广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

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 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
4 管理人报告 8
4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 15
5 托管人报告 16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 16
6 半年度财务会计报告（未经审计） 16
6.1 资产负债表 16
6.2 利润表 18
6.3 净资产变动表 19
6.4 报表附注 20
7 投资组合报告 41
7.1 期末基金资产组合情况 41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 41
7.3 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 42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 56
7.6 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 56
7.7 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 57
7.8 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 57
7.9 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 57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 57
7.12 投资组合报告附注 57

8 基金份额持有人信息 58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 59
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的情况 59
9 开放式基金份额变动 59
10 重大事件揭示 59
10.1 基金份额持有人大会决议 59
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 59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 59
10.4 基金投资策略的改变 60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 60
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 60
10.7 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 60
10.8 其他重大事件 61
11 影响投资者决策的其他重要信息 61
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 61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 62
12 备查文件目录 62
12.1 备查文件目录 62
12.2 存放地点 63
12.3 查阅方式 63

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
基金简称	广发中证 A500ETF
场内简称	A500 龙头
基金主代码	563800
交易代码	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	7,093,978,099.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2024-11-18

注：本基金的扩位证券简称为“A500ETF 广发”。

2.2 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	姓名	项军	许俊
	联系电话	020-83936666	010-66596688

负责人	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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

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）**
本期已实现收益	2,198,299,089.44
本期利润	1,742,296,065.88
加权平均基金份额本期利润	0.1715
本期加权平均净值利润率	13.76%

本期基金份额净值增长率	12.67%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2026 年 6 月 30 日)**
期末可供分配利润	2,334,447,830.54
期末可供分配基金份额利润	0.3291
期末基金资产净值	9,510,081,307.58
期末基金份额净值	1.3406
3.1.3 累计期末指标	**报告期末(2026 年 6 月 30 日)**
基金份额累计净值增长率	34.06%

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

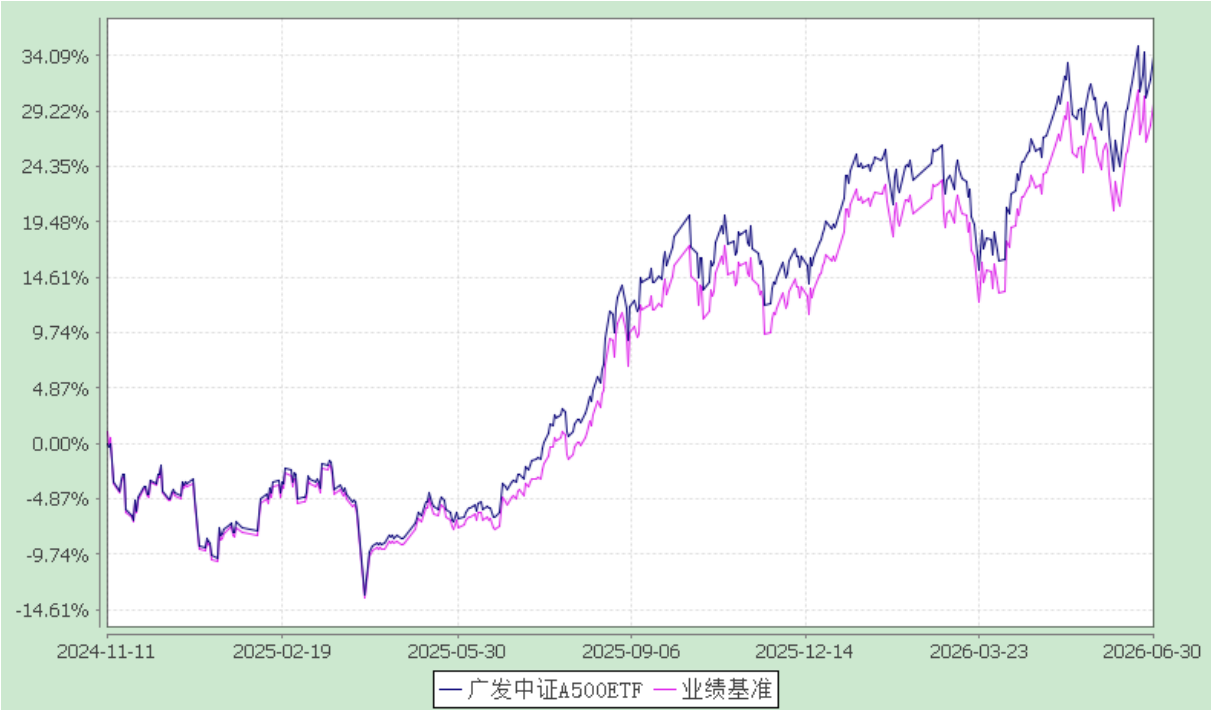
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	15.03%	1.40%	14.26%	1.41%	0.77%	-0.01%
过去六个月	12.67%	1.28%	11.91%	1.29%	0.76%	-0.01%
过去一年	38.68%	1.14%	36.38%	1.14%	2.30%	0.00%
自基金合同生效起至今	34.06%	1.12%	29.91%	1.13%	4.15%	-0.01%

