

# 广发中证工程机械主题交易型开放式指数证券投资基金发 起式联接基金

## 2025 年第 3 季度报告

2025 年 9 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二五年十月二十八日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

### 2.1 基金产品概况

|            |                                                                                                |
|------------|------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 广发中证工程机械 ETF 发起式联接                                                                             |
| 基金主代码      | 020903                                                                                         |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                         |
| 基金合同生效日    | 2024 年 3 月 25 日                                                                                |
| 报告期末基金份额总额 | 51,333,074.40 份                                                                                |
| 投资目标       | 本基金通过主要投资于目标 ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。                                                   |
| 投资策略       | 本基金为 ETF 联接基金，主要通过投资于目标 ETF 实现对标的指数的紧密跟踪。本基金力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年化跟踪误 |

|                 |                                                                                                                                 |                      |
|-----------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------|
|                 | <p>差控制在 4%以内。</p> <p>具体投资策略包括：1、资产配置策略；2、目标 ETF 投资策略；3、股票投资策略；4、存托凭证投资策略；5、债券投资策略；6、金融衍生品投资策略；7、资产支持证券投资策略；8、参与转融通证券出借业务策略。</p> |                      |
| 业绩比较基准          | 中证工程机械主题指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%                                                                                               |                      |
| 风险收益特征          | 本基金为 ETF 联接基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。                                              |                      |
| 基金管理人           | 广发基金管理有限公司                                                                                                                      |                      |
| 基金托管人           | 招商银行股份有限公司                                                                                                                      |                      |
| 下属分级基金的基金简称     | 广发中证工程机械 ETF 发起式联接 A                                                                                                            | 广发中证工程机械 ETF 发起式联接 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 020903                                                                                                                          | 020904               |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 19,464,173.46 份                                                                                                                 | 31,868,900.94 份      |

### 2.1.1 目标基金基本情况

|              |                          |
|--------------|--------------------------|
| 基金名称         | 广发中证工程机械主题交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金主代码        | 560280                   |
| 基金运作方式       | 交易型开放式                   |
| 基金合同生效日      | 2023 年 10 月 18 日         |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所                  |

|         |                  |
|---------|------------------|
| 上市日期    | 2023 年 10 月 30 日 |
| 基金管理人名称 | 广发基金管理有限公司       |
| 基金托管人名称 | 招商银行股份有限公司       |

### 2.1.2 目标基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                                  |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。                                                                                                                                      |
| 投资策略   | <p>本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。</p> <p>本基金投资于标的指数成份股、备选成份股（含存托凭证）的比例不低于基金资产净值的 90%且不低于非现金基金资产的 80%。</p> <p>具体投资策略包括：1、股票（含存托凭证）投资策略；2、债券投资策略；3、资产支持证券投资策略；4、金融衍生品投资策略；5、参与转融通证券出借业务策略。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证工程机械主题指数收益率                                                                                                                                                                                                                    |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。                                                                                                                                |

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标         | 报告期                              |                         |
|----------------|----------------------------------|-------------------------|
|                | (2025 年 7 月 1 日-2025 年 9 月 30 日) |                         |
|                | 广发中证工程机械<br>ETF 发起式联接 A          | 广发中证工程机械<br>ETF 发起式联接 C |
| 1.本期已实现收益      | 789,252.38                       | 1,155,885.00            |
| 2.本期利润         | 3,831,498.69                     | 3,566,819.67            |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1914                           | 0.1162                  |
| 4.期末基金资产净值     | 26,943,392.29                    | 43,914,044.19           |
| 5.期末基金份额净值     | 1.3843                           | 1.3780                  |

注：（1）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

### 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

##### 1、广发中证工程机械 ETF 发起式联接 A：

| 阶段         | 净值增长率① | 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      | 18.24% | 1.11%     | 17.86%     | 1.21%         | 0.38%  | -0.10% |
| 过去六个月      | 12.88% | 1.32%     | 12.03%     | 1.36%         | 0.85%  | -0.04% |
| 过去一年       | 22.34% | 1.44%     | 22.75%     | 1.43%         | -0.41% | 0.01%  |
| 自基金合同生效起至今 | 38.43% | 1.50%     | 38.98%     | 1.52%         | -0.55% | -0.02% |

