

广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 联接基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年八月三十一日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	21
7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 期末投资目标基金明细	44
7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	45
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
7.7 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	59
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	59
7.9 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贵金属投资明细	59
7.10 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	59
7.11 本基金投资股指期货的投资政策	59
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59

7.13 投资组合报告附注	60
8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	61
9 开放式基金份额变动	62
10 重大事件揭示	62
10.1 基金份额持有人大会决议	62
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	63
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	63
10.8 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	63
10.9 其他重大事件	67
11 影响投资者决策的其他重要信息	67
12 备查文件目录	67
12.1 备查文件目录	67
12.2 存放地点	68
12.3 查阅方式	68

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金		
基金简称	广发中证 A500ETF 联接		
基金主代码	022424		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2024 年 11 月 5 日		
基金管理人	广发基金管理有限公司		
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	3,271,451,516.74 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	广发中证 A500ETF 联接 A	广发中证 A500ETF 联接 C	广发中证 A500ETF 联接 Y
下属分级基金的交易代码	022424	022425	022971
报告期末下属分级基金的 份额总额	2,174,973,342.10 份	1,047,993,449.66 份	48,484,724.98 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	563800
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 11 月 11 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2024 年 11 月 18 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	中国银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

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，年化跟踪误差控制在 4%以内。具体策略包括：（1）资产配置策略；（2）目标 ETF 投资策略；（3）股票投资策略；（4）债券投资策略；（5）可转换债券与可交换债券投资策略；（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。
业绩比较基准	中证 A500 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，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。

2.2.1 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	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。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股（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%。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期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。

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		广发基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	项军	许俊
	联系电话	020-83936666	010-66596688
	电子邮箱	xiangj@gffunds.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		95105828	95566
传真		020-34281105	010-66594942
注册地址		广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608室	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		广东省广州市海珠区琶洲大道168号星河湾中心28-38层；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；广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2603-2622室	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		510308	100818

法定代表人	葛长伟	葛海蛟
-------	-----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.gffunds.com.cn
基金中期报告置备地点	广东省广州市海珠区琶洲大道 168 号星河湾中心 28-38 层；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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	广发基金管理有限公司	广东省广州市海珠区琶洲大道 168 号星河湾中心 28-38 层；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；广东省珠海市横琴新区环岛东路 3018 号 2603-2622 室

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）		
	广发中证 A500ETF 联接 A	广发中证 A500ETF 联接 C	广发中证 A500ETF 联接 Y
本期已实现收益	194,625,287.51	84,151,138.54	3,479,553.18
本期利润	352,585,798.01	151,666,881.00	6,361,766.04
加权平均基金份额本期利润	0.1435	0.1377	0.1402
本期加权平均净值利润率	11.67%	11.23%	11.38%
本期基金份额净值增长率	11.79%	11.69%	11.79%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)		
	广发中证 A500ETF 联接 A	广发中证 A500ETF 联接 C	广发中证 A500ETF 联接 Y
期末可供分配利润	269,795,188.06	125,873,057.57	6,011,825.19
期末可供分配基金份额利润	0.1240	0.1201	0.1240
期末基金资产净值	2,859,881,101.10	1,373,455,757.10	63,749,854.56
期末基金份额净值	1.3149	1.3106	1.3148
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)		

	广发中证 A500ETF 联接 A	广发中证 A500ETF 联接 C	广发中证 A500ETF 联接 Y
基金份额累计净值增长率	31.49%	31.06%	33.88%

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）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 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

广发中证 A500ETF 联接 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	14.38%	1.33%	13.54%	1.34%	0.84%	-0.01%
过去六个月	11.79%	1.22%	11.34%	1.22%	0.45%	0.00%
过去一年	35.88%	1.09%	34.41%	1.09%	1.47%	0.00%
自基金合同生效起至今	31.49%	1.07%	33.54%	1.08%	-2.05%	-0.01%

广发中证 A500ETF 联接 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	14.33%	1.33%	13.54%	1.34%	0.79%	-0.01%
过去六个月	11.69%	1.22%	11.34%	1.22%	0.35%	0.00%
过去一年	35.60%	1.09%	34.41%	1.09%	1.19%	0.00%
自基金合同生效起至今	31.06%	1.07%	33.54%	1.08%	-2.48%	-0.01%

广发中证 A500ETF 联接 Y

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	14.38%	1.33%	13.54%	1.34%	0.84%	-0.01%
过去六个月	11.79%	1.22%	11.34%	1.22%	0.45%	0.00%
过去一年	35.87%	1.09%	34.41%	1.09%	1.46%	0.00%
自基金合同生效起至今	33.88%	1.07%	31.01%	1.07%	2.87%	0.00%

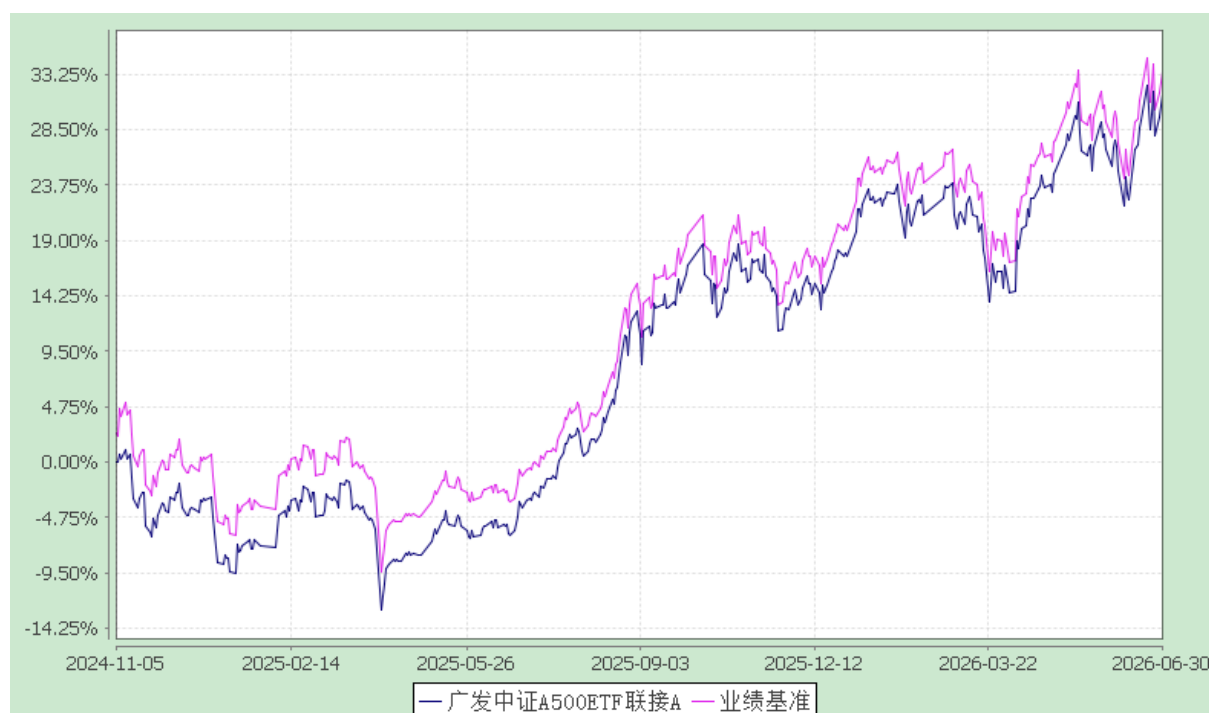
注：业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的，由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照

合同规定比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

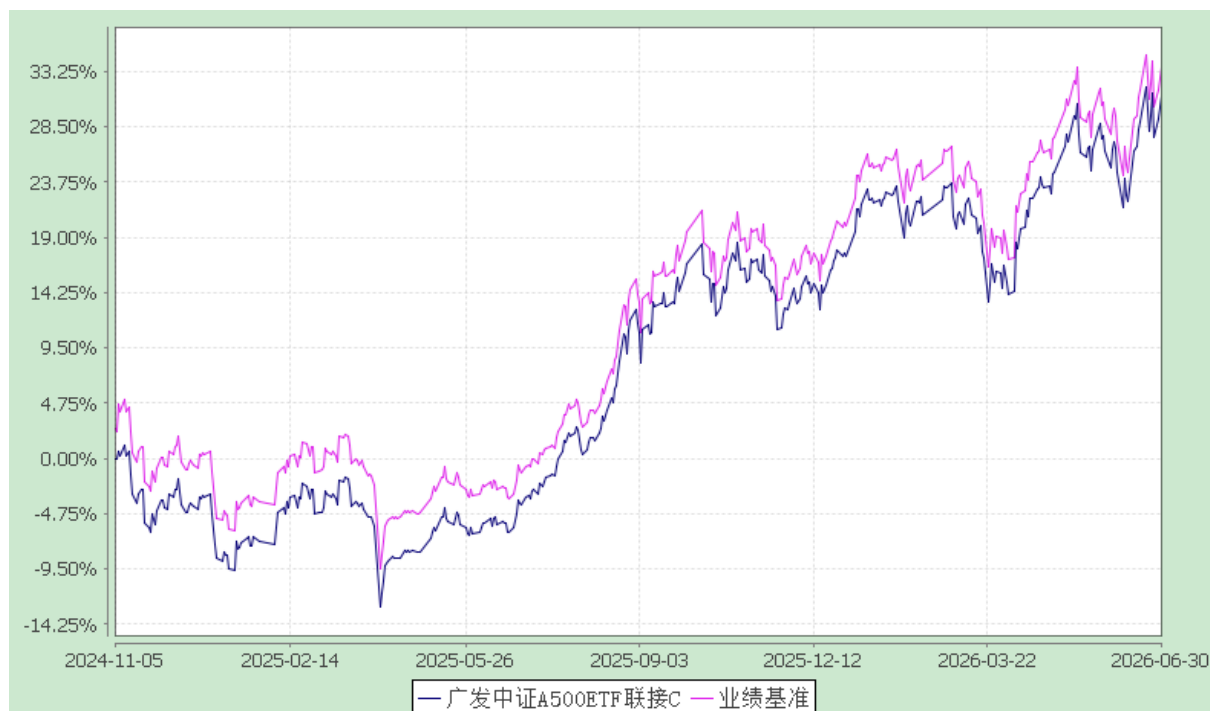
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2024 年 11 月 5 日至 2026 年 6 月 30 日）