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

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 11 日至 2026 年 6 月 30 日）



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		
霍华明	本基金的基金经理；广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金	2025-01-07	-	18 年	霍华明先生，中国籍，理学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司注册登记部核算专员、数量投资部数据分析员、ETF 基金助理兼研究员、广发中证京津冀协同发展主题

	经理；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的基金经理；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的基金经理；广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证军工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；广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证基建工程交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证基建工程交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；广发沪深 300 交易型开放式指数				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 2018 年 4 月 19 日至 2021 年 6 月 29 日)、广发中证基建工程指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2018 年 2 月 1 日至 2021 年 7 月 26 日)、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 2018 年 4 月 19 日至 2021 年 11 月 23 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 2019 年 11 月 14 日至 2021 年 11 月 23 日)、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 2019 年 11 月 14 日至 2021 年 11 月 23 日)、广发恒生科技指数证券投资基金（QDII）基金经理(自 2021 年 11 月 23 日至 2023 年 3 月 7 日)、广发中证环保产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 2019 年 11 月 14 日至 2023 年 5 月 15 日)、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2019 年 11 月 14 日至 2023 年 5 月 15 日)、广发上海金交易型开放式证券投资基金基金经理(自 2020 年 7 月 8 日至 2023 年 7 月 24 日)、广发上海金交易型开放式证券投资基金联接基金基金经理(自 2020 年 8 月 5 日至 2023 年 7 月 24 日)、广发中证医疗指数证券投资基金（LOF）基金经理(自 2022 年 11 月 15 日至 2023 年 9 月 14 日)、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2019 年 11 月 14 日至 2024 年 3 月 30 日)、广发国证信息技术创新主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2023 年 9 月 20 日至 2025 年 1 月 7 日)、广发中证云计算与大数据主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2024 年 1 月 22 日至 2025 年 4 月 30 日)。

	证券投资基金的基金经理；广发恒生科技交易型开放式指数证券投资基金联接基金(QDII)的基金经理；广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；广发中证医疗交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）的基金经理；广发中证国新港股通央企红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证国新港股通央企红利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				
罗国庆	本基金的基金经理；广发中证传媒交易型开放式指数证券投资基金的	2024-11-11	2026-06-10	16.6 年	罗国庆先生，中国籍，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任深圳证券信息有限公司研究员，华富基金管理有限公司产品设计研究员，广发基金管理有限公

	基金经理；广发中证传媒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；广发中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证创新药产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；广发国证新能源车电池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 1000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；广发中证国新央企股东回报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				司产品经理及量化研究员、广发深证 100 指数分级证券投资基金基金经理(自 2015 年 10 月 13 日至 2020 年 5 月 25 日)、广发中证医疗指数分级证券投资基金基金经理(自 2015 年 10 月 13 日至 2020 年 8 月 25 日)、广发中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2020 年 4 月 13 日至 2020 年 11 月 30 日)、广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2017 年 7 月 31 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指建筑材料指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2017 年 8 月 2 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 2017 年 9 月 13 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2018 年 11 月 2 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）基金经理(自 2020 年 5 月 26 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证医疗指数证券投资基金（LOF）基金经理(自 2020 年 8 月 26 日至 2023 年 2 月 22 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基金经理(自 2021 年 5 月 20 日至 2023 年 7 月 25 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 2021 年 8 月 25 日至 2023 年 7 月 25 日)、广发国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2020 年 1 月 20 日至 2023 年 12 月 13 日)、广发中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2019 年 5 月 27 日至 2024 年 3 月 30 日)、广发国证半导体芯片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 8 月 9 日至 2024 年 8 月 8 日)、广发中证