##### 2、广发中证工程机械 ETF 发起式联接 C：

| 阶段 | 净值增长 | 净值增长 | 业绩比较 | 业绩比较 | ①—③ | ②—④ |
|----|------|------|------|------|-----|-----|
|----|------|------|------|------|-----|-----|

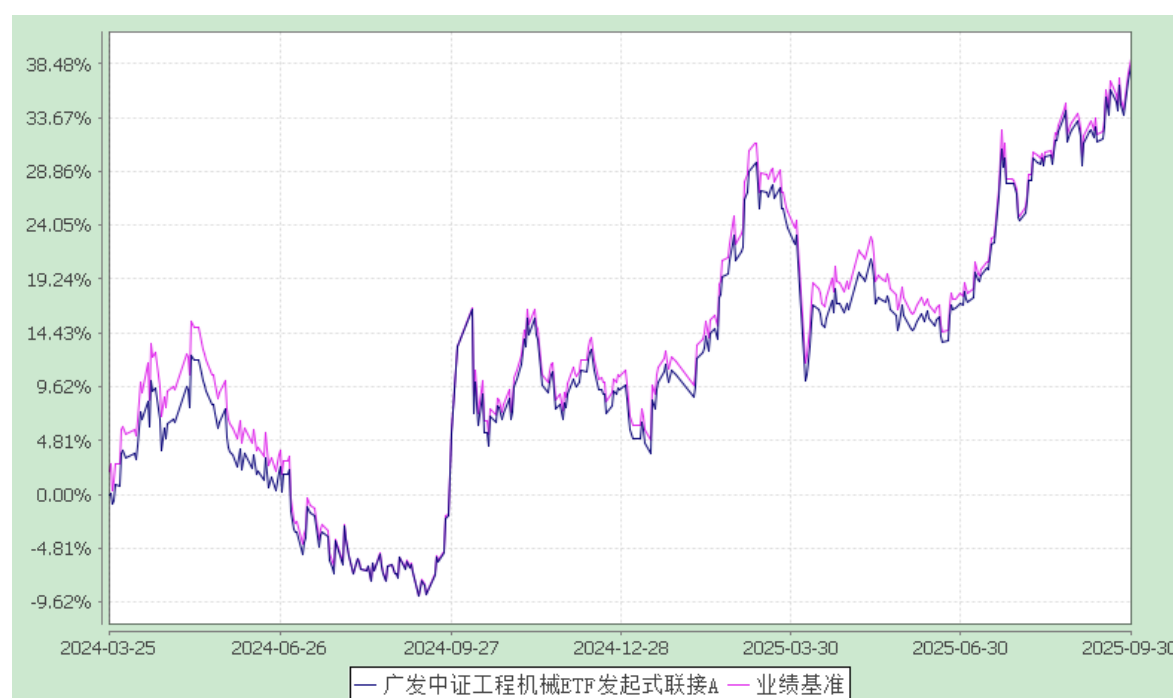
|                    | 率①     | 率标准差<br>② | 基准收益<br>率③ | 基准收益<br>率标准差<br>④ |        |        |
|--------------------|--------|-----------|------------|-------------------|--------|--------|
| 过去三个<br>月          | 18.14% | 1.11%     | 17.86%     | 1.21%             | 0.28%  | -0.10% |
| 过去六个<br>月          | 12.71% | 1.32%     | 12.03%     | 1.36%             | 0.68%  | -0.04% |
| 过去一年               | 21.97% | 1.44%     | 22.75%     | 1.43%             | -0.78% | 0.01%  |
| 自基金合<br>同生效起<br>至今 | 37.80% | 1.50%     | 38.98%     | 1.52%             | -1.18% | -0.02% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