广发中证 A500ETF 联接 A



广发中证 A500ETF 联接 C



广发中证 A500ETF 联接 Y



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

经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，本基金管理人于 2003 年 8 月 5 日成立。本基金管理人拥有公募基金管理、特定客户资产管理、基金投资顾问、社保基金境内投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、保险资金投资管理人、保险保障基金委托资产管理投资管理人、QDII、QDLP 等业务资格，旗下产品覆盖主动权益、固定收益、海外投资、被动投资、量化投资、FOF 投资、另类投资等类别，为境内外客户提供标准化和定制化的资产管理服务。

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		
陆志明	本基金的基金经理；广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发中证全指建筑材料指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发上证科创板 50 成份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；广发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资	2024-11-18	-	27.2 年	陆志明先生，中国籍，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任大鹏证券有限公司研究员，深圳证券信息有限公司部门总监，广发基金管理有限公司数量投资部总经理、指数投资部副总经理、量化投资部副总经理、广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2011 年 6 月 3 日至 2016 年 7 月 28 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 2011 年 6 月 9 日至 2016 年 7 月 28 日)、广发深证 100 指数分级证券投资基金基金经理(自 2012 年 5 月 7 日至 2016 年 7 月 28 日)、广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金基金经理(自 2014 年 10 月 30 日至 2016 年 7 月 28 日)、广发中证医疗指数分级证券投资基金基金经理(自 2015 年 7 月 23 日至 2016 年 7 月 28 日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015 年 7 月 9 日至 2018 年 10 月 9 日)、广发中证全指主要

	基金联接基金的基金经理； 广发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理； 广发中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理； 广发中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金的基金经理； 广发中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理； 广发中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金的基金经理； 广发中证全指电力公用事业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； 广发中证上海环交所碳中和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； 广发中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投			消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015 年 8 月 18 日至 2018 年 12 月 20 日)、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015 年 8 月 18 日至 2018 年 12 月 20 日)、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 7 月 1 日至 2019 年 4 月 2 日)、广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2017 年 6 月 13 日至 2020 年 8 月 21 日)、广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2017 年 6 月 13 日至 2021 年 2 月 10 日)、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2014 年 6 月 3 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2014 年 12 月 1 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 1 月 8 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015 年 1 月 29 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 3 月 23 日至 2021 年 6 月 17 日)、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基金经理(自 2015 年 4 月 15 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015 年 5 月 6 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 6 月 25 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发
--	---	--	--	---

	资基金的基金经理；广发国证粮食产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；广发中证红利低波动指数型发起式证券投资基金的基金经理				中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 6 月 25 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015 年 7 月 9 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指家用电器指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2021 年 6 月 17 日至 2022 年 5 月 10 日)、广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2021 年 6 月 17 日至 2022 年 11 月 22 日)、广发深证 100 指数证券投资基金(LOF)基金经理(自 2021 年 6 月 17 日至 2024 年 7 月 3 日)、广发中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2022 年 11 月 23 日至 2024 年 8 月 8 日)、广发中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2023 年 7 月 25 日至 2024 年 10 月 31 日)、广发中证 A500 指数型证券投资基金基金经理(自 2024 年 11 月 5 日至 2024 年 11 月 17 日)、广发中证 A50 指数型证券投资基金基金经理(自 2025 年 3 月 3 日至 2025 年 12 月 24 日)。
--	---	--	--	--	--

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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 77 次，其中 76 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 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

2026 年上半年度，在政策环境偏积极、外需表现较强、科技政策持续推进以及市场风险偏好改善等因素共同影响下，A 股市场呈现出上扬的走势，代表整体市场走势的中证全指全收益指数上涨 11.51%。从市值规模和风格两个维度来看，今年上半年度大小市值指数之间收益分化较小，但成长和价值指数之间收益表现差异相对较大，成长指数大幅上扬，而价值指数逆市下跌。今年上半年度相对于去年下半年度，代表整体市场活跃度的中证全指日均换手率有所上升，市场波动率也有所回升，整体市场运行呈现出个股和行业分化较大、市场交易活跃的运行态势。

本基金跟踪的标的是中证 A500 指数，该指数是从各行业选取市值较大、流动性较好的 500 只证券作为指数样本，以反映各行业最具代表性上市公司证券的整体表现。作为 ETF 联接基金，本基金

秉承指数化被动投资策略，主要持有标的 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，降低基金的跟踪误差。

中证 A500 指数主要以市场中市值较大的股票作为样本，同时兼顾行业代表性，总体呈现出大市值风格特征。由于上半年大小市值风格指数表现不存在明显差异，而中证 A500 指数选取了各个行业的龙头企业，部分行业成长龙头被选入本指数，从而带动上半年度收益率小幅跑赢整体市场指数。指数样本股票平均换手率有所下降，但波动率跟随整体市场较上个半年度有所上升，表明中证 A500 指数是良好的兼顾市场表征特点和成长性特点的指数。

在基金投资运作方面，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。

4.4.2 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 11.79%，C 类基金份额净值增长率为 11.69%，Y 类基金份额净值增长率为 11.79%，同期业绩比较基准收益率为 11.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年上半年经济发展稳中求进，国民经济运行总体平稳、向新向优，实现国内生产总值同比增长 4.7%，增量达近五年同期最大。随着降准降息持续发力、地产政策进一步优化、高水平对外开放深化以及全国统一大市场建设提速，宏观调控对经济回升向好的支撑作用持续显现。预计未来我国经济总体保持平稳健康可持续发展。整体宏观经济的稳步复苏将改善上市公司的盈利水平，从而带动整体市场指数的平均每股盈利出现回升。目前市场核心指数的市盈率虽较前期有所提升，但仍处于较合理的分位水平。上述宏观经济背景，对整体市场的上市公司盈利和估值方面给予了较好的支撑。但由于受到地缘因素、全球贸易摩擦对进出口和产业链的影响，以及劳动者收入前景预期对消费的制约，经济发展进程仍受制于多种复杂因素，宏观经济运行过程中机遇与风险并存，对整体市场而言，亦是机遇与风险并存。

中证 A500 指数作为市场核心指数之一，包含了许多成长中的行业龙头股票，指数在估值水平与市场代表性等方面，都具有较强的代表性，表明该指数未来具有长期投资价值。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、资产管理产品相关会计处理规定、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会，负责制订健全、有效的估值政策和程序，定期对估值政策和程序的执行情况进行评价，确保基金估值的公平、合理。估值委员会配备投资、研究、会计和风控等岗位资深人员。为保证基金估值的客观独立，基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。

本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关投资品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“基金收益分配原则”的相关规定，本基金本报告期内未进行利润分配，符合合同规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

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”）在广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回

价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	77,387,740.22	151,456,790.30
结算备付金		34,291,865.28	36,698,136.04
存出保证金		5,088,975.86	2,861,706.72
交易性金融资产	6.4.7.2	4,218,510,101.06	4,452,397,744.61
其中：股票投资		175,597,285.36	53,534.46
基金投资		3,890,775,161.87	4,245,057,421.11
债券投资		152,137,653.83	207,286,789.04
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		-	100,009,831.43
应收股利		-	-
应收申购款		17,692,681.03	357,279,547.46

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		4,352,971,363.45	5,100,703,756.56
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		17,757,428.15	8,004,772.56
应付清算款		-	-
应付赎回款		36,550,923.85	641,784,420.06
应付管理人报酬		49,461.14	33,651.27
应付托管费		16,487.03	11,217.11
应付销售服务费		219,460.51	177,948.76
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,181,844.80	816,146.75
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	109,045.21	180,384.17
负债合计		55,884,650.69	651,008,540.68
净资产:			
实收基金	6.4.7.8	3,271,451,516.74	3,785,890,255.23
未分配利润	6.4.7.9	1,025,635,196.02	663,804,960.65
净资产合计		4,297,086,712.76	4,449,695,215.88
负债和净资产总计		4,352,971,363.45	5,100,703,756.56

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，广发中证 A500ETF 联接 A 基金份额净值人民币 1.3149 元，基金份额总额 2,174,973,342.10 份；广发中证 A500ETF 联接 C 基金份额净值人民币 1.3106 元，基金份额总额 1,047,993,449.66 份；广发中证 A500ETF 联接 Y 基金份额净值人民币 1.3148 元，基金份额总额 48,484,724.98 份；总份额总额 3,271,451,516.74 份。

6.2 利润表

会计主体：广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		513,708,027.00	117,547,500.29

1. 利息收入		489,904.78	579,797.91
其中：存款利息收入	6.4.7.10	489,904.78	579,797.91
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		284,198,453.79	988,875.35
其中：股票投资收益	6.4.7.11	4,837,788.30	-8,438,645.79
基金投资收益	6.4.7.12	275,609,969.39	7,371,997.19
债券投资收益	6.4.7.13	956,191.80	2,351,679.06
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	1,304,989.06	-324,737.55
股利收益	6.4.7.17	1,489,515.24	28,582.44
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	228,358,465.82	115,848,647.77
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	661,202.61	130,179.26
减：二、营业总支出		3,093,581.95	4,535,602.59
1. 管理人报酬		276,089.46	327,211.89
2. 托管费		92,029.80	109,070.67
3. 销售服务费		1,339,709.37	3,211,982.51
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		283,437.67	707,428.10
其中：卖出回购金融资产支出		283,437.67	707,428.10
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		999,751.53	69,374.89
8. 其他费用	6.4.7.21	102,564.12	110,534.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		510,614,445.05	113,011,897.70
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		510,614,445.05	113,011,897.70
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		510,614,445.05	113,011,897.70

