercard Inc	MA UN	4,333,204.69	0.74
15	Visa Inc	V UN	4,251,337.06	0.73
16	Coca-Cola Co/The	KO UN	4,168,257.79	0.72
17	PayPal Holdings Inc	PYPL UW	4,150,333.39	0.71
18	Abbott Laboratories	ABT UN	4,102,465.34	0.70
19	Gilead Sciences Inc	GILD UW	4,063,730.07	0.70
20	salesforce.com Inc	CRM UN	4,011,001.71	0.69

### 7.5.2 累计卖出金额前 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	Alphabet Inc	GOOGL UW	4,478,930.66	0.77
2	Gilead Sciences Inc	GILD UW	4,243,153.77	0.73
3	Merck & Co Inc	MRK UN	3,636,950.35	0.62
4	Netflix Inc	NFLX UW	3,353,181.18	0.58
5	PepsiCo Inc	PEP UW	3,277,136.33	0.56
6	Costco Wholesale Corp	COST UW	3,181,700.23	0.55
7	Quidel Corp	QDEL UW	3,146,009.77	0.54
8	Home Depot Inc/The	HD UN	2,840,017.81	0.49
9	Citrix Systems Inc	CTXS UW	2,827,285.93	0.49
10	Walmart Inc	WMT UN	2,746,881.95	0.47
11	Facebook Inc	FB UW	2,731,666.36	0.47
12	Intel Corp	INTC UW	2,727,171.11	0.47
13	Coca-Cola Co/The	KO UN	2,679,224.63	0.46
14	Comcast Corp	CMCSA UW	2,644,798.56	0.45
15	RingCentral Inc	RNG UN	2,640,444.88	0.45
16	Campbell Soup Co	CPB UN	2,554,756.78	0.44
17	International Business Machines Corp	IBM UN	2,471,285.74	0.42
18	Best Buy Co Inc	BBY UN	2,419,986.14	0.42
19	Amazon.com Inc	AMZN UW	2,408,513.71	0.41
20	Microsoft Corp	MSFT UW	2,401,161.40	0.41

### 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	549,828,350.81
卖出收入 (成交) 总额	323,533,959.64

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

## 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

无。

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

无。

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

无。

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

金额单位: 人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	ARK Innovation ETF	ETF	交易型开放式	ARK Investment Management LLC	1,828,022.54	0.19
2	VanEck Vectors Gold Miners ETF	ETF	交易型开放式	Van Eck Associates Corp	1,197,625.99	0.13
3	ARK Next Generation Internet ETF	ETF	交易型开放式	ARK Investment Management LLC	586,278.88	0.06
4	ARK Fintech Innovation ETF	ETF	交易型开放式	ARK Investment Management LLC	512,200.27	0.05
5	SPDR Gold Shares	ETF	交易型开放式	World Gold Trust Services LLC	324,661.48	0.03
6	iPath Series	ETN	交易型开	Barclays	268,469.86	0.03

	B S&P 500 VIX Short-Term Futures ETN		放式	Capital Inc		
7	iShares 20+ Year Treasury Bond ETF	ETF	交易型开 放式	BlackRock Fund Advisors	51,063.87	0.01
8	iShares Russell 3000 ETF	ETF	交易型开 放式	BlackRock Fund Advisors	1,274.73	0.00

注：报告期末，本基金仅持有上述 8 支基金。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

### 7.11.2

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	1,516,406.32
3	应收股利	264,234.48
4	应收利息	5,287.40
5	应收申购款	22,280,802.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,066,730.96

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## § 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	户均持有	持有人结构
------	------	------	-------

	数(户)	的基金份 额	机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
嘉实美国成 长股票型证 券投资基金- 人民币	248,796	1,488.22	331,048.47	0.09	369,931,378.18	99.91
嘉实美国成 长股票型证 券投资基金- 美元现汇	347	10,907.05	-	-	3,784,744.87	100.00
合计	249,100	1,501.59	331,048.47	0.09	373,716,123.05	99.91

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

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

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管 理人所有从业 人员持 有本基 金	嘉实美国成长股票型证券投资 基金-人民币	47,585.31	0.01
	嘉实美国成长股票型证券投资 基金-美元现汇	-	-
	合计	47,585.31	0.01

## 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、 基金投资和部门 负责人持有本开放式 基金	嘉实美国成长股票型证券投资 基金-人民币	0
	嘉实美国成长股票型证券投资 基金-美元现汇	0
	合计	0

本基金基金经理持有 本开放式基金	嘉实美国成长股票型证券投资 基金-人民币	0
	嘉实美国成长股票型证券投资 基金-美元现汇	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实美国成长股票型证券投资基 金-人民币	嘉实美国成长股票型证券投资基 金-美元现汇
基金合同生效日（2013年6 月14日）基金份额总额	430,245,997.74	7,592,329.66
本报告期期初基金份额总额	243,668,694.53	3,918,028.61
本报告期基金总申购份额	577,813,847.07	1,600,280.57
减：本报告期基金总赎回份额	451,220,114.95	1,733,564.31
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	370,262,426.65	3,784,744.87

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### （1）基金管理人的重大人事变动情况

2020年4月8日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，宋振茹女士因退休不再担任公司副总经理职务。

2020年5月6日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司机构首席投资官任职公告》，郭杰先生任公司机构首席投资官。

2020年6月19日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，郭松先生任公司督察长，王炜女士因工作分工不再担任公司督察长职务。

#### （2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

**10.4 基金投资策略的改变**

报告期内本基金投资策略未发生改变。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

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

**10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

报告期内，本基金管理人、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	
Wolfe Research Securities	-	866,168,981.16	100.00%	610,858.35	100.00%	
德意志银行股份有限公司 Deutsche Bank	-	-	-	-	-	
瑞士信贷（香港）有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	
瑞银集团 Union Bank of Switzerland	-	-	-	-	-	
中信证券国际有限公司 CITIC Securities	-	-	-	-	-	

International Company Limited						
花旗环球金融亚洲有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited	-	-	-	-	-	
麦格理资本证券股份有限公司 Macquarie Securities Group	-	-	-	-	-	
金贝塔证券有限公司 iGoldenbeta Securities Company Limited	-	-	-	-	-	

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

## 2. 交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；
- (2) 公司财务状况良好；
- (3) 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；
- (4) 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确地信息资讯服务。基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	基金交易	
	成交金额	占当期基金成交总额的比例
Wolfe Research Securities	6,483,964.42	100.00%

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于嘉实美国成长股票（QDII）2020年1月20日暂停申购、赎回及定投业务公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年01月16日

2	嘉实基金管理有限公司关于根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改旗下部分基金基金合同及托管协议的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 01 月 22 日
3	关于嘉实美国成长股票（QDII）2020 年 2 月 17 日暂停申购、赎回及定投资业务公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 02 月 13 日
4	嘉实基金管理有限公司关于面向养老金客户实施特定申购费率的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 04 月 02 日
5	关于嘉实美国成长股票（QDII）2020 年 4 月 10 日暂停申购、赎回及定投资业务公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 04 月 08 日
6	关于嘉实美国成长股票（QDII）2020 年 5 月 25 日暂停申购、赎回及定投资业务公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 05 月 21 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

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

### 11.2 存放地点

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

### 11.3 查阅方式

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

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

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

嘉实基金管理有限公司

2020 年 08 月 29 日