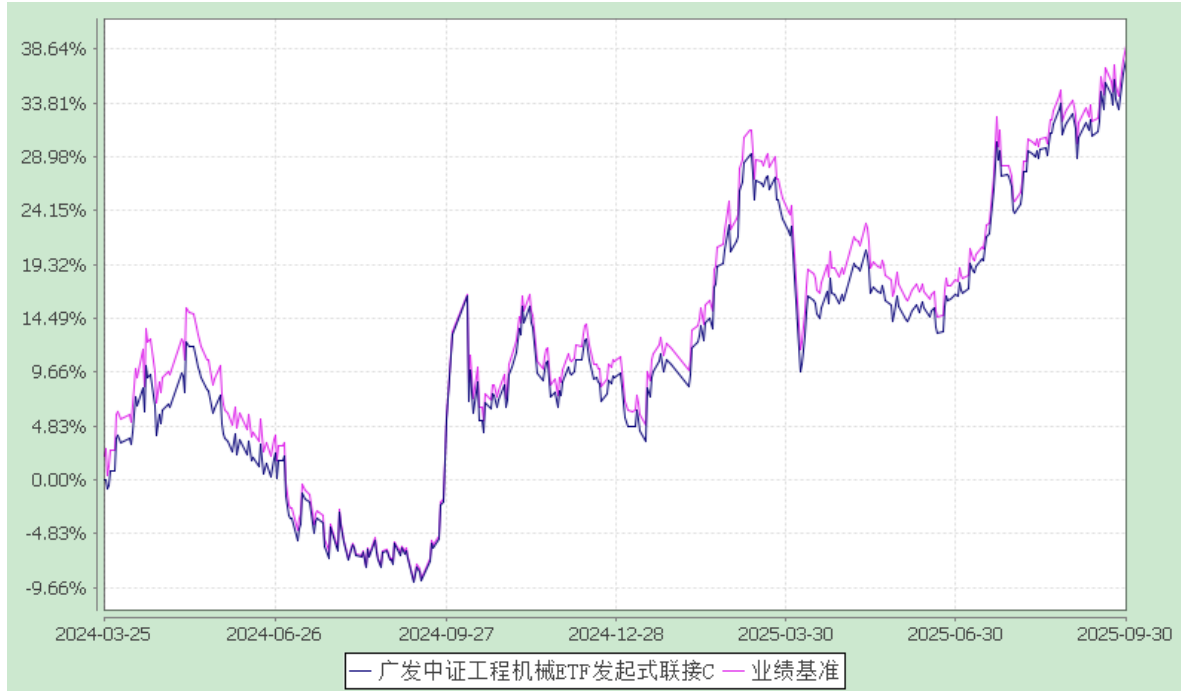
广发中证工程机械主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2024 年 3 月 25 日至 2025 年 9 月 30 日)

#### 1、广发中证工程机械 ETF 发起式联接 A:



#### 2、广发中证工程机械 ETF 发起式联接 C:



§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务                                                                                                                             | 任本基金的基金<br>经理期限 |          | 证券<br>从业<br>年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                        |
|----|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|----------|----------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                                                                                                                                | 任职<br>日期        | 离任<br>日期 |                |                                                                                                                                                                                                                                           |
| 姚曦 | 本基金的基金经理；广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)的基金经理；广发中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广 | 2024-03-25      | -        | 10.2 年         | 姚曦先生，中国籍，商科硕士，持有中国证券基金业从业证书。曾任广发期货有限公司发展研究中心研究员、广发基金管理有限公司指数投资部研究员、广发中证京津冀协同发展主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2021 年 11 月 23 日至 2022 年 12 月 21 日)、广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2021 年 11 月 23 日至 2023 年 6 月 11 日)、广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金 |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                               |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                              |
|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金(QDII-LOF)的基金经理；广发中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指汽车交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发上海金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理；广发上海金交易型开放式证券投资基金的基金经理；广发中证工程机械主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理</p> |  |  |  | <p>基金经理(自 2021 年 11 月 23 日至 2023 年 6 月 11 日)、广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2023 年 6 月 12 日至 2023 年 7 月 24 日)、广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2023 年 6 月 12 日至 2023 年 7 月 24 日)、广发中证光伏龙头 30 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2022 年 11 月 16 日至 2023 年 12 月 13 日)。</p> |
|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

注：1.对基金的首任基金经理，“任职日期”为基金合同生效日/转型生效日，“离任日期”为公司公告解聘日期。对此后的非首任基金经理/基金经理助理，“任职日期”和“离任日期”分别指公司公告聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从中国证监会及行业协会相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有