6.3 净资产变动表

会计主体：广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	3,785,890,255.23	663,804,960.65	4,449,695,215.88
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	3,785,890,255.23	663,804,960.65	4,449,695,215.88
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-514,438,738.49	361,830,235.37	-152,608,503.12
（一）、综合收益总额	-	510,614,445.05	510,614,445.05
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-514,438,738.49	-148,784,209.68	-663,222,948.17
其中：1.基金申购款	2,384,439,417.39	534,082,495.40	2,918,521,912.79
2.基金赎回款	-2,898,878,155.88	-682,866,705.08	-3,581,744,860.96
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	3,271,451,516.74	1,025,635,196.02	4,297,086,712.76
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	8,925,188,918.06	-421,147,571.69	8,504,041,346.37
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	8,925,188,918.06	-421,147,571.69	8,504,041,346.37
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-842,474,466.48	156,305,523.84	-686,168,942.64
（一）、综合收益总额	-	113,011,897.70	113,011,897.70

（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-842,474,466.48	43,293,626.14	-799,180,840.34
其中：1.基金申购款	2,495,128,834.35	-134,507,593.96	2,360,621,240.39
2.基金赎回款	-3,337,603,300.83	177,801,220.10	-3,159,802,080.73
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	8,082,714,451.58	-264,842,047.85	7,817,872,403.73

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：葛长伟 主管会计工作负责人：窦刚 会计机构负责人：张晓章

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“本基金”）是由广发中证 A500 指数型证券投资基金（“原基金”）变更而来。原基金经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2024]1442 号《关于准予广发中证 A500 指数型证券投资基金注册的批复》准予注册，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《广发中证 A500 指数型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金于 2024 年 10 月 25 日至 2024 年 11 月 1 日止期间募集不包括认购资金利息共计人民币 7,994,497,541.13 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证。经向中国证监会备案，原基金基金合同于 2024 年 11 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 7,996,259,266.53 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,761,725.40 份基金份额。根据原基金基金合同及本基金的基金管理人于 2024 年 11 月 15 日发布的《关于广发中证 A500 指数型证券投资基金变更为广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金并相应修订基金合同等法律文件的公告》，自 2024 年 11 月 18 日起，《广发中证 A500 指数型证券投资基金基金合同》失效且《广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于同一日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

限公司。

本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式、销售所适用账户的不同，将基金份额分为 A 类基金份额、C 类基金份额和 Y 类基金份额。本基金自 2024 年 12 月 13 日起增设 Y 类基金份额，原 A 类、C 类基金份额保持不变。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号<会计报表附注的编制及披露>》、中国证券投资基金业协会发布的《公开募集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》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》，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〔2008〕132 号文《关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》、

财税〔2012〕85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2014〕81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税〔2015〕101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2015〕125 号《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、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〕127 号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税〔2016〕140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税〔2017〕2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税〔2017〕56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税〔2017〕90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》，财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、2025 年第 11 号《关于黄金有关税收政策的公告》（自 2025 年 11 月 1 日起施行）、2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、2026 年第 12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》，国税发明电〔2002〕47 号《黄金交易增值税征收管理办法》（自 2025 年 11 月 1 日起废止）及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

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，暂（可选择）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。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入及金融同业往来利息收入免征增值税，通过上海黄金交易所、上海期货交易所交易标准黄金，未发生实物交割的，免征增值税。但自 2025 年 8 月 8 日（含当日）起，新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，免征增值税直至债券到期。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（2）企业所得税、个人所得税

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

对从境内公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，自 2015 年 9 月 8 日起暂免征收个人所得税。目前暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。前述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，由 H 股公司根据中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提供的投资者名册，按照 20% 的税率代扣个人所得税；通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(3) 印花税

境内证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳，自 2023 年 8 月 28 日起减半征收。基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	77,387,740.22
等于：本金	77,380,006.51
加：应计利息	7,733.71
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	77,387,740.22

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		162,735,572.31	-	175,597,285.36	12,861,713.05
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所	150,753,558.00	1,405,593.83	152,137,653.83	-21,498.00

	市场				
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	150,753,558.00	1,405,593.83	152,137,653.83	-21,498.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		2,909,561,692.37	-	3,890,775,161.87	981,213,469.50
其他		-	-	-	-
合计		3,223,050,822.68	1,405,593.83	4,218,510,101.06	994,053,684.55

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	38,183,340.00	-	-	-
其中：股指期货投资	38,183,340.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	38,183,340.00	-	-	-

注：期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2607	IC2607	5.00	8,928,200.00	297,080.00
IF2607	IF2607	20.00	29,532,000.00	-20,220.00
合计	-	-	-	276,860.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	276,860.00
净额	-	-	-	-

注：衍生金融资产项下的衍生工具为期货投资。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额列示，为人民币零元。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	17,569.84
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	4,694.92
其中：交易所市场	4,694.92
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,780.45
合计	109,045.21

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

广发中证 A500ETF 联接 A		
项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,595,541,536.36	2,595,541,536.36
本期申购	1,694,104,780.01	1,694,104,780.01
本期赎回（以“-”号填列）	-2,114,672,974.27	-2,114,672,974.27
本期末	2,174,973,342.10	2,174,973,342.10

金额单位：人民币元

广发中证 A500ETF 联接 C		
项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,154,808,459.12	1,154,808,459.12

本期申购	666,840,316.53	666,840,316.53
本期赎回（以“-”号填列）	-773,655,325.99	-773,655,325.99
本期末	1,047,993,449.66	1,047,993,449.66

金额单位：人民币元

广发中证 A500ETF 联接 Y		
项目	本期	
	2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	35,540,259.75	35,540,259.75
本期申购	23,494,320.85	23,494,320.85
本期赎回（以“-”号填列）	-10,549,855.62	-10,549,855.62
本期末	48,484,724.98	48,484,724.98

注：申购含转换转入、红利再投资份（金）额，赎回含转换转出份（金）额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

广发中证 A500ETF 联接 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	119,513,437.15	337,739,773.58	457,253,210.73
本期期初	119,513,437.15	337,739,773.58	457,253,210.73
本期利润	194,625,287.51	157,960,510.50	352,585,798.01
本期基金份额交易产生的变动数	-44,343,536.60	-80,587,713.14	-124,931,249.74
其中：基金申购款	134,695,140.59	242,446,691.90	377,141,832.49
基金赎回款	-179,038,677.19	-323,034,405.04	-502,073,082.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	269,795,188.06	415,112,570.94	684,907,759.00

单位：人民币元

广发中证 A500ETF 联接 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	50,278,597.59	150,013,876.62	200,292,474.21
本期期初	50,278,597.59	150,013,876.62	200,292,474.21
本期利润	84,151,138.54	67,515,742.46	151,666,881.00
本期基金份额交易产生的变动数	-8,556,678.56	-17,940,369.21	-26,497,047.77
其中：基金申购款	55,572,197.88	96,134,475.49	151,706,673.37
基金赎回款	-64,128,876.44	-114,074,844.70	-178,203,721.14

本期已分配利润	-	-	-
本期末	125,873,057.57	199,589,249.87	325,462,307.44

单位：人民币元

广发中证 A500ETF 联接 Y			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,634,870.24	4,624,405.47	6,259,275.71
本期期初	1,634,870.24	4,624,405.47	6,259,275.71
本期利润	3,479,553.18	2,882,212.86	6,361,766.04
本期基金份额交易产生的变动数	897,401.77	1,746,686.06	2,644,087.83
其中：基金申购款	1,876,431.87	3,357,557.67	5,233,989.54
基金赎回款	-979,030.10	-1,610,871.61	-2,589,901.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,011,825.19	9,253,304.39	15,265,129.58

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	209,703.63
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	245,232.95
其他	34,968.20
合计	489,904.78

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	4,837,788.30
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	4,837,788.30

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	17,027,626.53
减：卖出股票成本总额	12,134,139.87

减：交易费用	55,698.36
买卖股票差价收入	4,837,788.30

6.4.7.12 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	1,346,395,357.75
减：卖出/赎回基金成本总额	1,062,441,313.88
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	8,270,506.13
减：交易费用	73,568.35
基金投资收益	275,609,969.39

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	885,687.01
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	70,504.79
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	956,191.80

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	207,378,000.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	204,929,495.21
减：应计利息总额	2,378,000.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	70,504.79

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股指期货投资收益	1,304,989.06

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,489,515.24
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,489,515.24

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	228,081,605.82
——股票投资	12,847,221.03
——债券投资	-92,002.79
——资产支持证券投资	-
——基金投资	215,326,387.58
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	276,860.00
——权证投资	-
——股指期货投资	276,860.00
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	228,358,465.82

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	651,541.03
基金转换费收入	9,661.58
合计	661,202.61

6.4.7.20 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	15,783.67
合计	102,564.12

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
广发基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东
广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金	本基金是该基金的联接基金

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金，本报告期末及上年度可比期间末无应付关联方佣金余额。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	276,089.46	327,211.89
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,120,423.15	2,610,529.34
应支付基金管理人的净管理费	-844,333.69	-2,283,317.45

注：本基金投资于目标 ETF 部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的目标 ETF 部分后的余额（若为负数，则取零）的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理费＝前一日的基金资产净值扣除本基金持有的目标 ETF 部分后的余额（若为负数，则取零）×约定年费率/当年天数。

约定年费率为 0.15%。

对于基金中基金、ETF 联接基金等特殊类型的基金产品，由于基金管理人不得对基金财产中持有的自身管理的基金部分收取管理费，但客户维护费的收取标准并不调减，可能出现净管理费为负值的情况。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	92,029.80	109,070.67

注：本基金投资于目标 ETF 部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的目标 ETF 部分后的余额（若为负数，则取零）的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日的基金资产净值扣除本基金持有的目标 ETF 部分后的余额（若为负数，则取零）×约定年费率/当年天数。

约定年费率为 0.05%。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	广发中证 A500ETF 联接 A	广发中证 A500ETF 联接 C	广发中证 A500ETF 联接 Y	合计
广发基金管理有限公司	-	350,648.47	-	350,648.47