	成长交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证港股通非银行金融主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发上证科创板成长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；广发中证国新央企股东回报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；广发中证港股通非银行金融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；广发恒指港股通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证 A100 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；广发上证科创板 100 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				100 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 2019 年 5 月 27 日至 2024 年 10 月 27 日)、广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2024 年 11 月 11 日至 2026 年 6 月 10 日)。

	芯片交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；指数投资部副总经理				

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遵规守信情况的说明

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

报告期内，本基金主要采取完全复制法跟踪指数，即按照标的指数的成份股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。报告期内，本基金交易和申购赎回正常，运作过程中未发生风险事件。

2026 年上半年，全球宏观环境整体受到地缘冲突扰动，外部不确定性有所上升，能源价格和通胀预期阶段性上行，全球流动性环境也因此更加复杂。国际层面，市场对供应链稳定、能源运输安全以及主要经济体政策节奏的关注明显增强，市场风险偏好整体偏谨慎。国内方面，宏观政策延续稳增长、稳预期的思路，财政政策更加侧重产业升级、民生保障和重点领域托底，货币政策则注重灵活调节，以更好地应对外部环境变化。产业层面，能源安全、供应链自主可控和国产替代的重要性进一步提升，国产算力、高端装备、绿色能源等方向持续受到关注。总体来看，上半年中国经济在外部压力下保持了一定韧性，发展重心更多转向内部动能修复、结构优化和产业链安全能力提升。

2026 年上半年，虽然一定程度受到外部地缘波动及能源、物流成本变化等因素扰动，但中证 A500 指数凭借行业覆盖广、结构相对均衡的特点，较好分散了单一板块波动带来的影响。成份股中，传统蓝筹与新质生产力相关企业协同支撑，盈利稳定性与成长潜力并存。宏观政策持续发挥托底作用，为核心资产经营修复提供支撑。整体来看，上半年中证 A500 指数更多体现出长期配置价值。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为 12.67%，同期业绩比较基准收益率为 11.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，全球宏观环境或仍处于较高不确定性阶段，贸易摩擦、债务压力及供应链扰动可能对外需形成一定压制。国内方面，宏观政策有望继续围绕稳增长、扩内需和防风险展开，基建投资、消费修复与产业升级协同发力，夯实经济运行韧性。产业端，自主可控、国产替代与技术突破仍是重点方向，相关领域在政策支持与需求修复下，有望延续中长期改善趋势。整体来看，下半年

中国经济有望在波动中保持相对平稳运行。

中证 A500 指数方面，下半年指数或延续温和修复与结构分化并存的格局。随着稳增长政策持续推进，指数中覆盖的制造业、消费、科技及部分周期行业有望受益于内需改善和产业升级，盈利预期或逐步修复。与此同时，外部环境波动、行业景气差异以及市场风格切换等因素，仍可能带来阶段性震荡。

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（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

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	29,885,142.61	271,476,288.95
结算备付金		34,261,842.95	35,604,616.23

存出保证金		5,215,243.20	6,243,331.20
交易性金融资产	6.4.7.2	9,461,727,658.70	21,461,290,291.64
其中：股票投资		9,461,157,651.20	21,461,290,291.64
基金投资		-	-
债券投资		570,007.50	-
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		-	518,300.46
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	60,492.63	-
资产总计		9,531,150,380.09	21,775,132,828.48
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		-	-
应付清算款		665,087.27	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,126,864.67	2,003,181.05
应付托管费		375,621.56	667,727.06
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		9,502.20	41,633.98
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	18,891,996.81	147,329,915.35
负债合计		21,069,072.51	150,042,457.44
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	7,093,978,099.00	18,175,978,099.00
未分配利润	6.4.7.9	2,416,103,208.58	3,449,112,272.04
净资产合计		9,510,081,307.58	21,625,090,371.04
负债和净资产总计		9,531,150,380.09	21,775,132,828.48

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.3406 元，基金份额总额 7,093,978,099.00 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

