

# 嘉实美国成长股票型证券投资基金 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 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：2021 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度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 2021 年 03 月 23 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。

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 2020 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	11
3.4 过去三年基金的利润分配情况	11
<b>§4 管理人报告</b>	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	18
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	18
<b>§5 托管人报告</b>	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	18
<b>§6 审计报告</b>	<b>18</b>
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	19
<b>§7 年度财务报表</b>	<b>20</b>
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22

7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
<b>§8 投资组合报告 .....</b>	<b>49</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	49
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 .....	50
8.3 期末按行业分类的权益投资组合 .....	50
8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 .....	50
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动 .....	97
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....	99
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 .....	99
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 .....	99
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 .....	99
8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....	99
8.11 投资组合报告附注.....	100
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>101</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	101
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	101
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	102
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>102</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>102</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	102
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	102
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	103
11.4 基金投资策略的改变.....	103
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	103
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	103
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	103
11.8 其他重大事件.....	106
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>106</b>
12.1 备查文件目录.....	106
12.2 存放地点.....	107
12.3 查阅方式.....	107

## § 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	361,243,103.29 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	357,757,773.39 份	3,485,329.90 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	<p>本基金不尝试进行择时操作。在正常的市场条件下，本基金将在基金合同以及法律法规所允许的投资范围内，最大程度的持有股票类资产。当基金经理认为足够审慎时，本基金亦可以将小部分资产配置于债券类和现金类等大类资产上。</p> <p>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。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。</p> <p>本基金主要投资于市值超过 20 亿美元的美国大盘股票；在此基础上，本基金将通过成长性模型挑选出足够数量的最具成长性的股票作为股票选择的样本空间。</p> <p>具体投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、固定收益投资策略、衍生品投资策略。</p>
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
	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 境外投资顾问和境外资产托管人

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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据 和指 标	报告期（2020 年 1 月 1 日-2020 年 12 月 31 日）		报告期（2019 年 1 月 1 日-2019 年 12 月 31 日）		报告期（2018 年 1 月 1 日-2018 年 12 月 31 日）	
	嘉实美国成长股票型证券投资基金	嘉实美国成长股票型证券投资	嘉实美国成长股票型证券投资基金	嘉实美国成长股票型证券投资	嘉实美国成长股票型证券投资基金	嘉实美国成长股票型证券投资

	金-人民币	资基金-美元现 汇	金-人民币	资基金-美元现 汇	金-人民币	资基金-美元现 汇
本期已实现收益	60,328,922.02	3,447,194.89	11,018,861.08	1,197,356.79	-30,820,735.98	-3,307,258.18
本期利润	240,302,644.30	11,572,962.71	124,373,284.55	12,250,650.46	-81,009,968.73	-272,182.09
加权平均基金份额本期利润	0.6707	3.1570	0.5078	3.0500	-0.4818	-0.0641
本期加权平均净值利润率	27.91%	21.72%	26.03%	25.53%	-26.02%	-0.58%
本期基金份额净值增长率	26.93%	35.75%	29.76%	27.48%	1.39%	-3.80%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
期末可供分配利润	161,551,067.79	12,249,036.00	70,006,127.58	9,850,888.27	65,410,707.07	9,196,069.70
期末可供分配基金份额利润	0.4516	3.5145	0.2873	2.5142	0.2318	2.1948
期末基金资产	988,053,266.39	58,716,221.41	530,314,760.53	51,986,247.24	473,248,826.73	42,912,619.77

净值						
期末 基金 份额 净值	2.762	2.582	2.176	1.902	1.677	1.492
3.1.3 累计 期末 指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
基金 份额 累计 净值 增长 率	176.20%	158.20%	117.60%	90.20%	67.70%	49.20%

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）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。

（3）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。

（4）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
过去三个月	6.19%	1.27%	10.61%	1.20%	-4.42%	0.07%
过去六个月	15.28%	1.36%	24.25%	1.29%	-8.97%	0.07%
过去一年	26.93%	2.10%	35.40%	2.13%	-8.47%	-0.03%



过去三年	66.99%	1.51%	75.20%	1.49%	-8.21%	0.02%
过去五年	114.61%	1.25%	133.57%	1.22%	-18.96%	0.03%
自基金合同生效起 至今	176.20%	1.13%	209.92%	1.10%	-33.72%	0.03%

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
过去三个月	10.86%	1.28%	10.61%	1.20%	0.25%	0.08%
过去六个月	25.10%	1.36%	24.25%	1.29%	0.85%	0.07%
过去一年	35.75%	2.09%	35.40%	2.13%	0.35%	-0.04%
过去三年	66.47%	1.49%	75.20%	1.49%	-8.73%	0.00%
过去五年	112.34%	1.24%	133.57%	1.22%	-21.23%	0.02%
自基金合同生效起 至今	158.20%	1.11%	209.92%	1.10%	-51.72%	0.01%

注：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：

$$\text{Return}(t) = 95\% \times \text{罗素 1000 成长指数收益率}(t) + 5\% \times \text{境内银行活期存款税后利率}^{\wedge}(1/365)$$

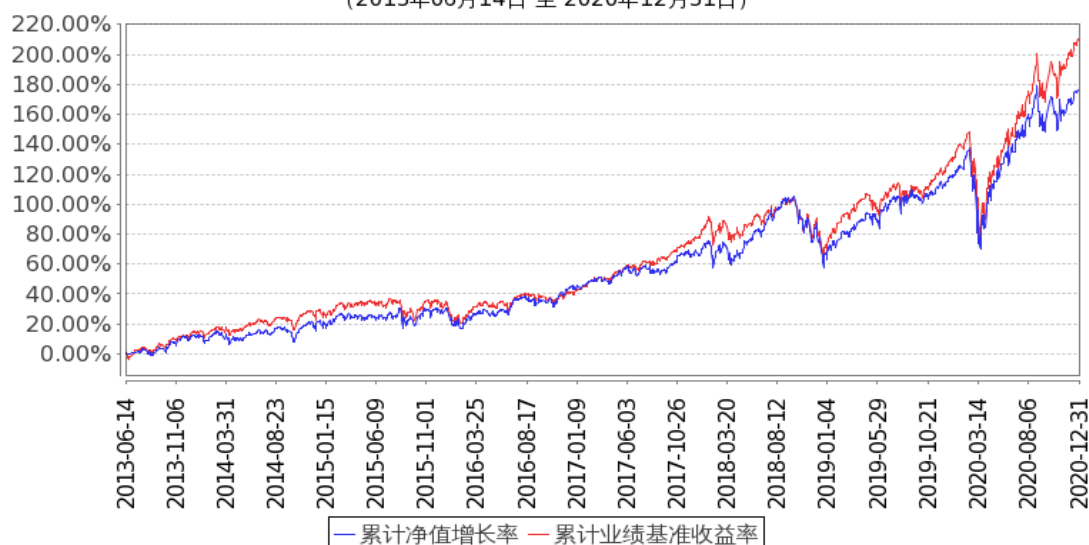
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

其中， $t = 1, 2, 3, \dots, T$ ， $T$  表示时间截至日。

### 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

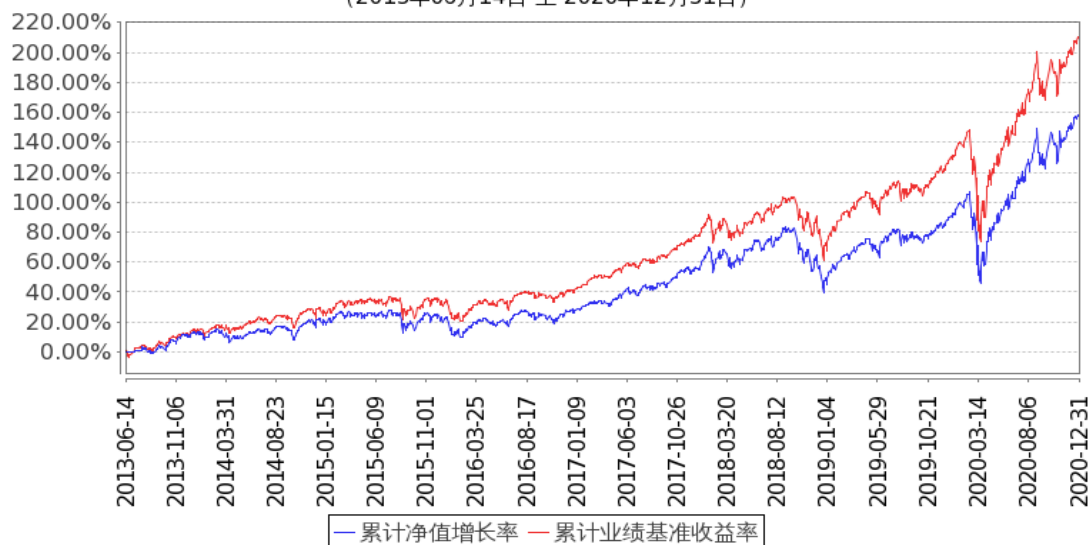
#### 嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013年06月14日至2020年12月31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

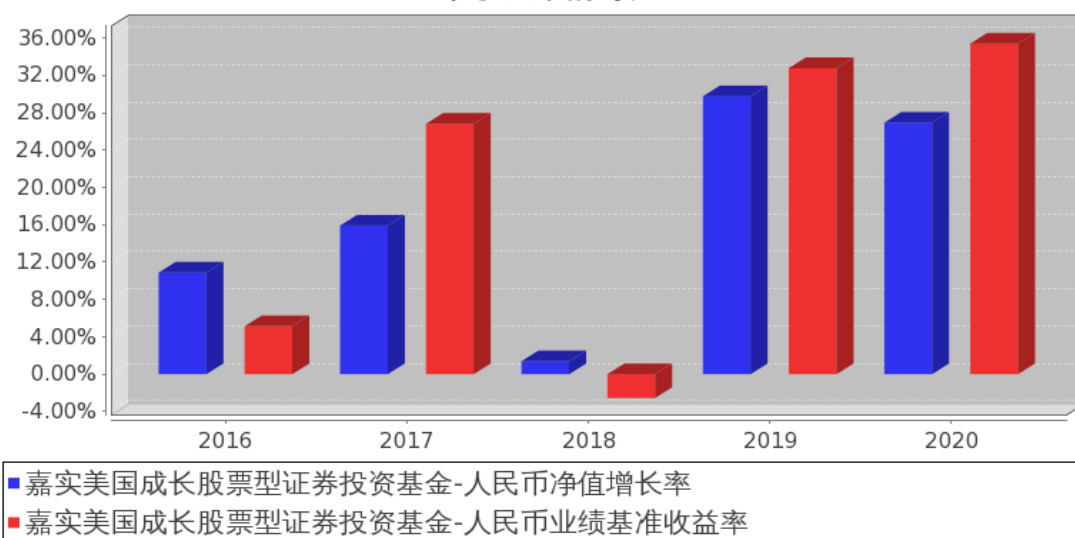
(2013年06月14日至2020年12月31日)



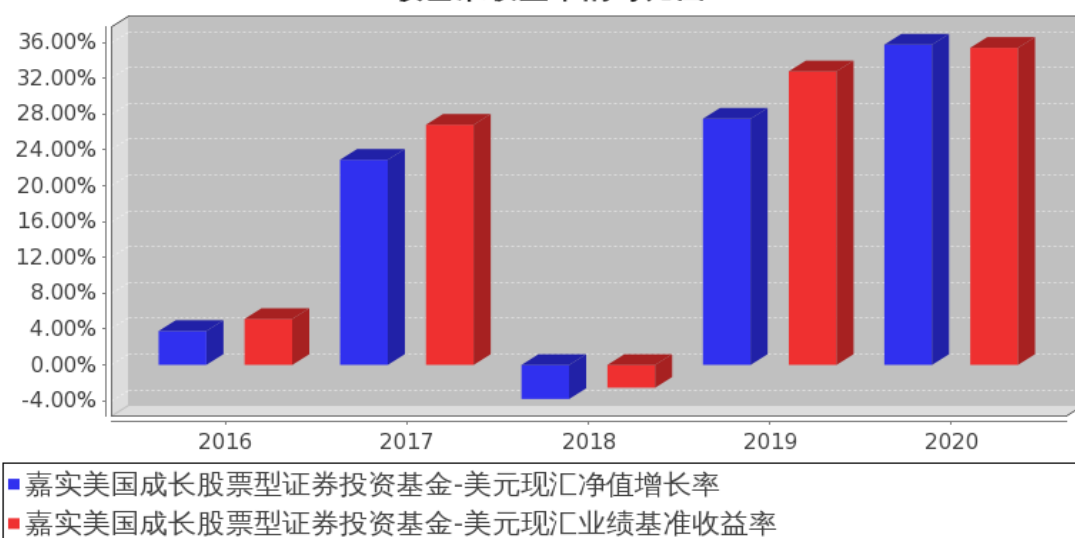
注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

**嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图**



**嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图**



注：上述数据根据基金当年实际存续期计算。

### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 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

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5 号文批准，于 1999 年 3 月 25 日成立，是中国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，总部设在北京并设北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII 资格和特定资产管理业务资格。

截止 2020 年 12 月 31 日，基金管理人共管理 205 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、嘉实海外中国股票混合（QDII）、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-LOF）、嘉实主题新动力混合、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 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、嘉实丰和灵活配置混合、嘉实新添华定期混合、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、嘉实互通精选股票、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 年国开债指数、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、嘉实致嘉纯债债券、嘉实产业先锋混合、嘉实远见精选两年持有期混合、嘉实致业一年定期纯债债券、嘉实安泽一年定期纯债债券、嘉实前沿创新混合、嘉实远见企业精选两年持有期混合、嘉实价值发现三个月定期混合、嘉实 H 股 50ETF（QDII）、嘉实浦惠 6 个月持有期混合、嘉实创新先锋混合、嘉实核心成长混合、嘉实彭博国开债 1-5 年指数、嘉实动力先锋混合、嘉实多利收益债券、嘉实稳惠 6 个月持有期混合、嘉实优质精选混合、嘉实稳骏纯债基金、嘉实价值长青混合。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）首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，此后的非首任基金经理的“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期。

（2）证券从业的含义遵从《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 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，

交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《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；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

#### 4.3.3 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 年度，美国股票市场延续了多年牛市，整体上继续保持上行趋势。

开年后，美国股票市场表现基本符合了传统的季节效应，在一月份保持稳健。进入一季度中后期，随着美国国内疫情的逐步失控，传染人数和疫情致死人数的上升，美股开始回调，并且在美国政府不严谨和不正确的引导，以及对疫情防控的不力应对下，美股在 2 月中旬之后经历了历史级别的快速深度回调，期间美股熔断多次，回调幅度超过近年来在 2018 年末的调整，短期强度甚至大于 2007-2008 年的金融危机。最终，在货币政策强刺激下，美股在一季度末开启反弹。

今年美股市场主要的风险驱动因素，一方面是疫情对经济增长和投资者信心的负面影响，一方面是为应对疫情而推出的各项货币和财政刺激政策在国民经济和资本市场产生的结构性失衡的系统风险。一季度，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。其后，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，同时，宽松的货币政策也成为价值风格持续低迷的一部分解释原因，美股小盘价值在 2020 年一个年度内就落后小盘成长风格超过 30%。

风险层面，中美贸易摩擦在上半年处于一阶段协议执行期内而较为稳定，之后美国国内焦点

转向疫情、经济失速、新总统竞选以及党派竞争的多条主线。全球经济在遭受疫情重创后逐步增加了对疫情防控有力并且生产能力恢复的中国，中美贸易摩擦等相关风险在下半年几乎淡出美股资本市场定价范围。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，其中，不少大市值成长股实际上是在全球范围内经营，并且受益于中国分支的快速恢复。

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，并通过对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 2.762 元，本报告期基金份额净值增长率为 26.93%；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 2.582 美元，本报告期基金份额净值增长率为 35.75%；业绩比较基准收益率为 35.40%。

#### 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，核心逻辑是美国上市公司的企业盈利在后续的疫情稳定和经济恢复进程中会逐步向好，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，资本市场以及逐步消化美国疫情失控的预期，新任美国总统选举也已落地，各项不确定性因素的稳定有利于资本市场的稳健发展。



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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人有关法律稽核工作情况如下：

（1）继续内控前置，在基金营销、投资管理、信息披露以及新产品设计开发、海外业务、另类业务、制度建设、合同管理、法律咨询等方面，事前进行合规性审核、监控。对于新产品、新业务，从战略规划到具体产品方案，在制度流程、投资范围、投资工具、运作规则等方面，防控重大风险。

（2）主要从事前研讨、合规审核、全方位合规监控、数据库维护、“三条底线”防范、合规培训等方面，积极开展各项合规管理工作。

（3）按计划对销售、投资、后台和其它业务开展内部稽核，完成相应内审报告及其后续改进跟踪。完成公司及基金的外审、公司 GIPS 第三方验证、ISAE3402 国际鉴证等。

（4）负责日常法律事务工作，包括合同、协议审查（包括各类产品及业务），主动解决各项法律文件以及实务运作中存在的差错和风险隐患，未发现新增产品、新增业务以及日常业务的法律风险问题。

（5）加强差错管理，继续推动各业务单元梳理流程、制度，落实风险责任授权体系，确保所有识别的关键风险点均有相应措施控制。

此外，我们还积极配合监管机关、社保基金理事会的检查以及统计调查工作，按时完成合规报告和各项统计、专题报告。

#### 4.7 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；与估值相关的机构包括基金投资市场的各证券交易所以及境内相关机构等。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

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

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见

审计报告编号	普华永道中天审字(2021)第 23423 号
--------	-------------------------

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	嘉实美国成长股票型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了嘉实美国成长股票型证券投资基金(以下简称“嘉实美国成长股票(QDII)基金”)的财务报表,包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表,2020 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了嘉实美国成长股票(QDII)基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于嘉实美国成长股票(QDII)基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>嘉实美国成长股票(QDII)基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估嘉实美国成长股票(QDII)基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算嘉实美国成长股票(QDII)基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督嘉实美国成长股票(QDII)基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影</p>

	<p>响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（一） 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（二） 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（三） 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（四） 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对嘉实美国成长股票（QDII）基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致嘉实美国成长股票（QDII）基金不能持续经营。</p> <p>（五） 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	薛竞	周玮
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2021 年 03 月 25 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			

银行存款	7.4.7.1	76,054,976.46	43,948,155.63
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	991,307,002.54	544,350,717.17
其中：股票投资		986,869,713.76	541,140,957.44
基金投资		4,437,288.78	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		11,065,561.54	-
应收利息	7.4.7.5	5,130.37	6,402.98
应收股利		171,405.92	343,915.09
应收申购款		7,374,212.08	9,547,797.95
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,085,978,288.91	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 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
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		36,882,839.89	7,265,919.92
应付管理人报酬		1,643,331.86	838,841.06
应付托管费		319,536.76	163,107.98
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费		6,266.83	17,049.60
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	356,825.77	212,617.87
负债合计		39,208,801.11	15,895,981.05
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	379,227,706.27	267,807,042.89
未分配利润	7.4.7.10	667,541,781.53	314,493,964.88
所有者权益合计		1,046,769,487.80	582,301,007.77
负债和所有者权益总计		1,085,978,288.91	598,196,988.82

注： 报告截止日 2020 年 12 月 31 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

2.762 元，基金份额总额 357,757,773.39 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 2.582 美元，基金份额总额 3,485,329.90 份，基金份额总额合计为 361,243,103.29 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		273,010,964.13	148,332,214.99
1. 利息收入		209,322.60	150,848.37
其中：存款利息收入	7.4.7.11	209,322.60	150,848.37
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）		87,186,826.46	22,613,865.56
其中：股票投资收益	7.4.7.12	78,673,886.14	17,516,873.14
基金投资收益	7.4.7.13	1,219,011.31	-321,029.85
债券投资收益	7.4.7.14	-	-
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	7,293,929.01	5,418,022.27
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	188,099,490.10	124,407,717.14
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-5,281,858.03	255,072.16
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	2,797,183.00	904,711.76
减：二、费用		21,135,357.12	11,708,279.98
1. 管理人报酬		16,395,893.28	9,469,844.71
2. 托管费		3,188,090.44	1,841,358.71
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	1,273,406.01	195,772.59
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		14,470.95	1,829.71
7. 其他费用	7.4.7.21	263,496.44	199,474.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		251,875,607.01	136,623,935.01
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		251,875,607.01	136,623,935.01

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	251,875,607.01	251,875,607.01
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）	111,420,663.38	101,172,209.64	212,592,873.02
其中：1. 基金申购款	960,528,097.67	1,246,087,464.85	2,206,615,562.52
2. 基金赎回款	-849,107,434.29	-1,144,915,255.21	-1,994,022,689.50
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）	379,227,706.27	667,541,781.53	1,046,769,487.80
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	136,623,935.01	136,623,935.01
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）	-40,214,449.10	-30,269,924.64	-70,484,373.74
其中：1. 基金申购款	312,430,334.02	297,765,970.44	610,196,304.46
2. 基金赎回款	-352,644,783.12	-328,035,895.08	-680,680,678.20
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）	267,807,042.89	314,493,964.88	582,301,007.77

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

经雷

罗丽丽

罗丽丽

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

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。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。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。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实美国成长股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### （1）金融资产的分类

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

基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以交易性金融资产列示。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以衍生金融资产列示。

基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

###### （2）金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中以衍生金融负债列示。基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场,采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时,优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件,应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金,由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金,上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的现金红利扣除基金交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算或者发行价计算的利息扣除在交易所在地适用的预缴所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项,根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分,将本金部分冲减资产支持证券投资成本,并将投资收益部分扣除在适用情

况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

基金的管理人报酬、托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

基金收益分配是指按规定将基金的可分配收益按基金份额进行比例分配。由于本基金两类基金份额类别分别以人民币和美元计价，两类基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同类别的每份基金份额享有同等分配权。基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，对某一基金份额类别，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利。如果基金份额持有人选择或默认选择现金分红形式，则美元份额以美元进行现金分红，人民币份额以人民币进行现金分红；如果选择红利再投资形式，则同一类别基金份额的分红资金将按除息日该类别的基金份额净值转成相应的同一类别的基金份额，红利再投资的份额免收申购费。在符合基金收益分配条件的情况下，本基金收益每年最多分配 6 次，各类基金份额收益分配比例分别不得低于收益分配基准日该类基金份额的可供分配利润的 10%。基金收益分配后各类基金份额的每一基金份额净值分别不能低于其面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为

人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金无其他重要的会计政策和会计估计。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	76,054,976.46	43,948,155.63
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	76,054,976.46	43,948,155.63

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	700,506,506.13	986,869,713.76	286,363,207.63
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		3,127,204.29	4,437,288.78	1,310,084.49
其他		-	-	-
合计		703,633,710.42	991,307,002.54	287,673,292.12
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日			
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		441,614,630.55	541,140,957.44	99,526,326.89
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		3,162,284.60	3,209,759.73	47,475.13
其他		-	-	-
合计		444,776,915.15	544,350,717.17	99,573,802.02

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	5,121.31	6,397.31
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	9.06	5.67
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	-	-
合计	5,130.37	6,402.98

#### 7.4.7.6 其他资产

无。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

无。

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	126,825.77	22,617.87
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	230,000.00	190,000.00
合计	356,825.77	212,617.87

#### 7.4.7.9 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 12 月 31 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	944,363,882.56	944,363,882.56
本期赎回（以“-”号填列）	-830,274,803.70	-830,274,803.70
-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	357,757,773.39	357,757,773.39

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 12 月 31 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	2,625,038.35	16,164,215.11
本期赎回（以“-”号填列）	-3,057,737.06	-18,832,630.59
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	3,485,329.90	21,469,932.88

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 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	60,328,922.02	179,973,722.28	240,302,644.30
本期基金份额交易产生的变动数	31,216,018.19	72,130,764.51	103,346,782.70
其中：基金申购款	291,093,831.63	933,079,703.41	1,224,173,535.04
基金赎回款	-259,877,813.44	-860,948,938.90	-1,120,826,752.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	161,551,067.79	468,744,425.21	630,295,493.00