司				
中国银行股份有限公司	-	273,406.27	-	273,406.27
广发证券股份有限公司	-	15,913.29	-	15,913.29
合计	-	639,968.03	-	639,968.03
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	广发中证A500ETF 联接A	广发中证A500ETF 联接C	广发中证A500ETF 联接Y	合计
广发基金管理有限公司	-	171,787.28	-	171,787.28
中国银行股份有限公司	-	1,453,994.86	-	1,453,994.86
广发证券股份有限公司	-	84,121.05	-	84,121.05
合计	-	1,709,903.19	-	1,709,903.19

注：本基金 A 类基金份额、Y 类基金份额不收取销售服务费。C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：
日销售服务费＝前一日 C 类基金份额资产净值×约定年费率/当年天数。

C 类基金份额的约定年费率为 0.20%。
如涉及费率优惠，相关费率优惠安排以本基金管理人发布的最新公告为准。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无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。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2026年1月1日至2026年6月30日			2025年1月1日至2025年6月30日		
	广发中证 A500ETF联接 A	广发中证 A500ETF联接 C	广发中证 A500ETF联接 Y	广发中证 A500ETF联接 A	广发中证 A500ETF联接 C	广发中证 A500ETF联接 Y
报告期初持有的基 金份额	33,190,671. 67	-	-	-	-	-
报告期间申购/买入 总份额	-	-	-	-	-	-
报告期间因拆分变 动份额	-	-	-	-	-	-
减：报告期间赎回/ 卖出总份额	-	-	-	-	-	-
报告期末持有的基 金份额	33,190,671. 67	-	-	-	-	-
报告期末持有的基 金份额占基金总份 额比例	1.53%	-	-	-	-	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

广发中证 A500ETF 联接 A

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

广发中证 A500ETF 联接 C

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

广发中证 A500ETF 联接 Y

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2026年1月1日至2026年6月30日		2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	77,387,740.2 2	209,703.63	149,548,114. 13	243,322.47

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末持有 2,901,398,331.00 份目标 ETF 基金广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金份额（2025 年 12 月 31 日：3,567,574,940.00 份），占其总份额的比例为 40.90%（2025 年 12 月 31 日：19.63%）。

本基金本报告期末持有 74,600 股基金托管人中国银行股份有限公司的 A 股普通股，成本总额为人民币 406,376.17 元，估值总额为人民币 426,712.00 元，占本基金资产净值的比例为 0.01%（本基金上年度末未持有基金托管人中国银行股份有限公司的 A 股普通股）。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001248	华润新能源	2026-06-24	6 个月	新股流通受限	10.11	10.11	58,873.00	595,206.03	595,206.03	-
301666	大普微-UW	2026-04-08	6 个月	新股流通受限	46.08	463.33	1,220.00	56,217.60	565,262.60	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	2,391.00	47,054.88	338,302.59	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6 个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	163.00	13,346.44	258,245.79	-
001248	华润新能源	2026-06-24	1 个月内（含）	新股流通受限	10.11	10.11	25,231.00	255,085.41	255,085.41	-
001399	惠科股份	2026-06-16	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	6,488.00	65,658.56	179,912.24	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	207.00	9,223.92	97,014.69	-
688635	长进光子	2026-05-20	6 个月	新股流通	40.98	308.19	128.00	5,245.44	39,448.32	-

				受限						
603459	红板科技	2026-03-31	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	330.00	5,841.00	27,825.60	-
001365	天海电子	2026-05-11	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	719.00	19,549.61	22,511.89	-
688811	有研新材	2026-04-01	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	834.00	5,345.94	20,124.42	-
301696	三瑞智能	2026-03-31	6 个月	新股流通受限	24.68	86.80	216.00	5,330.88	18,748.80	-
001237	惠康科技	2026-05-15	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	285.00	15,179.10	16,740.90	-
301669	高特电子	2026-06-02	6 个月	新股流通受限	7.08	28.40	546.00	3,865.68	15,506.40	-
001393	维通利	2026-05-08	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	387.00	11,757.06	15,089.13	-
301531	春光集团	2026-04-28	6 个月	新股流通受限	13.30	51.56	290.00	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026-04-22	6 个月	新股流通受限	13.91	32.47	433.00	6,023.03	14,059.51	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6 个月	新股流通受限	26.66	50.96	138.00	3,679.08	7,032.48	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	72.00	2,411.28	2,442.96	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	134.00	2,462.92	2,248.52	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
111025	圣泉转债	2026-06-26	1 个月内	新债流通	100.00	100.00	110.00	11,000.00	11,000.14	-

			(含)	受限						
113704	春风转债	2026-06-11	1 个月内(含)	新债流通受限	100.00	100.00	70.00	7,000.00	7,000.32	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股等，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限权证。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项停牌	879.53	2026-07-13	890.99	843.00	308,878.01	741,443.79	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 17,757,428.15 元，于 2026 年 7 月 14 日、2026 年 7 月 23 日先后到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，建立了由董事会及其下设的合规及风险管理委员会、经营管理层及其下设的风险控制委员会、风险管理职能部门、各业务部门四个层级构成的风险管理组织架构。在职责分工中，董事会及其下设的合规及风险管理委员会负责制定风险管理的宏观政策，

审议通过风险控制的总体措施等；经营管理层及其下设的风险控制委员会负责讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；各业务部门、风险管理职能部门以及合规稽核部下设的稽核审计组构成公司风险管理三道防线，共同发挥事前识别与防范、事中监测与控制、事后监督与评价功能，通过相互协作，分层次、多方面、持续性地监测和管理公司面临的各类风险。

6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成损失的风险。为了防范信用风险，本基金管理人建立了内部信用评级制度与交易对手库，对证券发行人的信用等级进行评估与控制，并分散化投资，对交易对手的资信情况进行充分评估。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小；银行间同业市场主要通过对交易对手进行风险评估防范相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	152,119,653.37	207,286,789.04
合计	152,119,653.37	207,286,789.04

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为期限在一年以内的国债、政策性金融债、央行票据、超短期融资券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	18,000.46	-
未评级	-	-
合计	18,000.46	-

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为期限在一年以上的国债、政策性金融债、央行票据、未有第三方机构评级的中期票据和公司债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易不活跃，基金资产无法以适当价格及时变现的风险或基金无法应付基

金赎回支付的要求所引起的风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，基金管理人根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，具体计算与分析各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控和防范。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，对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，通过独立的风险管理部门对投资组合的流动性风险进行评估与监测。

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回需求相匹配。本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具，基金管理人持续监测本基金持有资产的流动性水平。本期末，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分投资标的为具有良好流动性的金融工具。同时，基金管理人持续监测本基金开放期内投资者的申购赎回情况，保持基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的重大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金管理人通过久期、凸性等方法来评估投资组合面临的利率风险，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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	-------	-------	-------	-----	----

2026 年 6 月 30 日					
资产					
货币资金	77,387,740.22	-	-	-	77,387,740.22
结算备付金	34,291,865.28	-	-	-	34,291,865.28
存出保证金	5,088,975.86	-	-	-	5,088,975.86
交易性金融资产	152,137,653.83	-	-	4,066,372,447.23	4,218,510,101.06
应收申购款	-	-	-	17,692,681.03	17,692,681.03
资产总计	268,906,235.19	-	-	4,084,065,128.26	4,352,971,363.45
负债					
卖出回购金融资产款	17,757,428.15	-	-	-	17,757,428.15
应付赎回款	-	-	-	36,550,923.85	36,550,923.85
应付管理人报酬	-	-	-	49,461.14	49,461.14
应付托管费	-	-	-	16,487.03	16,487.03
应付销售服务费	-	-	-	219,460.51	219,460.51
应交税费	-	-	-	1,181,844.80	1,181,844.80
其他负债	-	-	-	109,045.21	109,045.21
负债总计	17,757,428.15	-	-	38,127,222.54	55,884,650.69
利率敏感度缺口	251,148,807.04	-	-	4,045,937,905.72	4,297,086,712.76
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	151,456,790.30	-	-	-	151,456,790.30
结算备付金	36,698,136.04	-	-	-	36,698,136.04
存出保证金	2,861,706.72	-	-	-	2,861,706.72
交易性金融资产	207,286,789.04	-	-	4,245,110,955.57	4,452,397,744.61
应收清算款	-	-	-	100,009,831.43	100,009,831.43
应收申购款	-	-	-	357,279,547.46	357,279,547.46
资产总计	398,303,422.10	-	-	4,702,400,334.46	5,100,703,756.61

					56
负债					
卖出回购金融资产款	8,004,772.56	-	-	-	8,004,772.56
应付赎回款	-	-	-	641,784,420.06	641,784,420.06
应付管理人报酬	-	-	-	33,651.27	33,651.27
应付托管费	-	-	-	11,217.11	11,217.11
应付销售服务费	-	-	-	177,948.76	177,948.76
应交税费	-	-	-	816,146.75	816,146.75
其他负债	-	-	-	180,384.17	180,384.17
负债总计	8,004,772.56	-	-	643,003,768.12	651,008,540.68
利率敏感度缺口	390,298,649.54	-	-	4,059,396,566.34	4,449,695,215.88

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-118,949.39	-21,296.52
	市场利率下降 25 个基点	119,164.27	21,300.92

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，以及标准差、跟踪误差、beta 值等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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	175,597,285.36	4.09	53,534.46	0.00
交易性金融资产—基金投资	3,890,775,161.87	90.54	4,245,057,421.11	95.40
交易性金融资产—债券投资	18,000.46	0.00	-	-
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	4,066,390,447.69	94.63	4,245,110,955.57	95.40

注：其他包含在期货交易所的期货投资（附注“衍生金融资产/负债”）。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额列示，为人民币零元。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	上升 5%	209,840,232.74	214,626,276.44
	下降 5%	-209,840,232.74	-214,626,276.44