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		**1,755,159,835.28**	**285,543,715.02**
1．利息收入		232,586.08	249,344.94
其中：存款利息收入	6.4.7.10	232,586.08	249,344.94
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）		2,200,480,525.36	-49,958,882.57
其中：股票投资收益	6.4.7.11	2,114,830,834.53	-274,518,100.76
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	7.27	577,782.11
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	6,117,361.78	231,094.83
股利收益	6.4.7.17	79,532,321.78	223,750,341.25
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	-456,003,023.56	339,306,937.61
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	10,449,747.40	-4,053,684.96
减：二、营业总支出		**12,863,769.40**	**19,486,071.48**
1．管理人报酬		9,504,274.04	14,472,865.41
2．托管费		3,168,091.36	4,824,288.50
3．销售服务费		-	-
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-

7．税金及附加		22,067.68	4,312.22
8．其他费用	6.4.7.21	169,336.32	184,605.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**1,742,296,065.88**	**266,057,643.54**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**1,742,296,065.88**	**266,057,643.54**
五、其他综合收益的税后净额		**-**	**-**
六、综合收益总额		**1,742,296,065.88**	**266,057,643.54**

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

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	18,175,978,099.00	3,449,112,272.04	21,625,090,371.04
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	18,175,978,099.00	3,449,112,272.04	21,625,090,371.04
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-11,082,000,000.00	-1,033,009,063.46	-12,115,009,063.46
（一）、综合收益总额	-	1,742,296,065.88	1,742,296,065.88
（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）	-11,082,000,000.00	-2,775,305,129.34	-13,857,305,129.34
其中：1.基金申购款	1,983,000,000.00	507,154,840.75	2,490,154,840.75
2.基金赎回款	-13,065,000,000.00	-3,282,459,970.09	-16,347,459,970.09
（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	7,093,978,099.00	2,416,103,208.58	9,510,081,307.58
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	21,910,978,099.00	-1,073,881,044.80	20,837,097,054.20
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	21,910,978,099.00	-1,073,881,044.80	20,837,097,054.20
三、本期增减变动额（减少以“–”号填列）	-2,778,000,000.00	437,112,129.32	-2,340,887,870.68
（一）、综合收益总额	-	266,057,643.54	266,057,643.54
（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）	-2,778,000,000.00	171,054,485.78	-2,606,945,514.22
其中：1.基金申购款	11,208,000,000.00	-661,667,535.62	10,546,332,464.38
2.基金赎回款	-13,986,000,000.00	832,722,021.40	-13,153,277,978.60
（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	19,132,978,099.00	-636,768,915.48	18,496,209,183.52

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（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2024]1523 号《关于准予广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册

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 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金于 2024 年 11 月 5 日至 2024 年 11 月 6 日止期间募集不包括认购资金利息共计人民币 1,999,971,363.00 元（含所募集股票市值），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，《广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2024 年 11 月 11 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,999,978,099.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 6,736.00 份基金份额。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。

经上海证券交易所（“上交所”）核准，本基金于 2024 年 11 月 18 日在上交所挂牌交易。

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	1,630,506.54
等于：本金	1,630,335.69
加：应计利息	170.85
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	28,254,636.07
等于：本金	28,254,166.88
加：应计利息	469.19
合计	29,885,142.61

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

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		8,124,248,724.24	-	9,461,157,651.20	1,336,908,926.96
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	570,000.00	7.50	570,007.50	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	570,000.00	7.50	570,007.50	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		8,124,818,724.24	7.50	9,461,727,658.70	1,336,908,926.96

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	43,172,420.00	-	-	-
其中：股指期货投资	43,172,420.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	43,172,420.00	-	-	-

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	6.00	10,713,840.00	311,280.00
IF2607	IF2607	21.00	31,008,600.00	-27,180.00
IM2607	IM2607	1.00	1,737,920.00	3,840.00
合计	-	-	-	287,940.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	287,940.00
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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	60,492.63
合计	60,492.63

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	109,095.94
应付替代款	18,371,846.00
可退替代款	118,487.19
其他	292,567.68
合计	18,891,996.81

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	18,175,978,099.00	18,175,978,099.00
本期申购	1,983,000,000.00	1,983,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-13,065,000,000.00	-13,065,000,000.00
本期末	7,093,978,099.00	7,093,978,099.00