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	3,447,194.89	8,125,767.82	11,572,962.71
本期基金份额交易产生的变动数	-1,049,047.16	-1,125,525.90	-2,174,573.06
其中：基金申购款	7,074,877.54	14,839,052.27	21,913,929.81
基金赎回款	-8,123,924.70	-15,964,578.17	-24,088,502.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,249,036.00	24,997,252.53	37,246,288.53

#### 7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	208,371.30	150,606.72
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	951.30	241.65
合计	209,322.60	150,848.37

## 7.4.7.12 股票投资收益

## 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	78,673,886.14	17,516,873.14
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	78,673,886.14	17,516,873.14

## 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	866,404,177.73	512,715,636.71
减：卖出股票成本总额	787,730,291.59	495,198,763.57
买卖股票差价收入	78,673,886.14	17,516,873.14

## 7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

## 7.4.7.13 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
卖出/赎回基金成交总额	14,606,024.40	9,160,356.16
减：卖出/赎回基金成本总额	13,387,013.09	9,481,386.01
基金投资收益	1,219,011.31	-321,029.85

## 7.4.7.14 债券投资收益

## 7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

无。

#### 7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

#### 7.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 7.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

##### 7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 7.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

##### 7.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

##### 7.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

##### 7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	7,237,102.87	5,395,758.89
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	56,826.14	22,263.38
合计	7,293,929.01	5,418,022.27

## 7.4.7.18 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	188,099,490.10	124,407,717.14
股票投资	186,836,880.74	124,728,741.36
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	1,262,609.36	-321,024.22
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	188,099,490.10	124,407,717.14

## 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	2,797,183.00	904,711.76
合计	2,797,183.00	904,711.76

## 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	1,273,406.01	195,772.59
银行间市场交易费用	-	-

合计	1,273,406.01	195,772.59
----	--------------	------------

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
审计费用	110,000.00	70,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	33,496.44	9,474.26
合计	263,496.44	199,474.26

#### 7.4.7.22 分部报告

无。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司（“嘉实基金”）	基金管理人
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
DWS Investments Singapore Limited	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
嘉实资本管理有限公司（“嘉实资本”）	基金管理人的控股子公司
嘉实财富管理有限公司（“嘉实财富”）	基金管理人的控股子公司

#### 7.4.10 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。

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

## 7.4.10.1.2 债券交易

无。

## 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

## 7.4.10.1.4 基金交易

无。

## 7.4.10.1.5 权证交易

无。

## 7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

## 7.4.10.2 关联方报酬

## 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	16,395,893.28	9,469,844.71
其中：支付销售机构的客户维护费	6,144,291.10	3,509,399.98

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 1.80%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×1.80%/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。

## 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,188,090.44	1,841,358.71

注：支付基金托管人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。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

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

无。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

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

无。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司_活期	76,054,976.46	208,371.30	43,948,155.63	150,606.72

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

本期(2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日), 本基金未实施利润分配。

#### 7.4.12 期末(2020 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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



人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和 risk 管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

公司建立包括董事会、管理层、各部门及一线员工组成的四道风控防线，还有董事会风险控制与内审委员会、公司风险控制委员会、督察长及其合规管理部门、风险管理部门，评估各项风险并提出防控措施并有效执行。

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

#### 7.4.13.2 信用风险

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

基金的银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，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。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

**7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

无。

**7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

**7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

无。

**7.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人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。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

**7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照相关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。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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交易，因此除附注 7.4.12 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。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	76,054,976.46	-	-	-	76,054,976.46
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	991,307,002.54	991,307,002.54
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	11,065,561.54	11,065,561.54
应收利息	-	-	-	5,130.37	5,130.37
应收股利	-	-	-	171,405.92	171,405.92
应收申购款	-	-	-	7,374,212.08	7,374,212.08
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	76,054,976.46	-	-	1,009,923,312.45	1,085,978,288.91
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	-	-	-	36,882,839.89	36,882,839.89
应付管理人报酬	-	-	-	1,643,331.86	1,643,331.86
应付托管费	-	-	-	319,536.76	319,536.76
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应付税费	-	-	-	6,266.83	6,266.83
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	356,825.77	356,825.77
负债总计	-	-	-	39,208,801.11	39,208,801.11
利率敏感度缺口	76,054,976.46	-	-	970,714,511.34	1,046,769,487.80
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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2019 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0%)，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)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有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币计价的资产和负债进行监控。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 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	34,226,478.31	-	-	34,226,478.31
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	991,307,002.54	-	-	991,307,002.54
衍生金融资产	-	-	-	-
应收股利	171,405.92	-	-	171,405.92
应收利息	1,345.11	-	-	1,345.11
应收申购款	219,225.22	-	-	219,225.22
应收证券清算款	11,065,561.54	-	-	11,065,561.54

其它资产	-	-	-	-
资产合计	1,036,991,018.64	-	-	1,036,991,018.64
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
应付赎回款	90,010.80	-	-	90,010.80
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	245.14	-	-	245.14
负债合计	90,255.94	-	-	90,255.94
资产负债表外汇风险敞口净额	1,036,900,762.70	-	-	1,036,900,762.70
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

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020 年 12 月 31 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%	51,845,038.14	27,418,146.46
	所有外币相对人民币贬值 5%	-51,845,038.14	-27,418,146.46

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。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。

## 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 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	986,869,713.76	94.28	541,140,957.44	92.93
交易性金融资产—基金投资	4,437,288.78	0.42	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	991,307,002.54	94.70	544,350,717.17	93.48

## 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩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 12 月 31 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准上升 5%	51,239,291.72	28,139,189.90
	业绩比较基准下降 5%	-51,239,291.72	-28,139,189.90

## 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

## (1) 公允价值

## (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

## (b) 持续的以公允价值计量的金融工具



## (i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，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 991,307,002.54 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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	986,869,713.76	90.87
	其中：普通股	981,387,944.36	90.37
	存托凭证	4,265,872.09	0.39
	优先股	—	—
	房地产信托凭证	1,215,897.31	0.11
2	基金投资	4,437,288.78	0.41
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	76,054,976.46	7.00
8	其他各项资产	18,616,309.91	1.71
9	合计	1,085,978,288.91	100.00

## 8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
美国	986,869,713.76	94.28
合计	986,869,713.76	94.28

## 8.3 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	452,401,704.00	43.22
非必需消费品	177,891,109.29	16.99
通信服务	112,918,892.95	10.79
医疗保健	108,239,068.91	10.34
必需消费品	32,979,837.02	3.15
工业	52,248,991.67	4.99
金融	30,281,686.77	2.89
原材料	16,466,654.47	1.57
公用事业	211,045.94	0.02
能源	1,922,130.03	0.18
房地产	92,695.40	0.01
房地产信托特殊类	637,085.30	0.06
房地产信托抵押类	131,198.19	0.01
房地产信托医疗保健类	228,375.09	0.02
房地产信托零售类	219,238.73	0.02
合计	986,869,713.76	94.28

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

## 8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称	证券代码	所在证券市场	所属	数量（股）	公允价值	占基金资产
----	----------	------	------	--------	----	-------	------	-------

		(中文)			国家 (地区)			产净值比例(%)
1	Apple Inc	苹果公司	AAPL UW	纳斯达克 证券交易所	美国	119,333	103,317,196.47	9.87
2	Microsoft Corp	Microsoft Corp	MSFT UW	纳斯达克 证券交易所	美国	60,982	88,501,240.91	8.45
3	Amazon.com Inc	亚马逊公司	AMZN UW	纳斯达克 证券交易所	美国	3,779	80,308,067.72	7.67
4	Alphabet Inc	Alphabet Inc	GOOGL UW	纳斯达克 证券交易所	美国	3,943	45,091,362.30	4.31
5	Facebook Inc	Facebook Inc	FB UW	纳斯达克 证券交易所	美国	20,368	36,302,735.42	3.47
6	Tesla Inc	Tesla Inc	TSLA UW	纳斯达克 证券交易所	美国	7,398	34,063,544.90	3.25
7	NVIDIA Corp	NVIDIA Corp	NVDA UW	纳斯达克 证券交易所	美国	7,410	25,248,113.60	2.41
8	PayPal Holdings Inc	PayPal Holdings Inc	PYPL UW	纳斯达克 证券交易所	美国	12,914	19,734,291.22	1.89
9	Visa Inc	Visa Inc	V UN	纽约证 券交易所	美国	13,491	19,254,238.87	1.84
10	Mastercard Inc	Mastercard Inc	MA UN	纽约证 券交易所	美国	7,067	16,459,027.50	1.57
11	UnitedHealth Group Inc	UnitedHealth Group Inc	UNH UN	纽约证 券交易所	美国	6,032	13,802,132.45	1.32
12	NIKE Inc	NIKE Inc	NKE UN	纽约证 券交易所	美国	13,269	12,248,316.71	1.17

				所				
13	Broadcom Inc	博通股份有限公司	AVGO UW	纳斯达克 证券交易所	美国	4,182	11,947,670.66	1.14
14	QUALCOMM Inc	QUALCOMM Inc	QCOM UW	纳斯达克 证券交易所	美国	11,651	11,581,132.05	1.11
15	Netflix Inc	Netflix Inc	NFLX UW	纳斯达克 证券交易所	美国	3,201	11,293,797.58	1.08
16	Costco Wholesale Corp	好市多批发	COST UW	纳斯达克 证券交易所	美国	4,574	11,244,958.63	1.07
17	Adobe Inc	奥多比	ADBE UW	纳斯达克 证券交易所	美国	3,350	10,931,830.51	1.04
18	Square Inc	Square Inc	SQ UN	纽约证 券交易 所	美国	6,638	9,426,485.97	0.90
19	Advanced Micro Devices Inc	AMD 公司	AMD UR	纳斯达克 证券交易所	美国	13,562	8,115,481.53	0.78
20	AbbVie Inc	艾伯维生物制药公司	ABBV UN	纽约证 券交易 所	美国	9,968	6,969,057.77	0.67
21	ServiceNow Inc	ServiceNow Inc	NOW UN	纽约证 券交易 所	美国	1,919	6,892,089.86	0.66
22	Thermo Fisher Scientific Inc	Thermo Fisher Scientific Inc	TMO UN	纽约证 券交易 所	美国	2,177	6,616,268.57	0.63
23	Intuitive Surgical Inc	Intuitive Surgical Inc	ISRG UW	纳斯达克 证券交易所	美国	1,231	6,571,103.47	0.63
24	salesforce.com	Sales	CRM UN	纽约证	美	4,500	6,533,936.99	0.62

	Inc	force .com 股 份 有 限 公 司		券 交 易 所	国			
25	Lowe's Cos Inc	Lowe's Cos Inc	LOW UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	5,980	6,262,923.96	0.60
26	Accenture PLC	埃 森 哲 公 司	ACN UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,660	6,237,991.01	0.60
27	Home Depot Inc/The	Home Depot Inc/The	HD UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,481	6,033,074.05	0.58
28	Lam Research Corp	Lam Resea rch Corp	LRCX UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,809	5,574,459.77	0.53
29	United Parcel Service Inc	Unite d Parce l Servi ce Inc	UPS UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	4,897	5,380,790.10	0.51
30	Procter & Gamble Co/The	Proct er & Gambl e Co/Th e	PG UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	5,698	5,173,069.39	0.49
31	Applied Materials Inc	应 用 材料	AMAT UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	9,052	5,097,170.97	0.49
32	Align Technology Inc	Align 科 技 股 份 有 限 公 司	ALGN UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,427	4,975,629.44	0.48
33	IDEXX Laboratories Inc	IDEXX Labor atori es	IDXX UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,492	4,866,309.83	0.46