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末
---------------	-----

	2026 年 6 月 30 日
第一层次	4,063,125,242.76
第二层次	153,729,389.06
第三层次	1,655,469.24
合计	4,218,510,101.06

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关金融工具的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	175,597,285.36	4.03
	其中：股票	175,597,285.36	4.03
2	基金投资	3,890,775,161.87	89.38
3	固定收益投资	152,137,653.83	3.50
	其中：债券	152,137,653.83	3.50
	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	111,679,605.50	2.57
8	其他各项资产	22,781,656.89	0.52
9	合计	4,352,971,363.45	100.00

7.2 期末投资目标基金明细

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	广发中证 A500 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	3,890,775,161.87	90.54

7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.3.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	547,105.00	0.01
B	采矿业	7,109,092.00	0.17
C	制造业	124,200,942.06	2.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,615,509.44	0.11
E	建筑业	2,108,003.00	0.05
F	批发和零售业	1,330,094.00	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	3,851,942.00	0.09
H	住宿和餐饮业	81,396.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,568,587.66	0.22
J	金融业	16,757,381.00	0.39
K	房地产业	965,120.00	0.02
L	租赁和商务服务业	1,249,978.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	2,070,065.00	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	299,010.20	0.01

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	57,600.00	0.00
Q	卫生和社会工作	340,303.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	133,035.00	0.00
S	综合	312,122.00	0.01
	合计	175,597,285.36	4.09

7.3.2 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。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	5,900	7,493,000.00	0.17
2	300750	宁德时代	13,770	5,411,747.70	0.13
3	300502	新易盛	7,260	4,406,820.00	0.10
4	600519	贵州茅台	3,300	3,912,117.00	0.09
5	603986	兆易创新	3,500	2,852,500.00	0.07
6	601318	中国平安	55,500	2,649,570.00	0.06
7	688256	寒武纪	1,569	2,503,417.95	0.06
8	600036	招商银行	64,500	2,289,750.00	0.05
9	601899	紫金矿业	85,800	2,157,012.00	0.05
10	002371	北方华创	2,300	2,034,488.00	0.05
11	000333	美的集团	25,340	1,913,930.20	0.04
12	002475	立讯精密	26,600	1,872,640.00	0.04
13	688008	澜起科技	5,968	1,849,483.20	0.04
14	688012	中微公司	3,902	1,828,087.00	0.04
15	688041	海光信息	4,840	1,792,252.00	0.04
16	002384	东山精密	6,700	1,757,745.00	0.04
17	600900	长江电力	63,700	1,686,139.00	0.04
18	688981	中芯国际	10,410	1,653,316.20	0.04
19	000725	京东方 A	189,300	1,643,124.00	0.04
20	603259	药明康德	12,900	1,606,179.00	0.04
21	600030	中信证券	50,900	1,462,357.00	0.03
22	601166	兴业银行	88,200	1,460,592.00	0.03
23	300059	东方财富	65,900	1,343,042.00	0.03
24	600183	生益科技	7,500	1,300,500.00	0.03
25	600276	恒瑞医药	23,300	1,212,532.00	0.03

26	300274	阳光电源	7,600	1,208,552.00	0.03
27	601398	工商银行	168,500	1,191,295.00	0.03
28	300408	三环集团	7,000	1,168,300.00	0.03
29	002594	比亚迪	14,200	1,131,740.00	0.03
30	600487	亨通光电	10,300	1,126,202.00	0.03
31	300476	胜宏科技	3,200	1,108,576.00	0.03
32	002463	沪电股份	7,100	1,084,880.00	0.03
33	601211	国泰海通	58,900	1,071,980.00	0.02
34	300394	天孚通信	3,500	1,059,380.00	0.02
35	000988	华工科技	5,300	978,433.00	0.02
36	688498	源杰科技	518	976,948.00	0.02
37	688525	佰维存储	1,963	971,154.99	0.02
38	600176	中国巨石	12,600	918,288.00	0.02
39	301308	江波龙	1,300	914,940.00	0.02
40	601288	农业银行	149,600	908,072.00	0.02
41	601328	交通银行	138,900	893,127.00	0.02
42	000651	格力电器	23,400	877,500.00	0.02
43	600522	中天科技	14,300	867,724.00	0.02
44	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.02
45	603019	中科曙光	7,700	825,671.00	0.02
46	300604	长川科技	2,400	819,408.00	0.02
47	688521	芯原股份	2,189	812,425.46	0.02
48	603993	洛阳钼业	45,500	798,525.00	0.02
49	600150	中国船舶	23,600	797,444.00	0.02
50	600887	伊利股份	33,000	790,680.00	0.02
51	600584	长电科技	7,500	776,625.00	0.02
52	000338	潍柴动力	28,000	763,000.00	0.02
53	000858	五粮液	10,200	754,800.00	0.02
54	688072	拓荆科技	843	741,443.79	0.02
55	688347	华虹宏力	2,122	713,628.60	0.02
56	601816	京沪高铁	152,900	692,637.00	0.02
57	600309	万华化学	9,800	670,418.00	0.02
58	002281	光迅科技	2,600	668,044.00	0.02
59	688120	华海清科	2,060	663,690.80	0.02
60	300124	汇川技术	9,900	656,667.00	0.02
61	002415	海康威视	19,100	653,220.00	0.02
62	002916	深南电路	1,426	652,965.40	0.02
63	002008	大族激光	4,300	645,473.00	0.02
64	600111	北方稀土	13,200	634,260.00	0.01
65	000100	TCL 科技	108,300	630,306.00	0.01
66	300136	信维通信	5,100	608,175.00	0.01
67	000063	中兴通讯	16,800	607,992.00	0.01
68	600000	浦发银行	69,400	597,534.00	0.01
69	600089	特变电工	26,400	594,000.00	0.01

70	601857	中国石油	67,400	585,032.00	0.01
71	300857	协创数据	1,700	577,830.00	0.01
72	002028	思源电气	3,300	570,900.00	0.01
73	301666	大普微-UW	1,220	565,262.60	0.01
74	601088	中国神华	14,300	558,272.00	0.01
75	300433	蓝思科技	10,400	558,064.00	0.01
76	600031	三一重工	30,900	533,952.00	0.01
77	300014	亿纬锂能	7,900	513,737.00	0.01
78	002050	三花智控	11,700	512,811.00	0.01
79	601601	中国太保	17,900	510,508.00	0.01
80	300475	香农芯创	1,700	510,000.00	0.01
81	000001	平安银行	50,600	508,530.00	0.01
82	002714	牧原股份	14,300	500,357.00	0.01
83	000792	盐湖股份	16,550	499,644.50	0.01
84	300223	北京君正	2,000	497,800.00	0.01
85	600549	厦门钨业	5,800	494,160.00	0.01
86	002353	杰瑞股份	3,200	488,000.00	0.01
87	002156	通富微电	6,400	485,568.00	0.01
88	600406	国电南瑞	21,000	479,850.00	0.01
89	601668	中国建筑	107,600	466,984.00	0.01
90	002436	兴森科技	8,900	453,455.00	0.01
91	000657	中钨高新	4,700	449,884.00	0.01
92	300760	迈瑞医疗	3,200	434,656.00	0.01
93	601919	中远海控	32,700	433,602.00	0.01
94	002602	世纪华通	30,600	431,460.00	0.01
95	603501	豪威集团	4,500	426,825.00	0.01
96	601988	中国银行	74,600	426,712.00	0.01
97	300054	鼎龙股份	4,000	423,880.00	0.01
98	600660	福耀玻璃	8,400	423,696.00	0.01
99	601728	中国电信	80,900	419,871.00	0.01
100	601012	隆基绿能	31,600	414,592.00	0.01
101	002230	科大讯飞	10,100	412,484.00	0.01
102	601225	陕西煤业	20,200	411,070.00	0.01
103	688777	中控技术	3,493	410,427.50	0.01
104	600941	中国移动	4,700	404,811.00	0.01
105	600690	海尔智家	19,600	400,036.00	0.01
106	300033	同花顺	1,640	395,240.00	0.01
107	002352	顺丰控股	12,500	390,750.00	0.01
108	002938	鹏鼎控股	3,700	389,906.00	0.01
109	601985	中国核电	42,900	387,387.00	0.01
110	603799	华友钴业	8,000	386,080.00	0.01
111	002460	赣锋锂业	5,900	385,860.00	0.01
112	002709	天赐材料	7,500	385,725.00	0.01
113	000977	浪潮信息	5,400	378,000.00	0.01

114	600160	巨化股份	7,100	376,371.00	0.01
115	300757	罗博特科	600	371,400.00	0.01
116	002851	麦格米特	2,200	367,796.00	0.01
117	300442	润泽科技	4,300	357,201.00	0.01
118	000425	徐工机械	42,700	345,443.00	0.01
119	000938	紫光股份	11,900	343,434.00	0.01
120	688126	沪硅产业	8,604	343,213.56	0.01
121	002202	金风科技	14,300	341,770.00	0.01
122	601600	中国铝业	41,300	339,486.00	0.01
123	600938	中国海油	12,500	339,375.00	0.01
124	600028	中国石化	75,900	338,514.00	0.01
125	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.01
126	300346	南大光电	3,600	333,540.00	0.01
127	600460	士兰微	6,100	333,426.00	0.01
128	002466	天齐锂业	5,400	331,128.00	0.01
129	300661	圣邦股份	2,300	330,004.00	0.01
130	601766	中国中车	63,400	329,680.00	0.01
131	002600	领益智造	19,000	329,460.00	0.01
132	600050	中国联通	81,400	325,600.00	0.01
133	002837	英维克	4,060	323,013.60	0.01
134	002049	紫光国微	3,600	319,500.00	0.01
135	300567	精测电子	1,000	317,600.00	0.01
136	002407	多氟多	6,200	311,426.00	0.01
137	002185	华天科技	13,900	310,109.00	0.01
138	601628	中国人寿	8,700	307,545.00	0.01
139	002179	中航光电	6,650	307,230.00	0.01
140	002138	顺络电子	4,200	307,020.00	0.01
141	002080	中材科技	3,400	306,000.00	0.01
142	000568	泸州老窖	3,900	302,328.00	0.01
143	601100	恒立液压	2,800	301,168.00	0.01
144	601872	招商轮船	16,900	296,933.00	0.01
145	300395	菲利华	2,200	294,206.00	0.01
146	600879	航天电子	13,800	293,802.00	0.01
147	002241	歌尔股份	13,000	292,890.00	0.01
148	300390	天华新能	3,100	289,881.00	0.01
149	603288	海天味业	8,700	288,492.00	0.01
150	601006	大秦铁路	62,100	286,281.00	0.01
151	688002	睿创微纳	1,842	284,938.98	0.01
152	688396	华润微	2,918	284,650.90	0.01
153	605117	德业股份	2,677	284,243.86	0.01
154	000408	藏格矿业	4,100	284,212.00	0.01
155	601658	邮储银行	57,500	283,475.00	0.01
156	688469	芯联集成-U	26,179	277,759.19	0.01
157	600905	三峡能源	74,500	276,395.00	0.01