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,296,853,524.84	1,152,258,747.20	3,449,112,272.04
本期期初	2,296,853,524.84	1,152,258,747.20	3,449,112,272.04
本期利润	2,198,299,089.44	-456,003,023.56	1,742,296,065.88
本期基金份额交易产生的变动数	-2,160,704,783.74	-614,600,345.60	-2,775,305,129.34
其中：基金申购款	506,911,063.00	243,777.75	507,154,840.75
基金赎回款	-2,667,615,846.74	-614,844,123.35	-3,282,459,970.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,334,447,830.54	81,655,378.04	2,416,103,208.58

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	3,193.45
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	7,512.77
结算备付金利息收入	221,879.86
其他	-
合计	232,586.08

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	1,445,745,232.13
股票投资收益——赎回差价收入	669,085,602.40
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	2,114,830,834.53

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	9,682,741,167.04
减：卖出股票成本总额	8,229,140,685.13
减：交易费用	7,855,249.78
买卖股票差价收入	1,445,745,232.13

6.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	16,347,459,970.09
减：现金支付赎回款总额	7,672,475,942.09
减：赎回股票成本总额	8,005,898,425.60
减：交易费用	-
赎回差价收入	669,085,602.40

6.4.7.12 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

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	7.27
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	7.27

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无买卖债券差价收入。

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	6,117,361.78

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	79,532,321.78
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	79,532,321.78

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	-455,193,951.12
——股票投资	-455,193,951.12
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-894,000.00
——权证投资	-
——股指期货投资	-894,000.00
3.其他	84,927.56
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-456,003,023.56

注：其他为可退替代款公允价值变动收益。

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	-
替代损益	10,449,747.40
合计	10,449,747.40

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购（赎回）本基金时，补入（卖出）被替代成分证券的实际买入成本（实际卖出金额）与申购（赎回）确认日估值的差额或强

制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购（赎回）确认日估值的差额。

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	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	733.01
申赎登记费	59,507.37
其他	9,916.99
合计	169,336.32

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
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人股东
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	9,504,274.04	14,472,865.41
其中：应支付销售机构的客户维护费	645,865.16	1,234,676.41
应支付基金管理人的净管理费	8,858,408.88	13,238,189.00

注：本基金的管理费按前一日基金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：日管理费＝前一日的基金资产净值×约定年费率/当年天数。

约定年费率为 0.15%。

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	3,168,091.36	4,824,288.50

注：本基金的托管费按前一日基金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：日托管费＝前一日的基金资产净值×约定年费率/当年天数。

约定年费率为 0.05%。

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

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
广发中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	2,901,398,331.00	40.90%	3,567,574,940.00	19.63%
广发证券股份有限公司	14,564,077.00	0.21%	622,033,166.00	3.42%

注：除基金管理人之外的其他关联方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。

6.4.10.6 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 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	
	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	1,630,506.54	3,193.45	1,985,840.83	7,899.13

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

本基金本报告期末未持有基金管理人股东烽火通信科技股份有限公司的 A 股普通股（本基金 2025 年 12 月 31 日持有 603,600 股基金管理人股东烽火通信科技股份有限公司的 A 股普通股，成本总额为人民币 14,789,810.38 元，估值总额为人民币 19,363,488.00 元，占本基金资产净值的比例为 0.09%）。本基金本报告期末持有 4,083,800 股基金托管人中国银行股份有限公司的 A 股普通股（2025 年 12 月 31 日：10,592,100 股），成本总额为人民币 22,723,484.03 元（2025 年 12 月 31 日：58,236,730.00

元），估值总额为人民币 23,359,336.00 元（2025 年 12 月 31 日：60,692,733.00 元），占本基金资产净值的比例为 0.25%（2025 年 12 月 31 日：0.28%）。

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
688012	中微公司	2026-01-08	6 个月	大宗买入流通受限	324.86	459.93	149,000.00	32,486,000.00	68,529,570.00	-
688047	龙芯中科	2026-01-26	6 个月	大宗买入流通受限	163.58	150.67	50,000.00	8,179,000.00	7,533,500.00	-
301236	软通动力	2026-01-16	6 个月	大宗买入流通受限	45.50	41.13	170,000.00	7,735,000.00	6,992,100.00	-
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	-
688781	视涯科技-UW	2026-03-18	9 个月	新股流通受限	22.68	42.16	6,335.00	143,677.80	267,083.60	-
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	2026-06-24	1 个月内	新股流通	10.11	10.11	25,231.00	255,085.41	255,085.41	-