		Inc						
34	Freeport-McMoRan Inc	Freeport-McMoRan Inc	FCX UN	纽约证券交易所	美国	26,953	4,576,023.68	0.44
35	Abbott Laboratories	雅培制药	ABT UN	纽约证券交易所	美国	6,292	4,495,075.91	0.43
36	Merck & Co Inc	Merck & Co Inc	MRK UN	纽约证券交易所	美国	8,158	4,354,224.98	0.42
37	Union Pacific Corp	Union Pacific Corp	UNP UN	纽约证券交易所	美国	3,172	4,309,525.76	0.41
38	Charter Communications Inc	查特通信公司	CHTR UW	纳斯达克证券交易所	美国	935	4,035,972.00	0.39
39	Texas Instruments Inc	Texas Instruments Inc	TXN UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,627	3,884,269.77	0.37
40	KLA Corp	KLA Corp	KLAC UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,257	3,812,889.72	0.36
41	Amgen Inc	AMGEN-T	AMGN UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,433	3,649,998.78	0.35
42	Chipotle Mexican Grill Inc	Chipotle Mexican Grill 股份	CMG UN	纽约证券交易所	美国	382	3,456,391.04	0.33
43	Darling Ingredients Inc	Darling Ingredients 公司	DAR UN	纽约证券交易所	美国	9,042	3,403,013.05	0.33
44	Eli Lilly and Co	Eli Lilly and Co	LLY UN	纽约证券交易所	美国	3,065	3,376,600.52	0.32

45	Trade Desk Inc/The	Trade Desk Inc/The	TTD UQ	纳斯达克证券交易所	美国	635	3,318,792.51	0.32
46	Cadence Design Systems Inc	Cadence Design Systems Inc 设计系统股份有限公司	CDNS UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,586	3,192,228.90	0.30
47	DocuSign Inc	DocuSign 股份有限公司	DOCU UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,133	3,093,885.08	0.30
48	Sherwin-Williams Co/The	Sherwin-Williams Co/The	SHW UN	纽约证券交易所	美国	639	3,064,141.91	0.29
49	Zoetis Inc	Zoetis Inc	ZTS UN	纽约证券交易所	美国	2,773	2,994,482.14	0.29
50	Starbucks Corp	Starbucks Corp	SBUX UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,276	2,984,792.54	0.29
51	Deere & Co	迪尔	DE UN	纽约证券交易所	美国	1,697	2,979,124.81	0.28
52	ASML Holding NV	阿斯麦控股公司	ASML UW	纳斯达克证券交易所	美国	916	2,915,008.99	0.28
53	Lululemon Athletica Inc	Lululemon Athletica Inc	LULU UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,239	2,813,596.71	0.27
54	Autodesk Inc	欧特克	ADSK UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,409	2,807,168.97	0.27
55	Roku Inc	Roku Inc	ROKU UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,219	2,640,838.31	0.25

				交易所				
56	MSCI Inc	MSCI Inc	MSCI UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	903	2,630,947.93	0.25
57	Synopsys Inc	Synopsys Inc	SNPS UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,531	2,589,709.58	0.25
58	Estee Lauder Cos Inc/The	雅 诗 兰 黛	EL UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,440	2,501,082.91	0.24
59	Lattice Semiconductor Corp	Lattice Semiconductor Corp	LSCC UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	8,331	2,490,726.72	0.24
60	PepsiCo Inc	PepsiCo Inc	PEP UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,529	2,447,168.31	0.23
61	ResMed Inc	ResMed Inc	RMD UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,732	2,402,167.51	0.23
62	Johnson & Johnson	Johnson & Johnson	JNJ UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,309	2,371,086.15	0.23
63	Zoom Video Communications Inc	Zoom Video Communications Inc	ZM UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,045	2,300,023.34	0.22
64	Okta Inc	Okta Inc	OKTA UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,350	2,239,678.45	0.21
65	Oracle Corp	Oracle Corp	ORCL UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	5,218	2,202,495.79	0.21
66	Coca-Cola Co/The	Coca-Cola Co/The	KO UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	6,043	2,162,339.59	0.21
67	West Pharmaceutical	West Pharm	WST UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,128	2,085,186.30	0.20



	Services Inc	aceutical Services Inc		所				
68	Etsy Inc	Etsy 股份有限公司	ETSY UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,793	2,081,395.01	0.20
69	MercadoLibre Inc	MercadoLibre Inc	MELI UW	纳斯达克证券交易所	美国	190	2,076,822.17	0.20
70	Artisan Partners Asset Management Inc	阿尔笛生合伙人资产管理股份有限公司	APAM UN	纽约证券交易所	美国	6,178	2,029,247.29	0.19
71	Veeva Systems Inc	Veeva Systems Inc	VEEV UN	纽约证券交易所	美国	1,127	2,002,007.34	0.19
72	Walt Disney Co/The	华特迪士尼公司	DIS UN	纽约证券交易所	美国	1,663	1,965,967.64	0.19
73	Moderna Inc	Moderna Inc	MRNA UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,876	1,960,443.53	0.19
74	ANSYS Inc	ANSYS 股份有限公司	ANSS UW	纳斯达克证券交易所	美国	825	1,958,350.86	0.19
75	Monster Beverage Corp	Monster Beverage Corp	MNST UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,132	1,889,920.06	0.18
76	Humana Inc	Humana Inc	HUM UN	纽约证券交易所	美国	700	1,873,879.51	0.18
77	Intuit Inc	Intuit	INTU UW	纳斯达克证券交易所	美国	747	1,851,427.00	0.18

		Inc		交易所				
78	Carrier Global Corp	Carrier Global Corp	CARR UN	纽约证券交易所	美国	7,248	1,783,872.16	0.17
79	Microchip Technology Inc	Microchip Technology Inc	MCHP UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,963	1,768,965.18	0.17
80	Cloudflare Inc	Cloudflare Inc	NET UN	纽约证券交易所	美国	3,558	1,764,153.00	0.17
81	Stryker Corp	Stryker Corp	SYK UN	纽约证券交易所	美国	1,098	1,755,549.92	0.17
82	Moody's Corp	Moody's Corp	MCO UN	纽约证券交易所	美国	898	1,700,620.70	0.16
83	Teradyne Inc	Teradyne Inc	TER UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,172	1,699,091.01	0.16
84	RingCentral Inc	RingCentral Inc	RNG UN	纽约证券交易所	美国	685	1,693,827.83	0.16
85	SVB Financial Group	SVB Financial Group	SIVB UW	纳斯达克证券交易所	美国	660	1,670,164.30	0.16
86	Paycom Software Inc	Paycom Software Inc	PAYC UN	纽约证券交易所	美国	560	1,652,496.17	0.16
87	Generac Holdings Inc	Generac Holdings Inc	GNRC UN	纽约证券交易所	美国	1,102	1,635,177.91	0.16
88	Qorvo Inc	Qorvo Inc	QRVO UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,480	1,605,644.78	0.15

89	Booking Holdings Inc	Booking 控股股份有限公司	BKNG UN	纳斯达克证券交易所	美国	110	1,598,598.54	0.15
90	Zebra Technologies Corp	Zebra Technologies Corp	ZBRA UN	纳斯达克证券交易所	美国	630	1,579,860.33	0.15
91	Caterpillar Inc	卡特彼勒	CAT UN	纽约证券交易所	美国	1,330	1,579,590.86	0.15
92	Charles River Laboratories International Inc	查尔斯河实验室国际有限公司	CRL UN	纽约证券交易所	美国	965	1,573,250.61	0.15
93	Trupanion Inc	Trupanion Inc	TRUP UQ	纳斯达克证券交易所	美国	2,009	1,569,221.42	0.15
94	Ingersoll Rand Inc	Ingersoll Rand Inc	IR UN	纽约证券交易所	美国	5,235	1,556,231.71	0.15
95	Twilio Inc	Twilio Inc	TWLO UN	纽约证券交易所	美国	692	1,528,405.63	0.15
96	General Electric Co	General Electric Co	GE UN	纽约证券交易所	美国	21,510	1,515,786.47	0.14
97	Pinterest Inc	Pinterest Inc	PINS UN	纽约证券交易所	美国	3,522	1,514,427.99	0.14
98	DaVita Inc	DaVita 股份有限公司	DVA UN	纽约证券交易所	美国	1,969	1,508,299.80	0.14
99	Zendesk Inc	Zendesk	ZEN UN	纽约证券交易所	美国	1,613	1,506,289.87	0.14

		Inc		所				
100	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	7,372	1,492,591.49	0.14
101	Automatic Data Processing Inc	ADP 公司	ADP UW	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	1,297	1,491,144.53	0.14
102	Spotify Technology SA	Spotify Technology SA	SPOT UN	纽 约 证 券 交易所	美国	724	1,486,462.52	0.14
103	Mettler-Toledo International Inc	Mettler-Toledo International Inc	MTD UN	纽 约 证 券 交易所	美国	199	1,479,823.31	0.14
104	Plug Power Inc	Plug Power Inc	PLUG UR	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	6,670	1,475,799.92	0.14
105	Vicor Corp	Vicor Corp	VICR UW	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	2,421	1,456,779.32	0.14
106	Albemarle Corp	雅 保 公司	ALB UN	纽 约 证 券 交易所	美国	1,464	1,409,177.96	0.13
107	Match Group Inc	Match Group Inc	MTCH UW	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	1,423	1,403,788.97	0.13
108	Zscaler Inc	Zscaler Inc	ZS UW	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	1,077	1,403,425.54	0.13
109	Entegris Inc	Entegris 股份有限公司	ENTG UW	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	2,213	1,387,645.92	0.13
110	FedEx Corp	FedEx Corp	FDX UN	纽 约 证 券 交易所	美国	810	1,372,135.58	0.13

111	Maxim Integrated Products Inc	Maxim Integrated Products Inc	MXIM UN	纳斯达克证券交易所	美国	2,371	1,371,463.18	0.13
112	Morgan Stanley	Morgan Stanley	MS UN	纽约证券交易所	美国	3,066	1,370,966.18	0.13
113	Dollar General Corp	达乐公司	DG UN	纽约证券交易所	美国	999	1,370,814.28	0.13
114	Vertex Pharmaceuticals Inc	Vertex Pharmaceuticals Inc	VRTX UN	纳斯达克证券交易所	美国	887	1,367,838.15	0.13
115	Amphenol Corp	安费诺公司	APH UN	纽约证券交易所	美国	1,601	1,366,071.14	0.13
116	Xilinx Inc	Xilinx Inc	XLNX UN	纳斯达克证券交易所	美国	1,460	1,350,551.21	0.13
117	Enphase Energy Inc	Enphase 能源公司	ENPH UN	纳斯达克证券交易所	美国	1,171	1,340,706.24	0.13
118	Rockwell Automation Inc	Rockwell Automation Inc	ROK UN	纽约证券交易所	美国	806	1,319,027.20	0.13
119	Ceridian HCM Holding Inc	Ceridian 人力资本管理控股股份	CDAY UN	纽约证券交易所	美国	1,892	1,315,495.01	0.13
120	Marsh & McLennan Cos Inc	Marsh & McLennan	MMC UN	纽约证券交易所	美国	1,677	1,280,244.10	0.12

		Cos Inc						
121	Dell Technologies Inc	Dell Techn ologi es Inc	DELL UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,659	1,271,560.18	0.12
122	Shopify Inc	Shopi fy Inc	SHOP UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	172	1,270,368.02	0.12
123	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	Taiwa n Semic onduc tor Manuf actur ing Co Ltd	TSM UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,780	1,266,425.67	0.12
124	McKesson Corp	McKes son Corp	MCK UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,111	1,260,774.59	0.12
125	PerkinElmer Inc	Perki nElme r Inc	PKI UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,294	1,211,602.16	0.12
126	CrowdStrike Holdings Inc	Crowd Strik e 控股 股 份 有 限 公 司	CRWD UN	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	873	1,206,577.07	0.12
127	Palantir Technologies Inc	Palan tir Techn ologi es Inc	PLTR UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	7,711	1,184,883.02	0.11
128	Avantor Inc	Avant or 股 份 有 限 公 司	AVTR UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	6,339	1,164,321.75	0.11
129	Sysco Corp	Sysco	SYN UN	纽 约 证	美	2,397	1,161,440.16	0.11