158	688271	联影医疗	2,729	276,256.67	0.01
159	600489	中金黄金	15,200	274,360.00	0.01
160	601888	中国中免	5,100	273,921.00	0.01
161	002625	光启技术	8,900	269,848.00	0.01
162	600893	航发动力	7,000	268,380.00	0.01
163	688017	绿的谐波	642	268,266.12	0.01
164	000630	铜陵有色	41,900	266,484.00	0.01
165	600673	东阳光	7,900	265,282.00	0.01
166	601127	赛力斯	4,300	263,375.00	0.01
167	600010	包钢股份	117,800	262,694.00	0.01
168	300037	新宙邦	2,800	259,980.00	0.01
169	601689	拓普集团	4,600	259,532.00	0.01
170	002273	水晶光电	7,300	259,004.00	0.01
171	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.01
172	300058	蓝色光标	18,700	257,312.00	0.01
173	002027	分众传媒	52,700	255,068.00	0.01
174	600118	中国卫星	3,100	254,355.00	0.01
175	300751	迈为股份	900	254,214.00	0.01
176	600019	宝钢股份	45,400	246,522.00	0.01
177	688111	金山办公	1,155	246,072.75	0.01
178	000426	兴业银锡	7,400	243,904.00	0.01
179	600760	中航沈飞	5,900	242,490.00	0.01
180	000807	云铝股份	10,900	241,326.00	0.01
181	600362	江西铜业	5,500	238,150.00	0.01
182	300450	先导智能	5,804	236,338.88	0.01
183	601168	西部矿业	8,700	236,118.00	0.01
184	600104	上汽集团	24,000	234,240.00	0.01
185	600989	宝丰能源	11,500	233,795.00	0.01
186	601727	上海电气	32,900	230,300.00	0.01
187	600988	赤峰黄金	8,700	228,984.00	0.01
188	605589	圣泉集团	3,600	228,852.00	0.01
189	002001	新和成	8,028	228,155.76	0.01
190	600875	东方电气	7,900	227,283.00	0.01
191	688099	晶晨股份	2,204	226,791.60	0.01
192	600667	太极实业	7,700	224,686.00	0.01
193	600885	宏发股份	6,500	224,185.00	0.01
194	002738	中矿资源	3,800	224,162.00	0.01
195	002422	科伦药业	5,800	223,416.00	0.01
196	601390	中国中铁	53,400	222,678.00	0.01
197	000538	云南白药	4,700	222,639.00	0.01
198	000960	锡业股份	5,200	221,988.00	0.01
199	600547	山东黄金	9,500	219,355.00	0.01
200	002126	银轮股份	4,400	219,120.00	0.01
201	600392	盛和资源	7,300	217,321.00	0.01

202	600795	国电电力	46,500	217,155.00	0.01
203	000831	中国稀土	3,900	216,411.00	0.01
204	600418	江淮汽车	8,300	214,389.00	0.00
205	600585	海螺水泥	12,500	211,875.00	0.00
206	300316	晶盛机电	3,500	211,400.00	0.00
207	601669	中国电建	44,900	211,030.00	0.00
208	002812	恩捷股份	3,100	207,421.00	0.00
209	002648	卫星化学	8,800	206,712.00	0.00
210	600141	兴发集团	4,400	206,668.00	0.00
211	600096	云天化	6,700	203,680.00	0.00
212	002129	TCL 中环	16,900	203,138.00	0.00
213	300015	爱尔眼科	24,300	200,718.00	0.00
214	601179	中国西电	13,400	199,928.00	0.00
215	301358	湖南裕能	2,600	197,262.00	0.00
216	300782	卓胜微	1,800	197,244.00	0.00
217	600482	中国动力	6,000	196,800.00	0.00
218	600346	恒力石化	11,000	194,810.00	0.00
219	601868	中国能建	72,900	194,643.00	0.00
220	002195	岩山科技	29,600	193,584.00	0.00
221	002558	巨人网络	7,000	192,920.00	0.00
222	000066	中国长城	10,100	192,405.00	0.00
223	600497	驰宏锌锗	15,800	191,338.00	0.00
224	300418	昆仑万维	4,700	189,692.00	0.00
225	600580	卧龙电驱	5,700	188,670.00	0.00
226	688036	传音控股	3,185	187,755.75	0.00
227	600066	宇通客车	7,000	187,670.00	0.00
228	600426	华鲁恒升	7,800	186,576.00	0.00
229	000625	长安汽车	25,900	185,703.00	0.00
230	600157	永泰能源	113,600	182,896.00	0.00
231	000157	中联重科	25,900	180,523.00	0.00
232	600221	海航控股	133,700	180,495.00	0.00
233	002532	天山铝业	16,800	180,264.00	0.00
234	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.00
235	600895	张江高科	4,800	178,800.00	0.00
236	002821	凯莱英	1,100	178,200.00	0.00
237	605499	东鹏饮料	1,430	176,504.90	0.00
238	002340	格林美	26,600	175,826.00	0.00
239	600711	盛屯矿业	16,000	175,520.00	0.00
240	600436	片仔癀	1,600	174,848.00	0.00
241	600011	华能国际	23,000	174,570.00	0.00
242	300803	指南针	1,900	174,173.00	0.00
243	000933	神火股份	8,200	173,840.00	0.00
244	600048	保利发展	37,400	173,162.00	0.00
245	600143	金发科技	11,200	173,040.00	0.00

246	600438	通威股份	14,100	170,751.00	0.00
247	002236	大华股份	10,300	169,847.00	0.00
248	600115	中国东航	44,400	169,164.00	0.00
249	300017	网宿科技	13,000	169,130.00	0.00
250	002493	荣盛石化	15,700	168,775.00	0.00
251	600886	国投电力	12,600	167,706.00	0.00
252	002131	利欧股份	35,300	167,675.00	0.00
253	600570	恒生电子	7,900	167,401.00	0.00
254	002456	欧菲光	17,500	165,550.00	0.00
255	600352	浙江龙盛	13,600	164,696.00	0.00
256	601233	桐昆股份	7,500	162,375.00	0.00
257	603659	璞泰来	5,600	162,008.00	0.00
258	300339	润和软件	4,200	161,742.00	0.00
259	003816	中国广核	41,000	160,310.00	0.00
260	601360	三六零	18,300	159,027.00	0.00
261	000301	东方盛虹	13,800	158,010.00	0.00
262	601058	赛轮轮胎	13,700	157,961.00	0.00
263	688122	西部超导	2,507	157,464.67	0.00
264	300438	鹏辉能源	1,900	157,415.00	0.00
265	002074	国轩高科	5,700	156,807.00	0.00
266	300759	康龙化成	5,400	156,222.00	0.00
267	600026	中远海能	8,700	156,078.00	0.00
268	000768	中航西飞	7,600	155,648.00	0.00
269	688047	龙芯中科	1,005	155,443.35	0.00
270	688235	百济神州	603	153,529.83	0.00
271	002555	三七互娱	8,100	152,847.00	0.00
272	688213	思特威-W	1,410	150,968.70	0.00
273	600196	复星医药	6,700	150,549.00	0.00
274	600009	上海机场	6,500	150,150.00	0.00
275	002472	双环传动	3,600	149,436.00	0.00
276	000975	山金国际	8,700	147,900.00	0.00
277	300001	特锐德	3,900	147,537.00	0.00
278	688578	艾力斯	1,347	147,092.40	0.00
279	601111	中国国航	24,200	146,410.00	0.00
280	300207	欣旺达	7,700	146,223.00	0.00
281	300458	全志科技	3,700	146,002.00	0.00
282	600029	南方航空	28,100	145,558.00	0.00
283	600415	小商品城	14,300	145,288.00	0.00
284	002517	恺英网络	8,900	144,625.00	0.00
285	600674	川投能源	10,200	144,534.00	0.00
286	002595	豪迈科技	3,090	143,994.00	0.00
287	002601	龙佰集团	8,700	143,376.00	0.00
288	600219	南山铝业	35,900	143,241.00	0.00
289	601186	中国铁建	24,000	142,800.00	0.00