关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，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。本报告期内基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，通过持续完善工作制度、流程和提高技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司还通过事后分析、监察稽核和信息披露等手段加强对公平交易过程和结果的监督。在投资决策的内部控制方面，公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度，投资组合的投资标的必须来源于公司备选库，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，按照“时间优先、价格优先、比例分配、平等对待”的原则，公平分配投资指令。公司对投资交易实施全程动态监控，通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生任何不公平的交易事项。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的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% 的交易共有 17 次，其中 16 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，其余 1 次为不同投资经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关投资经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

作为 ETF 联接基金，本基金秉承指数化被动投资策略，主要持有广发中证工程机械主题 ETF 及指数成份股等，间接复制指数，同时积极应对成份股调整、基金申

购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，进一步降低基金的跟踪误差。

报告期内，工程机械行业在国内外需求共振的驱动下延续了上半年的复苏势头，呈现出量价齐升、盈利改善的积极态势。其中 1-8 月挖掘机、装载机等品类累计销量同比继续改善；上半年企业营收和利润大幅增长。从驱动力来看，国内政策红利持续释放，海外市场韧性十足是推动行业改善的主要原因。在国家重大战略和重点领域安全能力建设、“大规模设备更新和消费品以旧换新”政策驱动下，工程机械国内需求保持高增长。同时，出口市场呈现多元化格局，除传统市场外，东南亚、中东、非洲等“一带一路”新兴市场贡献了显著增量。此外，原材料价格处于相对低位，加之企业产品结构不断优化，成本下降与产品升级带来企业盈利持续改善。

基金投资运作方面，本基金严格遵守合同要求，认真对待投资者日常申购、赎回及成份股调整等工作，本基金在报告期内交易和申购赎回正常，运作过程中未发生风险事件。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 18.24%，C 类基金份额净值增长率为 18.14%，同期业绩比较基准收益率为 17.86%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金且截至本报告期末，合同生效不满三年，不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的披露规定。

### §5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目     | 金额(元)         | 占基金总资产的比例(%) |
|----|--------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资   | -             | -            |
|    | 其中：股票  | -             | -            |
| 2  | 基金投资   | 67,052,920.34 | 87.05        |
| 3  | 固定收益投资 | 503,865.62    | 0.65         |

|   |                   |               |        |
|---|-------------------|---------------|--------|
|   | 其中：债券             | 503,865.62    | 0.65   |
|   | 资产支持证券            | -             | -      |
| 4 | 贵金属投资             | -             | -      |
| 5 | 金融衍生品投资           | -             | -      |
| 6 | 买入返售金融资产          | -             | -      |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -             | -      |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计      | 5,222,086.67  | 6.78   |
| 8 | 其他资产              | 4,244,778.47  | 5.51   |
| 9 | 合计                | 77,023,651.10 | 100.00 |

## 5.2 期末投资目标基金明细

| 序号 | 基金名称                     | 基金类型 | 运作方式   | 管理人        | 公允价值<br>(元)   | 占基金资产净值比例<br>(%) |
|----|--------------------------|------|--------|------------|---------------|------------------|
| 1  | 广发中证工程机械主题交易型开放式指数证券投资基金 | 股票型  | 交易型开放式 | 广发基金管理有限公司 | 67,052,920.34 | 94.63            |

## 5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.3.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

### 5.3.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

## 5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|---------|--------------|
|----|------|---------|--------------|

|    |           |            |      |
|----|-----------|------------|------|
| 1  | 国家债券      | 503,865.62 | 0.71 |
| 2  | 央行票据      | -          | -    |
| 3  | 金融债券      | -          | -    |
|    | 其中：政策性金融债 | -          | -    |
| 4  | 企业债券      | -          | -    |
| 5  | 企业短期融资券   | -          | -    |
| 6  | 中期票据      | -          | -    |
| 7  | 可转债（可交换债） | -          | -    |
| 8  | 同业存单      | -          | -    |
| 9  | 其他        | -          | -    |
| 10 | 合计        | 503,865.62 | 0.71 |