		Corp		券 交 易 所	国			
130	Take-Two Interactive Software Inc	Take-Two Interactive Software Inc	TTWO UN	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	841	1,140,235.34	0.11
131	Peloton Interactive Inc	Peloton Interactive Inc	PTON UN	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,128	1,116,672.43	0.11
132	PennyMac Financial Services Inc	PennyMac Financial Services Inc	PFSI UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,582	1,105,519.29	0.11
133	TopBuild Corp	TopBuild 公司	BLD UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	918	1,102,613.10	0.11
134	Ameriprise Financial Inc	阿 默 普 莱 斯 融 金 公 司	AMP UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	845	1,071,446.33	0.10
135	Inphi Corp	Inphi Corp	IPHI UN	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,015	1,062,822.69	0.10
136	Molina Healthcare Inc	Molina Healthcare Inc	MOH UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	760	1,054,663.96	0.10
137	Uber Technologies Inc	Uber Technologies Inc	UBER UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,141	1,045,230.26	0.10
138	Lennar Corp	Lennar Corp	LEN UN	纽 约 证	美	2,097	1,043,033.39	0.10

		r Corp		券 交 易 所	国			
139	EPAM Systems Inc	EPAM 系 统 公司	EPAM UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	437	1,021,792.49	0.10
140	Cintas Corp	CINTAS 公 司	CTAS UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	439	1,012,461.82	0.10
141	United Rentals Inc	United Rentals Inc	URI UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	653	988,112.78	0.09
142	Fortune Brands Home & Security Inc	Fortune Brands Home & Security Inc	FBHS UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,748	977,681.62	0.09
143	Floor & Decor Holdings Inc	Floor & Decor Holdings Inc	FND UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,609	974,791.68	0.09
144	MKS Instruments Inc	MKS Instruments Inc	MKSI UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	985	966,946.14	0.09
145	RPM International Inc	RPM International Inc	RPM UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,629	964,906.26	0.09
146	PulteGroup Inc	Pulte Group Inc	PHM UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,394	954,914.42	0.09
147	JPMorgan Chase & Co	JPMorgan Chase & Co	JPM UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,134	940,220.99	0.09



148	Trex Co Inc	Trex Co Inc	TREX UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,720	939,575.16	0.09
149	Howmet Aerospace Inc	Howmet Aerospace Inc	HWM UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	4,980	927,378.82	0.09
150	Micron Technology Inc	Micron Technology Inc	MU UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,878	921,237.84	0.09
151	Jack in the Box Inc	Jack in the Box Inc	JACK UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,496	905,844.04	0.09
152	Five9 Inc	Five9 Inc	FIVN UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	791	900,112.56	0.09
153	Inspire Medical Systems Inc	Inspire Medical Systems Inc	INSP UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	733	899,587.77	0.09
154	HubSpot Inc	HubSpot Inc	HUBS UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	347	897,595.78	0.09
155	Advanced Drainage Systems Inc	Advanced Drainage Systems Inc	WMS UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,641	894,921.22	0.09
156	Fair Isaac Corp	Fair Isaac Corp	FICO UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	261	870,300.56	0.08
157	RH	RH	RH UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	285	832,206.63	0.08
158	CoStar Group	CoStar	CSGP	纳 斯 达 克	美	137	826,224.34	0.08

	Inc	r 集团 股 份 有 限 公 司	UW	克 证 券 交 易 所	国			
159	PPG Industries Inc	PPG Industries Inc	PPG UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	862	811,160.17	0.08
160	StoneCo Ltd	StoneCo Ltd	STNE UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,481	810,950.59	0.08
161	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	RARE UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	888	802,078.81	0.08
162	L Brands Inc	L Brands Inc	LB UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,277	795,200.20	0.08
163	NXP Semiconductors NV	NXP Semiconductors NV	NXPI UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	766	794,743.65	0.08
164	Regeneron Pharmaceuticals Inc	Regeneron Pharmaceuticals Inc	REGN UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	247	778,604.38	0.07
165	Discover Financial Services	Discover 金融服 务 公 司	DFS UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,308	772,634.55	0.07
166	Teleflex Inc	Teleflex Inc	TFX UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	286	768,039.58	0.07
167	Nevro Corp	Nevro Corp	NVRO UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	680	768,032.93	0.07
168	Twitter Inc	Twitter	TWTR UN	纽 约 证 券 交 易	美国	2,166	765,298.34	0.07

		Inc		所				
169	Stanley Black & Decker Inc	Stanley Black & Decker Inc	SWK UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	651	758,471.08	0.07
170	Capital One Financial Corp	第一资本金融	COF UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,173	756,569.01	0.07
171	Paylocity Holding Corp	Paylocity Holding Corp	PCTY UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	560	752,383.61	0.07
172	Lithia Motors Inc	Lithia Motors Inc	LAD UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	389	742,850.93	0.07
173	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	MTSI UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,063	740,886.21	0.07
174	Bristol-Myers Squibb Co	百 时 美 施 贵 宝 公司	BMJ UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,826	739,054.41	0.07
175	Novanta Inc	Novanta Inc	NOVT UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	958	738,975.98	0.07
176	Teladoc Health Inc	Teladoc Health Inc	TDOC UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	560	730,642.64	0.07
177	Paychex Inc	Paychex Inc	PAYX UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,200	729,588.22	0.07
178	Mohawk	Mohawk	MHK UN	纽 约 证	美	793	729,309.93	0.07

	Industries Inc	k Industries Inc		券交易所	国			
179	T-Mobile US Inc	T-Mobile US Inc	TMUS UW	纳斯达克证券交易所	美国	827	727,663.05	0.07
180	Cognex Corp	康耐视公司	CGNX UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,386	726,058.31	0.07
181	Old Dominion Freight Line Inc	Old Dominion Freight Line Inc	ODFL UW	纳斯达克证券交易所	美国	564	718,270.91	0.07
182	Illinois Tool Works Inc	Illinois Tool Works Inc	ITW UN	纽约证券交易所	美国	539	717,029.87	0.07
183	Trane Technologies PLC	Trane Technologies PLC	TT UN	纽约证券交易所	美国	756	716,048.79	0.07
184	Ross Stores Inc	Ross Stores Inc	ROST UW	纳斯达克证券交易所	美国	893	715,581.41	0.07
185	Tyler Technologies Inc	Tyler Technologies Inc	TYL UN	纽约证券交易所	美国	249	709,214.09	0.07
186	HCA Healthcare Inc	HCA Healthcare Inc	HCA UN	纽约证券交易所	美国	659	707,163.05	0.07
187	Altice USA Inc	美国 Altice 公司	ATUS UN	纽约证券交易所	美国	2,850	704,229.19	0.07
188	Lockheed Martin	Lockh	LMT UN	纽约证	美	304	704,127.54	0.07

	Corp	eed Marti n Corp		券 交 易 所	国			
189	T Rowe Price Group Inc	T Rowe Price Group Inc	TROW UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	707	698,377.86	0.07
190	Crocs Inc	卡 骆 弛 股 份 有 限 公 司	CROX UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,673	684,006.44	0.07
191	Equifax Inc	Equifax 公司	EFX UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	543	683,236.11	0.07
192	MongoDB Inc	MongoDB Inc	MDB UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	289	677,040.33	0.06
193	IAC/InterActiveCorp	IAC/InterActive Corp	IAC UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	546	674,577.44	0.06
194	Morningstar Inc	Morningstar Inc	MORN UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	442	667,849.22	0.06
195	Goldman Sachs Group Inc/The	Goldman Sachs Group Inc/The	GS UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	385	662,462.33	0.06
196	Encompass Health Corp	南 方 保 健 公 司	EHC UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,217	656,625.02	0.06
197	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	1,078	653,092.25	0.06
198	Medtronic PLC	Medtronic PLC	MDT UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	850	649,677.77	0.06

199	Tapestry Inc	Tapestry Inc	TPR UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,178	644,478.99	0.06
200	Cheniere Energy Inc	Cheniere Energy Inc	LNG UA	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,643	643,546.25	0.06
201	Anthem Inc	Anthem 股份有限公司	ANTM UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	303	634,809.28	0.06
202	Change Healthcare Inc	Change Healthcare Inc	CHNG UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	5,175	629,742.57	0.06
203	Monolithic Power Systems Inc	Monolithic Power Systems Inc	MPWR UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	263	628,468.52	0.06
204	Seagen Inc	Seagen Inc	SGEN UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	542	619,381.87	0.06
205	Masimo Corp	Masimo Corp	MASI UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	353	618,156.89	0.06
206	Celanese Corp	塞 拉 尼 斯 公司	CE UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	724	613,840.15	0.06
207	Honeywell International Inc	Honeywell International Inc	HON UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	442	613,428.03	0.06
208	Builders FirstSource Inc	Builders FirstSource 股份有限	BLDR UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,303	613,245.53	0.06
209	CommScope	康 普	COMM	纳 斯 达 克	美	6,968	609,237.74	0.06

	Holding Co Inc	控股 股份 有限 公司	UW	克 证 券 交 易 所	国			
210	Cognizant Technology Solutions Corp	高 知 特 科 技 公 司	CTSH UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,136	607,436.87	0.06
211	Danaher Corp	丹 纳 赫	DHR UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	418	605,866.46	0.06
212	Intercontinental Exchange Inc	Inter conti nenta l Excha nge Inc	ICE UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	798	600,300.07	0.06
213	Crown Holdings Inc	Crown 控 股 股 份 有 限 公 司	CCK UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	917	599,530.00	0.06
214	TJX Cos Inc/The	TJX Cos Inc/The	TJX UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,341	597,530.05	0.06
215	Chewy Inc	Chewy 股 份 有 限 公 司	CHWY UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,014	594,734.59	0.06
216	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	268	592,642.83	0.06
217	Agilent Technologies Inc	安 捷 伦	A UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	762	589,129.18	0.06
218	HP Inc	HP Inc	HPQ UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	3,671	589,002.01	0.06
219	Walmart Inc	Walma rt Inc	WMT UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	626	588,793.27	0.06

220	Cooper Cos Inc/The	库柏 股份 有限 公司	COO UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	248	587,915.41	0.06
221	Clorox Co/The	高乐 氏公 司	CLX UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	441	581,020.94	0.06
222	BlackRock Inc	贝莱 德有 限公 司	BLK UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	123	579,081.09	0.06
223	S&P Global Inc	S&P Globa l Inc	SPGI UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	259	555,536.97	0.05
224	Proto Labs Inc	Proto Labs Inc	PRLB UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	554	554,509.49	0.05
225	IHS Markit Ltd	IHS Marki t Ltd	INFO UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	946	554,480.65	0.05
226	Blackline Inc	Black Line 股 份 有 限 公 司	BL UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	631	549,153.72	0.05
227	Comcast Corp	康卡 斯特	CMCSA UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,599	546,705.71	0.05
228	ON Semiconductor Corp	ON Semic onduc tor Corp	ON UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,529	540,093.18	0.05
229	Wayfair Inc	Wayfa ir Inc	W UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	365	537,786.50	0.05
230	AutoNation Inc	AutoN ation 公司	AN UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,165	530,509.28	0.05
231	Freshpet Inc	Fresh pet Inc	FRPT UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	570	528,088.21	0.05



232	Virtu Financial Inc	Virtu Financial Inc	VIRT UW	纳斯达克证券交易所	美国	3,204	526,198.47	0.05
233	Hologic Inc	Hologic Inc	HOLX UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,095	520,353.27	0.05
234	Dick's Sporting Goods Inc	迪克体育用品有限公司	DKS UN	纽约证券交易所	美国	1,406	515,671.07	0.05
235	SiteOne Landscape Supply Inc	SiteOne Landscape Supply Inc	SITE UN	纽约证券交易所	美国	498	515,452.35	0.05
236	Scotts Miracle-Gro Co/The	Scotts Miracle-Gro Co/The	SMG UN	纽约证券交易所	美国	390	506,753.75	0.05
237	Bank of America Corp	美国银行控股公司	BAC UN	纽约证券交易所	美国	2,559	506,092.71	0.05
238	Five Below Inc	Five Below Inc	FIVE UW	纳斯达克证券交易所	美国	443	505,785.06	0.05
239	Berkshire Hathaway Inc	伯克希尔哈撒韦公司	BRK/B UN	纽约证券交易所	美国	330	499,266.43	0.05
240	Altra Industrial Motion Corp	Altra Industrial Motion 公司	AIMC UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,374	496,941.73	0.05
241	Universal Display Corp	Universal	OLED UW	纳斯达克证券交易所	美国	321	481,314.47	0.05