290	600233	圆通速递	9,000	141,750.00	0.00
291	002128	电投能源	6,100	141,032.00	0.00
292	601877	正泰电器	5,600	140,392.00	0.00
293	601117	中国化学	19,100	140,385.00	0.00
294	301236	软通动力	3,300	140,085.00	0.00
295	300115	长盈精密	4,900	136,906.00	0.00
296	600372	中航机载	12,600	136,710.00	0.00
297	002155	湖南黄金	5,700	136,059.00	0.00
298	600839	四川长虹	19,300	134,714.00	0.00
299	300568	星源材质	7,100	132,912.00	0.00
300	002465	海格通信	10,400	132,808.00	0.00
301	002920	德赛西威	1,600	130,400.00	0.00
302	300347	泰格医药	2,700	129,600.00	0.00
303	000963	华东医药	4,600	129,352.00	0.00
304	600741	华域汽车	8,300	128,816.00	0.00
305	000547	航天发展	6,700	128,305.00	0.00
306	603129	春风动力	500	127,900.00	0.00
307	300024	机器人	6,600	127,578.00	0.00
308	603650	彤程新材	1,300	127,374.00	0.00
309	688506	百利天恒	433	127,314.99	0.00
310	002130	沃尔核材	6,600	125,136.00	0.00
311	300454	深信服	1,300	125,060.00	0.00
312	002497	雅化集团	6,100	124,257.00	0.00
313	300496	中科创达	2,000	123,580.00	0.00
314	300012	华测检测	8,800	121,968.00	0.00
315	688676	金盘科技	1,436	121,543.04	0.00
316	300474	景嘉微	2,000	120,960.00	0.00
317	001979	招商蛇口	18,800	120,884.00	0.00
318	000878	云南铜业	7,600	120,688.00	0.00
319	688331	荣昌生物	926	120,620.76	0.00
320	002432	九安医疗	1,700	120,156.00	0.00
321	000733	振华科技	2,100	118,944.00	0.00
322	002271	东方雨虹	10,000	118,700.00	0.00
323	601021	春秋航空	2,600	118,508.00	0.00
324	300083	创世纪	8,700	118,494.00	0.00
325	002444	巨星科技	3,800	118,180.00	0.00
326	603979	金诚信	2,000	118,060.00	0.00
327	002414	高德红外	8,900	118,014.00	0.00
328	000034	神州数码	4,240	117,660.00	0.00
329	300763	锦浪科技	1,300	117,455.00	0.00
330	300866	安克创新	1,100	114,950.00	0.00
331	002025	航天电器	1,500	114,330.00	0.00
332	002756	永兴材料	2,000	113,280.00	0.00
333	000661	长春高新	1,700	113,220.00	0.00

334	601319	中国人保	16,700	112,892.00	0.00
335	300748	金力永磁	3,600	111,060.00	0.00
336	300073	当升科技	2,300	110,492.00	0.00
337	600699	均胜电子	5,100	110,211.00	0.00
338	601615	明阳智能	9,500	109,915.00	0.00
339	002078	太阳纸业	8,800	109,912.00	0.00
340	603606	东方电缆	2,640	109,586.40	0.00
341	300919	中伟新材	2,500	109,375.00	0.00
342	300142	沃森生物	8,400	109,116.00	0.00
343	000423	东阿阿胶	2,400	108,864.00	0.00
344	601677	明泰铝业	6,500	107,900.00	0.00
345	603087	甘李药业	1,900	107,844.00	0.00
346	688266	泽璟制药-U	921	107,443.86	0.00
347	300432	富临精工	5,300	106,477.00	0.00
348	600039	四川路桥	13,600	106,352.00	0.00
349	601800	中国交建	18,600	106,206.00	0.00
350	300724	捷佳伟创	1,500	105,900.00	0.00
351	000002	万科 A	35,500	105,080.00	0.00
352	002252	上海莱士	24,100	104,594.00	0.00
353	688608	恒玄科技	622	103,992.18	0.00
354	600226	亨通股份	10,800	103,572.00	0.00
355	688599	天合光能	7,321	103,372.52	0.00
356	688223	晶科能源	21,389	101,597.75	0.00
357	688180	君实生物-U	2,980	100,783.60	0.00
358	002064	华峰化学	10,400	98,696.00	0.00
359	688169	石头科技	1,035	98,293.95	0.00
360	600588	用友网络	10,700	98,226.00	0.00
361	601633	长城汽车	6,500	98,085.00	0.00
362	001965	招商公路	10,700	98,012.00	0.00
363	000786	北新建材	5,400	97,686.00	0.00
364	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
365	002294	信立泰	3,000	95,670.00	0.00
366	302132	中航成飞	1,600	93,312.00	0.00
367	000519	中兵红箭	4,400	92,708.00	0.00
368	002831	裕同科技	2,600	92,456.00	0.00
369	603806	福斯特	5,500	92,345.00	0.00
370	688390	固德威	846	91,799.46	0.00
371	603260	合盛硅业	1,900	91,694.00	0.00
372	600177	雅戈尔	12,100	91,113.00	0.00
373	601607	上海医药	5,900	90,860.00	0.00
374	688188	柏楚电子	851	90,801.70	0.00
375	601618	中国中冶	37,200	90,768.00	0.00
376	600516	方大炭素	14,700	90,699.00	0.00
377	300677	英科医疗	2,300	90,091.00	0.00

378	002176	江特电机	8,900	89,089.00	0.00
379	300699	光威复材	3,100	88,815.00	0.00
380	000623	吉林敖东	5,000	88,650.00	0.00
381	300832	新产业	2,100	88,200.00	0.00
382	000617	中油资本	13,200	86,988.00	0.00
383	300972	万辰集团	500	86,705.00	0.00
384	002085	万丰奥威	7,800	86,502.00	0.00
385	688065	凯赛生物	1,803	86,273.55	0.00
386	002318	久立特材	3,600	86,040.00	0.00
387	300251	光线传媒	7,700	85,393.00	0.00
388	300558	贝达药业	1,300	84,591.00	0.00
389	002459	晶澳科技	10,400	84,240.00	0.00
390	002065	东华软件	11,700	83,538.00	0.00
391	600085	同仁堂	3,600	83,196.00	0.00
392	600499	科达制造	6,000	82,800.00	0.00
393	002266	浙富控股	16,300	82,478.00	0.00
394	000400	许继电气	3,800	82,460.00	0.00
395	002223	鱼跃医疗	3,200	82,112.00	0.00
396	603596	伯特利	3,304	82,071.36	0.00
397	688472	阿特斯	7,580	82,015.60	0.00
398	002044	美年健康	16,300	81,989.00	0.00
399	605090	九丰能源	2,200	81,774.00	0.00
400	600515	海南机场	29,800	81,652.00	0.00
401	300003	乐普医疗	6,800	80,580.00	0.00
402	688617	惠泰医疗	443	80,431.08	0.00
403	002405	四维图新	12,400	80,228.00	0.00
404	300342	天银机电	1,700	79,900.00	0.00
405	000032	深桑达 A	3,200	79,840.00	0.00
406	688005	容百科技	2,609	79,835.40	0.00
407	300409	道氏技术	4,000	79,720.00	0.00
408	600862	中航高科	4,400	79,332.00	0.00
409	600521	华海药业	5,500	79,200.00	0.00
410	000999	华润三九	3,500	78,715.00	0.00
411	000415	渤海租赁	19,300	78,551.00	0.00
412	601216	君正集团	17,600	78,496.00	0.00
413	000683	博源化工	13,600	78,336.00	0.00
414	000039	中集集团	9,612	77,953.32	0.00
415	603605	珀莱雅	1,300	77,896.00	0.00
416	600803	新奥股份	4,900	77,420.00	0.00
417	600704	物产中大	16,200	76,464.00	0.00
418	603766	隆鑫通用	6,400	76,352.00	0.00
419	600312	平高电气	4,300	75,938.00	0.00
420	000887	中鼎股份	4,200	75,138.00	0.00
421	600332	白云山	3,700	74,148.00	0.00

422	600018	上港集团	15,700	74,104.00	0.00
423	000967	盈峰环境	7,000	73,710.00	0.00
424	300122	智飞生物	6,300	73,647.00	0.00
425	600765	中航重机	5,700	73,644.00	0.00
426	301550	斯菱智驱	800	73,144.00	0.00
427	688116	天奈科技	1,907	72,847.40	0.00
428	600166	福田汽车	24,800	72,168.00	0.00
429	600153	建发股份	9,100	72,163.00	0.00
430	000830	鲁西化工	6,000	72,000.00	0.00
431	600323	瀚蓝环境	2,600	71,396.00	0.00
432	002410	广联达	8,700	70,992.00	0.00
433	002007	华兰生物	5,800	70,702.00	0.00
434	300896	爱美客	800	69,760.00	0.00
435	603568	伟明环保	4,340	66,749.20	0.00
436	002603	以岭药业	4,400	66,000.00	0.00
437	600486	扬农化工	1,300	65,910.00	0.00
438	600398	海澜之家	12,500	65,375.00	0.00
439	600529	山东药玻	3,500	64,575.00	0.00
440	601000	唐山港	15,500	64,325.00	0.00
441	600316	洪都航空	2,300	64,262.00	0.00
442	688009	中国通号	13,466	64,098.16	0.00
443	000738	航发控制	3,500	64,015.00	0.00
444	002389	航天彩虹	3,600	63,972.00	0.00
445	601018	宁波港	20,300	63,945.00	0.00
446	688114	华大智造	1,251	63,901.08	0.00
447	601799	星宇股份	700	63,434.00	0.00
448	600208	衢州发展	22,200	62,826.00	0.00
449	600008	首创环保	23,000	62,560.00	0.00
450	000932	华菱钢铁	17,900	62,113.00	0.00
451	600998	九州通	13,200	61,908.00	0.00
452	600170	上海建工	27,800	61,716.00	0.00
453	688303	大全能源	3,535	61,615.05	0.00
454	603486	科沃斯	1,200	60,900.00	0.00
455	600161	天坛生物	5,200	60,216.00	0.00
456	600820	隧道股份	11,500	59,915.00	0.00
457	300118	东方日升	4,800	59,760.00	0.00
458	601238	广汽集团	11,600	58,928.00	0.00
459	603816	顾家家居	2,600	58,136.00	0.00
460	603885	吉祥航空	5,600	57,624.00	0.00
461	002607	中公教育	32,000	57,600.00	0.00
462	600763	通策医疗	1,700	57,596.00	0.00
463	603939	益丰药房	3,200	57,536.00	0.00
464	300676	华大基因	1,600	56,096.00	0.00
465	600038	中直股份	2,200	55,638.00	0.00