	源		（含）	受限						
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	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	1,717.00	16,259.99	120,430.38	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6 个月	新股流通受限	69.66	160.06	714.00	49,737.24	114,282.84	-
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	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,500.00	26,280.00	53,880.00	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	116.00	10,692.88	53,725.40	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	26.28	172.09	234.00	6,149.52	40,269.06	-
688635	长进光子	2026-05-20	6 个月	新股流通受限	40.98	308.19	128.00	5,245.44	39,448.32	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	7.82	20.74	1,743.00	13,630.26	36,149.82	-
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	有研复材	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	-
30166	高特	2026-0	6 个月	新股	7.08	28.40	546.00	3,865.	15,506	-

9	电子	6-02		流通受限				68	.40	
301687	新广益	2025-12-24	6 个月	新股流通受限	21.93	77.78	195.00	4,276.35	15,167.10	-
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	-
301680	固德电材	2026-02-27	6 个月	新股流通受限	58.00	112.16	117.00	6,786.00	13,122.72	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	78.38	121.77	96.00	7,524.48	11,689.92	-
688816	易思维	2026-02-04	6 个月	新股流通受限	55.95	57.10	177.00	9,903.15	10,106.70	-
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	-
603352	至信股份	2026-01-08	6 个月	新股流通受限	21.88	25.52	112.00	2,450.56	2,858.24	-
920193	吉和昌	2026-06-18	1 个月内（含）	新股流通受限	8.52	8.52	300.00	2,556.00	2,556.00	-
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	-
920136	永励精密	2026-06-25	1 个月内（含）	新股流通受限	19.28	19.28	100.00	1,928.00	1,928.00	-
603284	林平发展	2026-02-03	6 个月	新股流通受限	37.88	34.87	46.00	1,742.48	1,604.02	-

001220	世盟股份	2026-01-27	6 个月	新股流通受限	28.00	27.78	57.00	1,596.00	1,583.46	-
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（含）	新债流通受限	100.00	100.00	5,700.00	570,000.00	570,007.50	-

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(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	832.00	2026-07-13	890.99	56,120.00	17,705,466.28	46,691,840.00	-

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，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.4 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

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

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	570,007.50	-
未评级	-	-
合计	570,007.50	-

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最大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见的，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 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	29,885,142.61	-	-	-	29,885,142.61
结算备付金	34,261,842.95	-	-	-	34,261,842.95
存出保证金	5,215,243.20	-	-	-	5,215,243.20

交易性金融资产	570,007.50	-	-	9,461,157,651.20	9,461,727,658.70
其他资产	-	-	-	60,492.63	60,492.63
资产总计	69,932,236.26	-	-	9,461,218,143.83	9,531,150,380.09
负债					
应付清算款	-	-	-	665,087.27	665,087.27
应付管理人报酬	-	-	-	1,126,864.67	1,126,864.67
应付托管费	-	-	-	375,621.56	375,621.56
应交税费	-	-	-	9,502.20	9,502.20
其他负债	-	-	-	18,891,996.81	18,891,996.81
负债总计	-	-	-	21,069,072.51	21,069,072.51
利率敏感度缺口	69,932,236.26	-	-	9,440,149,071.32	9,510,081,307.58
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	271,476,288.95	-	-	-	271,476,288.95
结算备付金	35,604,616.23	-	-	-	35,604,616.23
存出保证金	6,243,331.20	-	-	-	6,243,331.20
交易性金融资产	-	-	-	21,461,290,291.64	21,461,290,291.64
应收清算款	-	-	-	518,300.46	518,300.46
资产总计	313,324,236.38	-	-	21,461,808,592.10	21,775,132,828.48
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	2,003,181.05	2,003,181.05
应付托管费	-	-	-	667,727.06	667,727.06
应交税费	-	-	-	41,633.98	41,633.98
其他负债	-	-	-	147,329,915.35	147,329,915.35
负债总计	-	-	-	150,042,457.44	150,042,457.44
利率敏感度缺口	313,324,236.38	-	-	21,311,766,134.6	21,625,090,37

				6	1.04

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

本基金本报告期末及上年度末未持有债券资产（不含可转债、可交换债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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	9,461,157,651.20	99.49	21,461,290,291.64	99.24
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	570,007.50	0.01	-	-
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	9,461,727,658.70	99.49	21,461,290,291.64	99.24