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码      | 债券名称     | 数量（张） | 公允价值(元)    | 占基金资产<br>净值比例<br>（%） |
|----|-----------|----------|-------|------------|----------------------|
| 1  | 019766.SH | 25 国债 01 | 5,000 | 503,865.62 | 0.71                 |

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（1）本基金本报告期末未持有股指期货。

（2）本基金本报告期内未进行股指期货交易。

#### 5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本基金本报告期末未持有国债期货。

(2) 本基金本报告期内未进行国债期货交易。

## 5.12 投资组合报告附注

**5.12.1** 本基金为目标 ETF 的联接基金，本基金目标 ETF 投资的前十名证券的发行主体中，浙江海控南科华铁数智科技股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到综合行政执法局的处罚。中联重科股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局、中国人民银行分支行的处罚。

上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金及本基金目标 ETF 投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**5.12.2** 本报告期内，本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

### 5.12.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 27,672.31    |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | -            |
| 5  | 应收申购款   | 4,217,106.16 |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 4,244,778.47 |

### 5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                            | 广发中证工程机械<br>ETF发起式联接A | 广发中证工程机械<br>ETF发起式联接C |
|-------------------------------|-----------------------|-----------------------|
| 报告期期初基金份额总额                   | 16,158,609.79         | 11,548,156.90         |
| 报告期期间基金总申购份额                  | 16,830,900.29         | 118,686,878.94        |
| 减：报告期期间基金总赎回份额                | 13,525,336.62         | 98,366,134.90         |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份<br>额减少以“-”填列） | -                     | -                     |
| 报告期期末基金份额总额                   | 19,464,173.46         | 31,868,900.94         |

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

|                              |               |
|------------------------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额             | 10,002,872.42 |
| 报告期期间买入/申购总份额                | -             |
| 报告期期间卖出/赎回总份额                | -             |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额             | 10,002,872.42 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比<br>例（%） | 19.49         |

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在运用固有资金（认）申购、赎回或买卖本基金的情况。

## §8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份<br>额总数 | 持有份额<br>占基金总<br>份额比例 | 发起份<br>额总数 | 发起份额占<br>基金总份额<br>比例 | 发起份额承<br>诺持有期限 |
|----|------------|----------------------|------------|----------------------|----------------|
|    |            |                      |            |                      |                |

|             |               |        |               |        |    |
|-------------|---------------|--------|---------------|--------|----|
| 基金管理人固有资金   | 10,002,872.42 | 19.49% | 10,002,872.42 | 19.49% | 三年 |
| 基金管理人高级管理人员 | -             | -      | -             | -      | -  |
| 基金经理等人员     | -             | -      | -             | -      | -  |
| 基金管理人股东     | -             | -      | -             | -      | -  |
| 其他          | -             | -      | -             | -      | -  |
| 合计          | 10,002,872.42 | 19.49% | 10,002,872.42 | 19.49% | 三年 |

## §9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | 报告期内持有基金份额变化情况 |                                                       |               |      |      | 报告期末持有基金情况    |        |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|-------------------------------------------------------|---------------|------|------|---------------|--------|
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间                                | 期初份额          | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额          | 份额占比   |
| 机构                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | 1              | 20250701-20250722,20250829-20250925,20250929-20250929 | 10,002,872.42 | -    | -    | 10,002,872.42 | 19.49% |
| 产品特有风险                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |                |                                                       |               |      |      |               |        |
| <p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>1、当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；</p> <p>2、在极端情况下，基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；</p> <p>3、当个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；</p> <p>4、在特定情况下，当个别投资者大额赎回，可能导致本基金资产规模和基金份额持有人数量未能满足合同约定，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；</p> <p>5、在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时，持有基金份额占比较高的投资者可能拥有较大话语权。</p> <p>本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。</p> |                |                                                       |               |      |      |               |        |

## §10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

（一）中国证监会注册广发中证工程机械主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金募集的文件

（二）《广发中证工程机械主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》

（三）《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》

（四）《广发中证工程机械主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》

（五）法律意见书

### 10.2 存放地点

广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

### 10.3 查阅方式

- 1.书面查阅：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件；
- 2.网站查阅：基金管理人网址 [www.gffunds.com.cn](http://www.gffunds.com.cn)。

广发基金管理有限公司  
二〇二五年十月二十八日