466	601567	三星电气	3,700	55,278.00	0.00
467	603392	万泰生物	2,000	53,940.00	0.00
468	300573	兴齐眼药	1,305	53,191.80	0.00
469	601880	辽港股份	38,400	52,992.00	0.00
470	600511	国药股份	2,000	52,080.00	0.00
471	600535	天士力	3,900	51,597.00	0.00
472	688166	博瑞医药	1,467	51,359.67	0.00
473	300049	福瑞医科	1,300	50,544.00	0.00
474	600816	建元信托	20,600	50,264.00	0.00
475	002244	滨江集团	6,500	49,400.00	0.00
476	601155	新城控股	4,800	49,248.00	0.00
477	002120	韵达股份	7,600	48,336.00	0.00
478	300144	宋城演艺	8,200	47,642.00	0.00
479	300100	双林股份	1,700	47,226.00	0.00
480	000833	粤桂股份	2,000	46,840.00	0.00
481	000998	隆平高科	6,200	46,748.00	0.00
482	688063	派能科技	852	45,386.04	0.00
483	601866	中远海发	20,400	45,084.00	0.00
484	600064	南京高科	6,300	44,919.00	0.00
485	300457	赢合科技	2,100	44,268.00	0.00
486	002544	普天科技	2,400	43,728.00	0.00
487	600754	锦江酒店	2,400	43,176.00	0.00
488	600635	大众公用	10,000	42,800.00	0.00
489	000035	中国天楹	8,700	42,021.00	0.00
490	600655	豫园股份	10,200	41,922.00	0.00
491	603899	晨光股份	2,000	41,260.00	0.00
492	300601	康泰生物	3,500	39,690.00	0.00
493	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
494	600004	白云机场	5,400	39,204.00	0.00
495	600663	陆家嘴	6,100	38,308.00	0.00
496	600258	首旅酒店	3,500	38,220.00	0.00
497	600859	王府井	4,100	37,638.00	0.00
498	002091	江苏国泰	5,100	36,873.00	0.00
499	300070	碧水源	11,400	36,366.00	0.00
500	000069	华侨城 A	20,900	34,276.00	0.00
501	600864	哈投股份	6,500	33,735.00	0.00
502	301078	孩子王	4,600	31,096.00	0.00
503	002292	奥飞娱乐	4,700	30,832.00	0.00
504	603833	欧派家居	1,000	30,110.00	0.00
505	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
506	002891	中宠股份	1,000	26,720.00	0.00
507	600325	华发股份	11,500	26,565.00	0.00
508	002572	索菲亚	3,100	22,630.00	0.00
509	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00

510	688811	有研新材	834	20,124.42	0.00
511	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
512	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
513	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
514	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
515	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
516	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
517	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
518	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
519	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	5,159,950.00	0.12
2	600519	贵州茅台	4,719,228.35	0.11
3	601318	中国平安	3,980,923.40	0.09
4	300308	中际旭创	3,700,704.00	0.08
5	601899	紫金矿业	3,454,942.00	0.08
6	600036	招商银行	2,733,999.00	0.06
7	300502	新易盛	2,117,255.00	0.05
8	000333	美的集团	2,105,825.00	0.05
9	601166	兴业银行	1,904,361.00	0.04
10	600900	长江电力	1,810,153.00	0.04
11	300059	东方财富	1,670,954.82	0.04
12	002475	立讯精密	1,575,085.00	0.04
13	600276	恒瑞医药	1,549,872.00	0.03
14	600030	中信证券	1,521,569.85	0.03
15	688256	寒武纪	1,485,142.26	0.03
16	002594	比亚迪	1,425,069.00	0.03
17	603259	药明康德	1,404,738.00	0.03
18	688981	中芯国际	1,375,315.11	0.03
19	601398	工商银行	1,369,928.00	0.03
20	300274	阳光电源	1,315,895.00	0.03

注：本项及下项 7.5.2、7.5.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	688820	盛合晶微	1,640,231.24	0.04
2	688808	联讯仪器	1,026,449.59	0.02
3	688797	臻宝科技	780,472.00	0.02
4	688635	长进光子	659,516.00	0.01
5	001399	惠科股份	442,948.00	0.01
6	301666	大普微-UW	399,125.88	0.01
7	300750	宁德时代	358,385.00	0.01
8	600498	烽火通信	282,558.00	0.01
9	301669	高特电子	261,963.07	0.01
10	300285	国瓷材料	245,661.00	0.01
11	601088	中国神华	244,602.00	0.01
12	301531	春光集团	240,739.17	0.01
13	300308	中际旭创	230,662.00	0.01
14	301599	理奇智能	207,792.20	0.00
15	601318	中国平安	206,375.00	0.00
16	002409	雅克科技	205,180.00	0.00
17	301696	三瑞智能	185,470.00	0.00
18	002245	蔚蓝锂芯	183,309.28	0.00
19	603459	红板科技	166,775.00	0.00
20	600256	广汇能源	160,076.00	0.00

7.5.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	174,830,669.74
卖出股票收入（成交）总额	17,027,626.53

7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	152,119,653.37	3.54
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）	18,000.46	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	152,137,653.83	3.54

7.7 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019792.SH	25 国债 19	1,098,000	110,963,037.70	2.58
2	019827.SH	26 国债 01	258,000	25,967,233.48	0.60
3	019785.SH	25 国债 13	150,000	15,189,382.19	0.35
4	111025.SH	圣泉转债	110	11,000.14	0.00
5	113704.SH	春风转债	70	7,000.32	0.00

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.9 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.10 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。

7.11 本基金投资股指期货的投资政策

本基金是 ETF 联接基金，主要投资目标 ETF 基金、标的指数成份股及备选成份股，同时可以投资股指期货。本基金投资股指期货，可以更好地应对申购和赎回，进行流动性管理。本基金尽量选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整带来的交易成本和跟踪误差，力争更好地跟踪标的指数。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局或其派出机构的处罚。

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。

7.13.2 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约定的备选股票库的情况。

7.13.3 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	5,088,975.86
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	17,692,681.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,781,656.89

7.13.4 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。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
广发中证 A500ETF 联接 A	49,812	43,663.64	667,622,604.96	30.70%	1,507,350,737.14	69.30%
广发中证 A500ETF 联接 C	28,033	37,384.28	292,787,495.65	27.94%	755,205,954.01	72.06%
广发中证 A500ETF 联接 Y	6,343	7,643.82	0.00	0.00%	48,484,724.98	100.00%
合计	84,188	38,858.88	960,410,100.61	29.36%	2,311,041,416.13	70.64%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	广发中证 A500ETF 联接 A	4,322,518.68	0.1987%
	广发中证 A500ETF 联接 C	9,849.99	0.0009%
	广发中证 A500ETF 联接 Y	1,354,166.39	2.7930%
	合计	5,686,535.06	0.1738%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	广发中证 A500ETF 联接 A	>100
	广发中证 A500ETF 联接 C	0
	广发中证 A500ETF 联接 Y	0~10

本基金基金经理持有本开放式基金	Y	
	合计	>100
	广发中证 A500ETF 联接 A	0
	广发中证 A500ETF 联接 C	0
	广发中证 A500ETF 联接 Y	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发中证 A500ETF 联接 A	广发中证 A500ETF 联接 C	广发中证 A500ETF 联接 Y
基金合同生效日 (2024 年 11 月 5 日) 基金份额总额	4,637,316,620.90	3,358,942,645.63	-
本报告期期初基金 份额总额	2,595,541,536.36	1,154,808,459.12	35,540,259.75
本报告期基金总申 购份额	1,694,104,780.01	666,840,316.53	23,494,320.85
减：本报告期基金总 赎回份额	2,114,672,974.27	773,655,325.99	10,549,855.62
本报告期基金拆分 变动份额	-	-	-
本报告期期末基金 份额总额	2,174,973,342.10	1,047,993,449.66	48,484,724.98

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2026 年 2 月 14 日发布公告，自 2026 年 2 月 13 日起，傅友兴先生离任公司副总经理。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产的诉讼事项。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金为联接基金，目标基金为广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金。本报告期内，目标基金未发生包括转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同、召开基金份额持有人大会及大会表决意见等重大影响事件。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.7.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.7.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.8 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.8.1 基金租用或者通过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	
中国银河	2	104,027,359.57	54.92%	19,245.04	54.92%	-
国投证券	1	85,386,094.86	45.08%	15,796.17	45.08%	-
东吴证券	1	-	-	-	-	减少 1 个
华创证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	减少 1 个

国信证券	2	-	-	-	-	-
国联民生	3	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
摩根大通证券 (中国)	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	减少 1 个
东方证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
国泰海通	4	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	减少 1 个
国盛证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	3	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
万和证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	4	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	5	-	-	-	-	-
华源证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	3	-	-	-	-	-

注：1、选择标准

- (1) 财务状况良好，经营行为稳健规范，在业内具有良好声誉；
- (2) 内控与合规体系健全，相关制度和流程持续完善，风险控制能力较强；
- (3) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金证券交易需要；
- (4) 具有较强的综合研究能力，有完善的研究报告质量保障机制，能及时提供宏观、行业及市场走向、个股分析报告；
- (5) 具有广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务；

(6) 中国证监会要求的或公司认为应当具备的其他条件。

2、选择流程

(1) 对拟合作券商进行准入评估。本基金管理人根据上述标准对拟合作券商是否符合准入条件进行评估并确定合作券商。

(2) 协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议并通知基金托管人。

10.8.2 基金租用或者通过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
中国银河	151,343,148.00	100.00 %	360,367,000.00	100.00 %	-	-	1,839,228,024.81	100.00 %
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券(中国)	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-

民生 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万 宏源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.9 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	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-01-22
2	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-30
3	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-22

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期无需要披露的单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- （一）中国证监会准予广发中证 A500 指数型证券投资基金注册募集的文件
- （二）《广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》
- （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 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》
- （五）法律意见书

12.2 存放地点

广东省广州市海珠区琶洲大道 168 号星河湾中心 28-38 层；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

12.3 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。

广发基金管理有限公司
二〇二六年八月三十一日