		Display Corp		交易所				
242	DexCom Inc	DexCom 股份有限公司	DXCM UW	纳斯达克证券交易所	美国	199	480,064.82	0.05
243	Repligen Corp	Repligen Corp	RGEN UW	纳斯达克证券交易所	美国	380	475,139.30	0.05
244	Fortinet Inc	Fortinet Inc	FTNT UW	纳斯达克证券交易所	美国	490	474,880.26	0.05
245	Toro Co/The	Toro Co/The	TTC UN	纽约证券交易所	美国	767	474,636.10	0.05
246	Renewable Energy Group Inc	Renewable Energy Group Inc	REGI UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,018	470,411.10	0.04
247	Invitae Corp	Invitae Corp	NVTA UN	纽约证券交易所	美国	1,722	469,772.05	0.04
248	Deckers Outdoor Corp	德克斯户外用品公司	DECK UN	纽约证券交易所	美国	250	467,802.71	0.04
249	Halozyne Therapeutics Inc	Halozyne Therapeutics Inc	HALO UW	纳斯达克证券交易所	美国	1,677	467,343.81	0.04
250	Expeditors International of Washington Inc	华盛顿快捷国际物流公司	EXPD UW	纳斯达克证券交易所	美国	753	467,299.18	0.04
251	Zillow Group Inc	Zillow Group	Z UW	纳斯达克证券交易所	美国	539	456,496.36	0.04

		Inc						
252	Nucor Corp	Nucor Corp	NUE UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,289	447,359.61	0.04
253	Ally Financial Inc	Ally 金 融 公 司	ALLY UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,908	443,949.50	0.04
254	Quanta Services Inc	Quant a Servi ces Inc	PWR UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	935	439,378.28	0.04
255	Amcor PLC	Amcor PLC	AMCR UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	5,673	435,675.47	0.04
256	US Foods Holding Corp	US Foods Holdi ng Corp	USFD UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,981	430,559.29	0.04
257	Brink's Co/The	Brink 's 公 司	BCO UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	874	410,598.91	0.04
258	IQVIA Holdings Inc	IQVIA Holdi ngs Inc	IQV UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	350	409,173.22	0.04
259	Digital Turbine Inc	Digit al Turbi ne 股 份 有 限 公 司	APPS UR	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,100	405,953.18	0.04
260	Jabil Inc	Jabil Inc	JBL UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,439	399,328.25	0.04
261	Skyworks Solutions Inc	Skywo rks Solut ions Inc	SWKS UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	395	394,023.05	0.04
262	Avalara Inc	Avala ra Inc	AVLR UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	360	387,320.67	0.04

263	Brightsphere Investment Group Inc	Brightsphere 投资集团有限公司	BSIG UN	纽约证券交易所	美国	3,062	385,199.82	0.04
264	Chemed Corp	Chemed 公司	CHE UN	纽约证券交易所	美国	110	382,274.97	0.04
265	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	299	380,024.60	0.04
266	Catalent Inc	康泰伦特股份有限公司	CTLT UN	纽约证券交易所	美国	558	378,907.86	0.04
267	Kansas City Southern	Kansas City Southern	KSU UN	纽约证券交易所	美国	282	375,603.65	0.04
268	KKR & Co Inc	KKR & Co Inc	KKR UN	纽约证券交易所	美国	1,406	371,455.64	0.04
269	IAA Inc	IAA Inc	IAA UN	纽约证券交易所	美国	872	369,717.54	0.04
270	American Eagle Outfitters Inc	美国鹰牌服饰公司	AEO UN	纽约证券交易所	美国	2,774	363,268.46	0.03
271	Lincoln Electric Holdings Inc	Lincoln Electric Holdings Inc	LECO UW	纳斯达克证券交易所	美国	478	362,572.38	0.03
272	Check Point Software	Check Point	CHKP UW	纳斯达克证券交易所	美国	416	360,765.37	0.03

	Technologies Ltd	软 件 技 术 有 限 公 司		交易所				
273	Colgate-Palmolive Co	高 露 洁 棕 榄	CL UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	643	358,758.12	0.03
274	Callaway Golf Co	卡 拉 威 高 尔 夫 公 司	ELY UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,273	356,094.66	0.03
275	Waters Corp	Water s Corp	WAT UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	219	353,551.58	0.03
276	Edwards Lifesciences Corp	爱 德 华 生 命 科 学 公 司	EW UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	587	349,421.51	0.03
277	Emerson Electric Co	艾 默 生 电 气	EMR UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	661	346,632.51	0.03
278	NetApp Inc	NetApp Inc	NTAP UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	801	346,199.71	0.03
279	Johnson Controls International plc	Johns on Contr ols Inter natio nal plc	JCI UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,136	345,338.42	0.03
280	Cerence Inc	Cerence Inc	CRNC UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	526	344,857.15	0.03
281	Vertiv Holdings Co	Verti v Holdi ngs Co	VRT UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,812	342,557.51	0.03
282	Tetra Tech Inc	Tetra Tech Inc	TTEK UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	452	341,464.72	0.03
283	Manhattan	Manha	MANH	纳 斯 达 克	美	495	339,713.05	0.03

	Associates Inc	ttan Assoc iates Inc	UW	克 证 券 交 易 所	国			
284	Boeing Co/The	波音	BA UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	243	339,402.98	0.03
285	Dolby Laboratories Inc	杜 比 实 验 室 有 限 公 司	DLB UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	534	338,429.73	0.03
286	QIAGEN NV	QIAGE N NV	QGEN UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	976	336,564.78	0.03
287	American Express Co	美 国 运 通	AXP UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	417	328,982.00	0.03
288	Cigna Corp	信 诺 集 团	CI UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	241	327,363.24	0.03
289	Arthur Gallagher & Co J	亚 瑟 加 拉 格 尔 有 限 公 司	AJG UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	403	325,299.74	0.03
290	Primerica Inc	Prime rica Inc	PRI UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	370	323,335.55	0.03
291	3M Co	3M Co	MMM UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	281	320,476.92	0.03
292	DR Horton Inc	霍 顿 房 屋 公 司	DHI UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	712	320,183.63	0.03
293	Copart Inc	Copar t 股 份 有 限 公 司	CPRT UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	385	319,663.01	0.03
294	CoreLogic Inc/United States	美 国 科 捷 公 司	CLGX UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	623	314,306.78	0.03

295	Kohl's Corp	Kohl's Corp	KSS UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,178	312,756.86	0.03
296	Carvana Co	Carvana 公司	CVNA UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	200	312,594.91	0.03
297	SYNNEX Corp	SYNNEX Corp	SNX UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	584	310,330.51	0.03
298	MarketAxess Holdings Inc	MarketAxess Holdings Inc	MKTX UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	81	301,550.60	0.03
299	Pfizer Inc	Pfizer Inc	PFE UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,255	301,427.87	0.03
300	MDC Holdings Inc	MDC Holdings Inc	MDC UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	944	299,351.97	0.03
301	Target Corp	Target Corp	TGT UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	259	298,326.71	0.03
302	Rollins Inc	Rollins Inc	ROL UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,170	298,265.58	0.03
303	Live Nation Entertainment Inc	Live Nation Entertainment Inc	LYV UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	614	294,382.09	0.03
304	NVR Inc	NVR Inc	NVR UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	11	292,827.46	0.03
305	Quest Diagnostics Inc	Quest Diagnostics 股份有限公司	DGX UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	368	286,146.62	0.03
306	Norfolk	Norfolk	NSC UN	纽 约 证	美	184	285,270.19	0.03

	Southern Corp	lk South ern Corp		券 交 易 所	国			
307	Caesars Entertainment Inc	凯 撒 娱 乐 集 团	CZR UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	585	283,493.53	0.03
308	News Corp	News Corp	NWS UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,420	280,592.88	0.03
309	Raytheon Technologies Corp	Rayth eon Techn ologi es Corp	RTX UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	600	279,957.36	0.03
310	Covetrus Inc	Covet rus Inc	CVET UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,487	278,850.61	0.03
311	XPO Logistics Inc	XPO Logis tics Inc	XPO UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	357	277,663.20	0.03
312	Alexion Pharmaceuticals Inc	亚 力 兄 制 药 公 司	ALXN UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	270	275,251.60	0.03
313	Palo Alto Networks Inc	Palo Alto Netwo rks Inc	PANW UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	118	273,628.34	0.03
314	SLM Corp	SLM Corp	SLM UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	3,361	271,715.04	0.03
315	Packaging Corp of America	Packa ging Corp of Ameri ca	PKG UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	300	269,954.69	0.03
316	IPG Photonics Corp	IPG Photo nics Corp	IPGP UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	184	268,678.16	0.03



317	Mattel Inc	Matte l Inc	MAT UN	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,335	265,861.94	0.03
318	Keysight Technologies Inc	Keysi ght Techn ologi es Inc	KEYS UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	305	262,871.58	0.03
319	Parker-Hannifin Corp	Parke r-Han nifin Corp	PH UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	147	261,284.86	0.02
320	Natera Inc	Natera Inc	NTRA UN	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	394	255,847.07	0.02
321	PACCAR Inc	PACCA R Inc	PCAR UN	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	449	252,772.80	0.02
322	LPL Financial Holdings Inc	LPL Finan cial Holdi ngs Inc	LPLA UN	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	371	252,289.30	0.02
323	Eastman Chemical Co	伊 士 曼 化 工	EMN UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	384	251,257.72	0.02
324	Cirrus Logic Inc	Cirru s Logic 股 份 有 限 公 司	CRUS UN	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	468	251,010.29	0.02
325	Ball Corp	波尔	BLL UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	406	246,844.01	0.02
326	SS&C Technologies Holdings Inc	SS&C Techn ologi es Holdi ngs Inc	SSNC UN	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	520	246,836.97	0.02
327	Rexnord Corp	Rexno	RXN UN	纽 约 证	美	937	241,435.20	0.02

		rd Corp		券交易所	国			
328	Envista Holdings Corp	Envis ta Holdi ngs Corp	NVST UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,096	241,213.03	0.02
329	Newell Brands Inc	Newel l Brand s Inc	NWL UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,735	240,338.49	0.02
330	Unum Group	Unum Group	UNM UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,602	239,789.29	0.02
331	Q2 Holdings Inc	Q2 Holdi ngs Inc	QTWO UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	290	239,422.72	0.02
332	Martin Marietta Materials Inc	Marti n Marie tta Mater ials Inc	MLM UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	129	239,020.99	0.02
333	Tempur Sealy International Inc	Tempu r Sealy Inter natio nal Inc	TPX UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,356	238,889.64	0.02
334	KB Home	KB Home	KBH UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,087	237,742.82	0.02
335	Lincoln National Corp	Lincol n Natio nal Corp	LNC UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	722	237,009.29	0.02
336	Macy's Inc	Macy' s Inc	M UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,226	236,804.93	0.02
337	Under Armour	Under	UA UN	纽 约 证	美	2,425	235,444.49	0.02

	Inc	Armou r Inc		券 交 易 所	国			
338	Nexstar Media Group Inc	Nexst ar Media Group Inc	NXST UN	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	329	234,397.31	0.02
339	VICI Properties Inc	VICI Prope rties Inc	VICI UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,399	232,772.55	0.02
340	Erie Indemnity Co	伊 利 赔 偿 公 司	ERIE UN	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	145	232,364.74	0.02
341	Charles Schwab Corp/The	Charl es Schwa b Corp/ The	SCHW UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	671	232,220.15	0.02
342	Aptiv PLC	Aptiv 公 共 有 限 公 司	APTV UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	272	231,235.15	0.02
343	Cardinal Health Inc	康 德 乐 公 司	CAH UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	659	230,303.13	0.02
344	TransDigm Group Inc	Trans Digm Group Inc	TDG UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	57	230,162.26	0.02
345	Las Vegas Sands Corp	Las Vegas Sands Corp	LVS UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	591	229,830.47	0.02
346	Ulta Beauty Inc	Ulta Beaut y Inc	ULTA UN	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	122	228,590.21	0.02
347	Applied Industrial Technologies Inc	应 用 工 业 技 术 公 司	AIT UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	449	228,485.75	0.02
348	Sabra Health	Sabra	SBRA	纳 斯 达	美	2,015	228,375.09	0.02