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%	570,940,612.86	1,159,616,266.46
	下降 5%	-570,940,612.86	-1,159,616,266.46

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	9,328,158,443.26
第二层次	48,116,622.94
第三层次	85,452,592.50
合计	9,461,727,658.70

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	9,461,157,651.20	99.27
	其中：股票	9,461,157,651.20	99.27
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	570,007.50	0.01
	其中：债券	570,007.50	0.01
	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	64,146,985.56	0.67
8	其他各项资产	5,275,735.83	0.06
9	合计	9,531,150,380.09	100.00

注：上表中的权益投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	29,728,940.00	0.31
B	采矿业	389,280,158.97	4.09
C	制造业	6,689,616,382.50	70.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	207,106,929.29	2.18
E	建筑业	115,168,480.16	1.21

F	批发和零售业	72,982,576.48	0.77
G	交通运输、仓储和邮政业	210,623,137.38	2.21
H	住宿和餐饮业	4,484,102.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	528,736,722.97	5.56
J	金融业	916,636,585.65	9.64
K	房地产业	52,930,799.22	0.56
L	租赁和商务服务业	68,334,513.40	0.72
M	科学研究和技术服务业	113,089,420.00	1.19
N	水利、环境和公共设施管理业	16,399,523.04	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	3,128,400.00	0.03
Q	卫生和社会工作	18,532,286.14	0.19
R	文化、体育和娱乐业	7,221,971.00	0.08
S	综合	17,160,804.00	0.18
	合计	9,461,161,732.20	99.49

7.2.2 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。

7.3 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	318,300	404,241,000.00	4.25
2	300750	宁德时代	755,040	296,738,270.40	3.12
3	300502	新易盛	398,056	241,619,992.00	2.54
4	600519	贵州茅台	178,419	211,513,940.31	2.22
5	603986	兆易创新	190,700	155,420,500.00	1.63
6	601318	中国平安	3,042,245	145,236,776.30	1.53
7	688256	寒武纪	89,702	143,124,026.10	1.50
8	600036	招商银行	3,527,853	125,238,781.50	1.32
9	601899	紫金矿业	4,705,500	118,296,270.00	1.24
10	002371	北方华创	123,614	109,343,999.84	1.15
11	000333	美的集团	1,387,800	104,820,534.00	1.10
12	002475	立讯精密	1,456,200	102,516,480.00	1.08

13	688008	澜起科技	327,167	101,389,053.30	1.07
14	688012	中微公司	213,930	98,949,275.00	1.04
15	688041	海光信息	265,352	98,259,845.60	1.03
16	002384	东山精密	366,100	96,046,335.00	1.01
17	600900	长江电力	3,490,655	92,397,637.85	0.97
18	688981	中芯国际	581,576	92,365,900.32	0.97
19	000725	京东方 A	10,375,300	90,057,604.00	0.95
20	603259	药明康德	706,500	87,966,315.00	0.92
21	600030	中信证券	2,787,783	80,093,005.59	0.84
22	601166	兴业银行	4,828,900	79,966,584.00	0.84
23	300059	东方财富	3,613,640	73,645,983.20	0.77
24	600183	生益科技	416,400	72,203,760.00	0.76
25	600276	恒瑞医药	1,273,921	66,294,848.84	0.70
26	300274	阳光电源	414,800	65,961,496.00	0.69
27	601398	工商银行	9,232,100	65,270,947.00	0.69
28	300408	三环集团	383,200	63,956,080.00	0.67
29	002594	比亚迪	775,100	61,775,470.00	0.65
30	600487	亨通光电	563,457	61,608,388.38	0.65
31	300476	胜宏科技	174,800	60,555,964.00	0.64
32	002463	沪电股份	385,100	58,843,280.00	0.62
33	601211	国泰海通	3,223,530	58,668,246.00	0.62
34	300394	天孚通信	186,999	56,600,857.32	0.60
35	688498	源杰科技	28,429	53,617,094.00	0.56
36	688525	佰维存储	107,751	53,307,652.23	0.56
37	000988	华工科技	287,000	52,983,070.00	0.56
38	301308	江波龙	72,400	50,955,120.00	0.54
39	600176	中国巨石	685,683	49,972,577.04	0.53
40	601288	农业银行	8,198,900	49,767,323.00	0.52
41	601328	交通银行	7,616,842	48,976,294.06	0.51
42	000651	格力电器	1,279,700	47,988,750.00	0.50
43	600522	中天科技	779,498	47,299,938.64	0.50
44	688072	拓荆科技	56,120	46,691,840.00	0.49
45	603019	中科曙光	418,000	44,822,140.00	0.47
46	688521	芯原股份	120,008	44,539,769.12	0.47
47	603993	洛阳钼业	2,494,350	43,775,842.50	0.46
48	600150	中国船舶	1,290,529	43,606,974.91	0.46
49	300604	长川科技	126,700	43,257,914.00	0.45
50	600887	伊利股份	1,803,600	43,214,256.00	0.45
51	600584	长电科技	409,200	42,372,660.00	0.45
52	000338	潍柴动力	1,535,700	41,847,825.00	0.44
53	000858	五粮液	554,300	41,018,200.00	0.43
54	688347	华虹宏力	116,277	39,103,955.10	0.41
55	601816	京沪高铁	8,372,007	37,925,191.71	0.40
56	600309	万华化学	536,500	36,701,965.00	0.39