	Care REIT Inc	医 疗 保 健 房 地 产 投 资 信 托	UW	克 证 券 交 易 所	国			
349	CIT Group Inc	CIT 集 团 公 司	CIT UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	971	227,450.84	0.02
350	Berry Global Group Inc	Berry 全 球 集 团 股 份 有 限 公 司	BERY UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	614	225,113.36	0.02
351	Williams-Sonoma Inc	Willi ams-S onoma Inc	WSM UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	337	223,935.09	0.02
352	La-Z-Boy Inc	La-Z- Boy Inc	LZB UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	856	222,518.93	0.02
353	BMC Stock Holdings Inc	BMC Stock 控 股 有 限 公 司	BMCH UN	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	634	222,062.70	0.02
354	WW Grainger Inc	WW Grain ger Inc	GWG UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	83	221,143.35	0.02
355	US Bancorp	US Banco rp	USB UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	727	221,004.43	0.02
356	FMC Corp	FMC Corp	FMC UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	293	219,722.68	0.02
357	Simon Property Group Inc	西 蒙 房 地 产 集 团 公 司	SPG UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	394	219,238.73	0.02
358	W R Grace & Co	W R Grace & Co	GRA UN	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	606	216,763.18	0.02

359	Synchrony Financial	Synchrony Financial	SYF UN	纽约证券交易所	美国	951	215,381.79	0.02
360	Westrock Co	Westrock Co	WRK UN	纽约证券交易所	美国	758	215,293.90	0.02
361	Altair Engineering Inc	Altair Engineering Inc	ALTR UW	纳斯达克证券交易所	美国	565	214,484.56	0.02
362	Essent Group Ltd	Essent 集团有限公司	ESNT UN	纽约证券交易所	美国	760	214,225.52	0.02
363	Saia Inc	Saia Inc	SAIA UW	纳斯达克证券交易所	美国	181	213,526.05	0.02
364	Waste Management Inc	Waste Management Inc	WM UN	纽约证券交易所	美国	271	208,529.47	0.02
365	Axis Capital Holdings Ltd	阿克斯资本控股有限公司	AXS UN	纽约证券交易所	美国	626	205,822.36	0.02
366	McCormick & Co Inc/MD	McCormick & Co Inc/MD	MKC UN	纽约证券交易所	美国	325	202,728.64	0.02
367	Helen of Troy Ltd	Helen of Troy Ltd	HELE UW	纳斯达克证券交易所	美国	138	200,067.92	0.02
368	Medpace Holdings Inc	Medpace Holdings Inc	MEDP UW	纳斯达克证券交易所	美国	220	199,818.54	0.02
369	Linde PLC	Linde	LIN UN	纽约证	美	113	194,289.53	0.02

		PLC		券 交 易 所	国			
370	Sage Therapeutics Inc	Sage Therapeutics Inc	SAGE UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	340	191,919.49	0.02
371	Aon PLC	Aon PLC	AON UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	138	190,235.16	0.02
372	Laboratory Corp of America Holdings	Laboratory Corp of America Holdings	LH UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	143	189,924.51	0.02
373	LHC Group Inc	LHC Group Inc	LHCG UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	136	189,297.27	0.02
374	Amedisys Inc	Amedisys 股份有限公司	AMED UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	98	187,566.99	0.02
375	Kinsale Capital Group Inc	Kinsale Capital Group Inc	KNSL UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	138	180,204.30	0.02
376	Synaptics Inc	Synaptics Inc	SYNA UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	284	178,636.10	0.02
377	SolarEdge Technologies Inc	SolarEdge Technologies Inc	SEDG UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	84	174,906.99	0.02
378	Brown & Brown Inc	Brown & Brown 股份	BRO UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	547	169,211.99	0.02

		有限公司						
379	Ovintiv Inc	Ovintiv Inc	OVV UN	纽约证券交易所	美国	1,716	160,785.02	0.02
380	OneMain Holdings Inc	OneMain Holdings Inc	OMF UN	纽约证券交易所	美国	511	160,576.22	0.02
381	Cable One Inc	Cable One 股份有限公司	CABO UN	纽约证券交易所	美国	11	159,892.15	0.02
382	Dover Corp	多佛	DOV UN	纽约证券交易所	美国	188	154,868.50	0.01
383	Republic Services Inc	Republic Services Inc	RSG UN	纽约证券交易所	美国	242	152,060.18	0.01
384	Alphabet Inc	Alphabet Inc	GOOG UW	纳斯达克证券交易所	美国	13	148,600.94	0.01
385	PTC Inc	PTC Inc	PTC UW	纳斯达克证券交易所	美国	185	144,382.01	0.01
386	Comfort Systems USA Inc	Comfort Systems USA Inc	FIX UN	纽约证券交易所	美国	417	143,281.71	0.01
387	Adaptive Biotechnologies Corp	Adaptive Biotechnologies Corp	ADPT UW	纳斯达克证券交易所	美国	370	142,752.41	0.01
388	Datadog Inc	Datadog Inc	DDOG UW	纳斯达克证券交易所	美国	222	142,593.08	0.01
389	Simpson	Simps	SSD UN	纽约证	美	232	141,462.44	0.01

	Manufacturing Co Inc	on Manuf actur ing Co Inc		券 交 易 所	国			
390	Corning Inc	Corni ng Inc	GLW UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	597	140,233.15	0.01
391	Tractor Supply Co	Tract or Suppl y Co	TSCO UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	148	135,756.03	0.01
392	Brown-Forman Corp	百 富 门 公 司	BF/B UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	258	133,714.38	0.01
393	Systemax Inc	Syste max Inc	SYX UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	570	133,481.84	0.01
394	Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital Inc	Hanno n Armst rong Susta inabl e Infra struc ture Capit al Inc	HASI UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	317	131,198.19	0.01
395	Safehold Inc	Safeh old Inc	SAFE UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	276	130,545.24	0.01
396	Athene Holding Ltd	Athen e 控 股 有 限 公 司	ATH UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	463	130,327.18	0.01
397	Alcoa Corp	美 国 铝 业 公 司	AA UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	849	127,688.70	0.01
398	Ameresco Inc	Amere sco 公 司	AMRC UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	374	127,481.93	0.01



399	Cleveland-Cliffs Inc	Cleveland-Cliffs 股份有限公司	CLF UN	纽约证券交易所	美国	1,332	126,543.39	0.01
400	Capri Holdings Ltd	Capri 控股有限公司	CPRI UN	纽约证券交易所	美国	460	126,061.07	0.01
401	Gartner Inc	Gartner Inc	IT UN	纽约证券交易所	美国	120	125,426.85	0.01
402	Signature Bank/New York NY	Signature Bank/New York NY	SBNY UW	纳斯达克证券交易所	美国	140	123,585.52	0.01
403	WEX Inc	WEX Inc	WEX UN	纽约证券交易所	美国	93	123,505.20	0.01
404	Arista Networks Inc	Arista 网络股份有限公司	ANET UN	纽约证券交易所	美国	65	123,236.11	0.01
405	Avnet Inc	安富利股份有限公司	AVT UW	纳斯达克证券交易所	美国	536	122,791.83	0.01
406	Arch Capital Group Ltd	阿契资本集团	ACGL UW	纳斯达克证券交易所	美国	521	122,618.99	0.01
407	Avery Dennison Corp	艾利丹尼森	AVY UN	纽约证券交易所	美国	121	122,461.35	0.01
408	Omniceil Inc	Omniceil Inc	OMCL UW	纳斯达克证券交易所	美国	156	122,166.49	0.01
409	Nordstrom Inc	Nordstrom Inc	JWN UN	纽约证券交易所	美国	594	120,963.42	0.01
410	First Solar	First	FSLR	纳斯达克	美	187	120,697.86	0.01

	Inc	Solar Inc	UW	克 证 券 交 易 所	国			
411	Magna International Inc	Magna International Inc	MGA UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	260	120,110.36	0.01
412	Penn National Gaming Inc	Penn National Gaming Inc	PENN UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	213	120,037.35	0.01
413	Performance Food Group Co	Performance Food Group Co	PFGC UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	386	119,911.09	0.01
414	Carlyle Group Inc/The	凯 雷 投 资 集 团	CG UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	583	119,598.29	0.01
415	Western Union Co/The	Weste rn Union Co/The	WU UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	829	118,676.58	0.01
416	NRG Energy Inc	NRG Energy Inc	NRG UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	484	118,584.84	0.01
417	Expedia Group Inc	亿 客 行 集 团 股 份 有 限 公 司	EXPE UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	137	118,353.86	0.01
418	AECOM	AECOM 公司	ACM UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	363	117,905.86	0.01
419	Upwork Inc	Upwor k Inc	UPWK UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	519	116,899.33	0.01
420	Citigroup Inc	花 旗 集 团	C UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	289	116,272.02	0.01

				所				
421	Sabre Corp	Sabre Corp	SABR UW	纳斯达克 证券交易所	美国	1,476	115,761.64	0.01
422	Discovery Inc	探索 通信 公司	DISCK UW	纳斯达克 证券交易所	美国	676	115,519.70	0.01
423	II-VI Inc	II-VI Inc	IIVI UW	纳斯达克 证券交易所	美国	232	114,986.49	0.01
424	Diamondback Energy Inc	Diamondback Energy Inc	FANG UW	纳斯达克 证券交易所	美国	364	114,953.08	0.01
425	Alaska Air Group Inc	阿拉斯加 航空集团 公司	ALK UN	纽约证 券交易 所	美国	338	114,681.64	0.01
426	Southwest Airlines Co	Southwest Airlines Co	LUV UN	纽约证 券交易 所	美国	376	114,351.22	0.01
427	TriNet Group Inc	TriNet Group Inc	TNET UN	纽约证 券交易 所	美国	216	113,595.90	0.01
428	Mirati Therapeutics Inc	Mirati Therapeutics Inc	MRTX UW	纳斯达克 证券交易所	美国	79	113,217.19	0.01
429	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	LSXMK UW	纳斯达克 证券交易所	美国	394	111,855.97	0.01
430	Sirius XM	Sirius	SIRI	纳斯达克	美	2,680	111,390.48	0.01

	Holdings Inc	s XM Holdings Inc	UW	克 证 券 交 易 所	国			
431	Mosaic Co/The	Mosaic Co/The	MOS UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	734	110,201.25	0.01
432	Seabridge Gold Inc	Seabridge Gold Inc	SA UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	801	110,121.19	0.01
433	Phillips 66	Phillips 66	PSX UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	241	109,980.71	0.01
434	Bank of New York Mellon Corp/The	纽 约 梅 隆 银 行 股 份 有 限 公 司	BK UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	396	109,659.04	0.01
435	Ubiquiti Inc	Ubiquiti Inc	UI UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	60	109,034.99	0.01
436	Illumina Inc	Illumina Inc	ILMN UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	45	108,639.59	0.01
437	Chevron Corp	雪 佛 龙	CVX UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	196	108,001.45	0.01
438	Landstar System Inc	Landstar System Inc	LSTR UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	122	107,194.45	0.01
439	Workday Inc	Workday Inc	WDAY UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	68	106,313.33	0.01
440	Mercury Systems Inc	Mercury Systems Inc	MRCY UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	185	106,297.80	0.01
441	Hess Corp	Hess Corp	HES UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	307	105,745.99	0.01

				所				
442	Exxon Mobil Corp	Exxon Mobil Corp	XOM UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	392	105,430.90	0.01
443	VF Corp	VF Corp	VFC UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	189	105,328.13	0.01
444	Chegg Inc	Chegg 股 份 有 限 公 司	CHGG UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	178	104,912.17	0.01
445	Adient PLC	安 道 拓	ADNT UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	461	104,587.43	0.01
446	Hilton Worldwide Holdings Inc	Hilton Worldwide Holdings Inc	HLT UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	144	104,538.29	0.01
447	Teradata Corp	Teradata Corp	TDC UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	713	104,536.14	0.01
448	United Airlines Holdings Inc	United Airlines Holdings Inc	UAL UN	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	369	104,156.59	0.01
449	Medallia Inc	Medallia Inc	MDLA UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	479	103,826.69	0.01
450	Marathon Oil Corp	Marathon Oil Corp	MRO UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,373	103,275.53	0.01
451	Snowflake Inc	Snowflake Inc	SNOW UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	56	102,821.98	0.01
452	Fate Therapeutics Inc	Fate Therapeutics	FATE UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	173	102,642.48	0.01

		Inc						
453	Oak Street Health Inc	Oak Street Health Inc	OSH UN	纽约证券交易所	美国	257	102,559.16	0.01
454	Huntsman Corp	Huntsman Corp	HUN UN	纽约证券交易所	美国	621	101,866.35	0.01
455	Patterson Cos Inc	Patterson Cos Inc	PDCO UN	纳斯达克证券交易所	美国	523	101,113.05	0.01
456	Nutanix Inc	Nutanix Inc	NTNX UN	纳斯达克证券交易所	美国	486	101,063.00	0.01
457	GoDaddy Inc	GoDaddy Inc	GDDY UN	纽约证券交易所	美国	182	98,505.76	0.01
458	Extra Space Storage Inc	额外空间仓储公司	EXR UN	纽约证券交易所	美国	127	96,008.81	0.01
459	Vulcan Materials Co	Vulcan Materials Co	VMC UN	纽约证券交易所	美国	98	94,835.38	0.01
460	Cooper Tire & Rubber Co	Cooper 美国固铂轮胎	CTB UN	纽约证券交易所	美国	356	94,076.01	0.01
461	Redfin Corp	Redfin Corp	RDFN UN	纳斯达克证券交易所	美国	207	92,695.40	0.01
462	AES Corp/The	爱伊斯	AES UN	纽约证券交易所	美国	603	92,461.10	0.01
463	Nasdaq Inc	Nasdaq Inc	NDAQ UN	纳斯达克证券交易所	美国	106	91,808.21	0.01
464	Fastly Inc	Fastly	FSLY UN	纽约证券交易所	美国	161	91,782.96	0.01

		Inc		所				
465	Elastic NV	Elastic NV	ESTC UN	纽约证券交易所	美国	96	91,534.43	0.01
466	Maxar Technologies Inc	Maxar Technologies Inc	MAXR UN	纽约证券交易所	美国	359	90,394.72	0.01
467	Globus Medical Inc	Globus Medical Inc	GMED UN	纽约证券交易所	美国	209	88,940.78	0.01
468	Newmont Corp	Newmont Corp	NEM UN	纽约证券交易所	美国	225	87,924.66	0.01
469	Dynatrace Inc	Dynatrace Inc	DT UN	纽约证券交易所	美国	305	86,111.39	0.01
470	Sony Corp	Sony Corp	SNE UN	纽约证券交易所	美国	128	84,437.43	0.01
471	Varonis Systems Inc	Varonis Systems Inc	VRNS UW	纳斯达克证券交易所	美国	78	83,268.03	0.01
472	Black Knight Inc	Black Knight Inc	BKI UN	纽约证券交易所	美国	144	83,012.39	0.01
473	Big Lots Inc	Big Lots 公司	BIG UN	纽约证券交易所	美国	290	81,233.05	0.01
474	Barrick Gold Corp	Barrick Gold Corp	GOLD UN	纽约证券交易所	美国	526	78,183.18	0.01
475	Best Buy Co Inc	百思买	BBY UN	纽约证券交易所	美国	111	72,274.29	0.01
476	American Tower Corp	美国发射	AMT UN	纽约证券交易所	美国	44	64,441.48	0.01

		塔 公 司		所				
477	Equinix Inc	Equinix 有限公司	EQIX UN	纳斯达克 证券交易所	美国	13	60,579.39	0.01
478	Zynga Inc	Zynga Inc	ZNGA UN	纳斯达克 证券交易所	美国	881	56,737.07	0.01
479	PagerDuty Inc	PagerDuty Inc	PD UN	纽约证 券交易 所	美国	205	55,778.11	0.01
480	Pure Storage Inc	Pure Storage Inc	PSTG UN	纽约证 券交易 所	美国	372	54,880.41	0.01
481	Smartsheet Inc	Smartsheet Inc	SMAR UN	纽约证 券交易 所	美国	121	54,705.35	0.01
482	Coty Inc	科蒂集团	COTY UN	纽约证 券交易 所	美国	1,163	53,270.98	0.01
483	CryoPort Inc	CryoPort 股份有限公司	CYRX UR	纳斯达克 证券交易所	美国	186	53,254.15	0.01
484	Public Storage	公共存储公司	PSA UN	纽约证 券交易 所	美国	35	52,737.83	0.01
485	Wells Fargo & Co	Wells Fargo & Co	WFC UN	纽约证 券交易 所	美国	267	52,578.04	0.01
486	McDonald's Corp	McDonald's Corp	MCD UN	纽约证 券交易 所	美国	35	49,003.96	0.00
487	Yum China Holdings Inc	Yum China Holdings Inc	YUMC UN	纽约证 券交易 所	美国	96	35,760.63	0.00
488	Box Inc	Box 公司	BOX UN	纽约证 券交易 所	美国	128	15,075.13	0.00



489	Gap Inc/The	Gap Inc/The	GPS UN	纽 约 证 券 交 易 所	美国	105	13,832.46	0.00
490	VeriSign Inc	VeriSign Inc	VRSN UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2	2,823.98	0.00
491	Electronic Arts Inc	电 子 艺 界	EA UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2	1,873.95	0.00
492	Tradeweb Markets Inc	Trade web Marke ts Inc	TW UW	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1	407.48	0.00

注：本表所使用的证券代码为彭博代码。

## 8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	Apple Inc	AAPL UW	43,331,912.90	7.44
2	Amazon.com Inc	AMZN UW	39,104,238.14	6.72
3	Microsoft Corp	MSFT UW	38,783,538.40	6.66
4	Alphabet Inc	GOOGL UW	25,259,795.95	4.34
5	Facebook Inc	FB UW	20,216,190.28	3.47
6	NVIDIA Corp	NVDA UW	17,914,844.28	3.08
7	Netflix Inc	NFLX UW	13,145,340.91	2.26
8	NIKE Inc	NKE UN	11,858,310.35	2.04
9	PayPal Holdings Inc	PYPL UW	10,884,039.32	1.87
10	Adobe Inc	ADBE UW	10,786,954.19	1.85
11	UnitedHealth Group Inc	UNH UN	9,693,922.95	1.66
12	salesforce.com Inc	CRM UN	9,483,326.36	1.63
13	Mastercard Inc	MA UN	8,858,988.69	1.52
14	Square Inc	SQ UN	8,273,326.16	1.42
15	Costco Wholesale Corp	COST UW	8,254,949.64	1.42
16	Broadcom Inc	AVGO UW	8,133,846.30	1.40
17	Procter & Gamble Co/The	PG UN	7,680,113.21	1.32

18	Visa Inc	V UN	7,466,876.15	1.28
19	Home Depot Inc/The	HD UN	6,768,014.65	1.16
20	Abbott Laboratories	ABT UN	6,381,183.02	1.10

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	Apple Inc	AAPL UW	38,603,116.06	6.63
2	Alphabet Inc	GOOGL UW	19,186,300.90	3.29
3	Microsoft Corp	MSFT UW	15,794,013.91	2.71
4	NVIDIA Corp	NVDA UW	14,156,163.13	2.43
5	UnitedHealth Group Inc	UNH UN	8,493,347.35	1.46
6	American Tower Corp	AMT UN	8,244,385.82	1.42
7	Netflix Inc	NFLX UW	8,198,978.33	1.41
8	Facebook Inc	FB UW	8,151,418.96	1.40
9	Amazon.com Inc	AMZN UW	7,935,795.95	1.36
10	Adobe Inc	ADBE UW	7,854,877.46	1.35
11	salesforce.com Inc	CRM UN	7,835,035.63	1.35
12	Lockheed Martin Corp	LMT UN	7,680,272.91	1.32
13	Merck & Co Inc	MRK UN	7,551,045.36	1.30
14	PepsiCo Inc	PEP UW	6,842,687.67	1.18
15	Cisco Systems Inc	CSCO UW	6,653,447.02	1.14
16	Coca-Cola Co/The	KO UN	5,665,169.24	0.97
17	NIKE Inc	NKE UN	5,656,204.94	0.97
18	Quidel Corp	QDEL UW	5,099,135.33	0.88
19	Best Buy Co Inc	BBY UN	5,093,854.36	0.87
20	Mastercard Inc	MA UN	5,089,476.38	0.87

### 8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	1,046,657,934.20
卖出收入（成交）总额	866,404,177.73

注：8.5.1 项“买入金额”、8.5.2 项“卖出金额”及 8.5.3 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。

## 8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

无。

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

无。

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

无。

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

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	2,324,759.10	0.22
2	SPDR Gold Shares	ETF	交易型开放式	World Gold Trust Services LLC	705,251.39	0.07
3	ARK Fintech Innovation ETF	ETF	交易型开放式	ARK Investment Management LLC	609,783.22	0.06
4	ARK Next Generation Internet ETF	ETF	交易型开放式	ARK Investment Management LLC	590,180.34	0.06
5	Invesco QQQ Trust Series 1	ETF	交易型开放式	Invesco Capital Management LLC	118,733.08	0.01
6	iShares 20+ Year Treasury	ETF	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	45,283.59	0.00

	Bond ETF					
7	iPath Series B S&P 500 VIX Short-Term Futures ETN	ETN	交易型开放式	Barclays Capital Inc	21,910.61	0.00
8	VanEck Vectors Gold Miners ETF	ETF	交易型开放式	Van Eck Associates Corp	21,387.45	0.00

注：报告期末，本基金仅持有上述 8 支基金。

## 8.11 投资组合报告附注

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

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。

### 8.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	—
2	应收证券清算款	11,065,561.54
3	应收股利	171,405.92
4	应收利息	5,130.37
5	应收申购款	7,374,212.08
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	18,616,309.91

### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## 8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## §9 基金份额持有人信息

## 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币	227,418	1,573.13	-	-	357,757,773.39	100.00
嘉实美国成长股票型证券投资基金-美元现汇	430	8,105.42	-	-	3,485,329.90	100.00
合计	227,796	1,585.82	-	-	361,243,103.29	100.00

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。

## 9.2 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	嘉实美国成长股票型证券投资基金-人民币	37,722.05	0.01

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-美元现汇	-	-
	合计	37,722.05	0.01

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	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

## § 10 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	944,363,882.56	2,625,038.35
减：本报告期基金总赎回份额	830,274,803.70	3,057,737.06
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	357,757,773.39	3,485,329.90

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

（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。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 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。报告年度应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费 110,000.00 元，该审计机构已连续 8 年为本基金提供审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

本基金管理人报告期内收到北京证监局有关警示函的行政监管措施，对存在的问题，公司已采取相应的改进措施。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
Wolfe Research Securities	-	1,729,216,529.95	90.97%	1,227,809.60	97.91%	

瑞士信贷（香港）有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	171,654,718.47	9.03%	26,232.82	2.09%	
德意志银行股份有限公司 Deutsche Bank	-	-	-	-	-	
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；
- （2）财务状况良好；
- （3）研究能力较强；

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。

## 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
Wolfe Research Securities	—	—	—	—	—	—	24,795,651.67	88.57%
瑞士信贷（香港）有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	—	—	—	—	—	—	3,198,875.82	11.43%

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于嘉实美国成长股票（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
7	关于嘉实美国成长股票（QDII）2020 年 7 月 3 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 07 月 01 日
8	关于嘉实美国成长股票（QDII）2020 年 9 月 7 日暂停申购、赎回及定投业务的公告	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 09 月 03 日
9	关于嘉实美国成长股票（QDII）2020 年 11 月 26 日暂停申购、赎回及定投业务的公告	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 11 月 24 日
10	关于嘉实美国成长股票（QDII）2020 年 12 月 25 日暂停申购、赎回及定投业务的公告	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 12 月 23 日

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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。

## 12.2 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

## 12.3 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](mailto:service@jsfund.cn)。

嘉实基金管理有限公司

2021 年 3 月 30 日