57	688120	华海清科	112,876	36,366,389.68	0.38
58	300124	汇川技术	540,500	35,851,365.00	0.38
59	002415	海康威视	1,046,100	35,776,620.00	0.38
60	002916	深南电路	77,654	35,557,766.60	0.37
61	002281	光迅科技	138,300	35,534,802.00	0.37
62	002008	大族激光	234,900	35,260,839.00	0.37
63	600111	北方稀土	721,600	34,672,880.00	0.36
64	000100	TCL 科技	5,864,500	34,131,390.00	0.36
65	300857	协创数据	97,900	33,276,210.00	0.35
66	000063	中兴通讯	919,000	33,258,610.00	0.35
67	300136	信维通信	276,100	32,924,925.00	0.35
68	600000	浦发银行	3,797,400	32,695,614.00	0.34
69	600089	特变电工	1,443,052	32,468,670.00	0.34
70	601857	中国石油	3,696,500	32,085,620.00	0.34
71	002028	思源电气	178,129	30,816,317.00	0.32
72	601088	中国神华	782,400	30,544,896.00	0.32
73	300433	蓝思科技	567,100	30,430,586.00	0.32
74	600031	三一重工	1,689,694	29,197,912.32	0.31
75	300014	亿纬锂能	435,300	28,307,559.00	0.30
76	300475	香农芯创	93,900	28,170,000.00	0.30
77	002050	三花智控	639,400	28,024,902.00	0.29
78	601601	中国太保	977,500	27,878,300.00	0.29
79	000001	平安银行	2,772,000	27,858,600.00	0.29
80	300223	北京君正	110,559	27,518,135.10	0.29
81	000792	盐湖股份	907,700	27,403,463.00	0.29
82	002714	牧原股份	778,400	27,236,216.00	0.29
83	600549	厦门钨业	316,400	26,957,280.00	0.28
84	002353	杰瑞股份	175,100	26,702,750.00	0.28
85	002156	通富微电	346,100	26,258,607.00	0.28
86	600406	国电南瑞	1,144,400	26,149,540.00	0.27
87	601668	中国建筑	5,882,300	25,529,182.00	0.27
88	000657	中钨高新	259,700	24,858,484.00	0.26
89	002436	兴森科技	484,900	24,705,655.00	0.26
90	601919	中远海控	1,791,900	23,760,594.00	0.25
91	002602	世纪华通	1,683,200	23,733,120.00	0.25
92	300760	迈瑞医疗	173,666	23,589,052.78	0.25
93	601988	中国银行	4,083,800	23,359,336.00	0.25
94	600660	福耀玻璃	458,200	23,111,608.00	0.24
95	300054	鼎龙股份	218,000	23,101,460.00	0.24
96	601728	中国电信	4,424,400	22,962,636.00	0.24
97	603501	豪威集团	241,879	22,942,223.15	0.24
98	601012	隆基绿能	1,726,485	22,651,483.20	0.24
99	601225	陕西煤业	1,105,900	22,505,065.00	0.24
100	002230	科大讯飞	547,600	22,363,984.00	0.24

101	600941	中国移动	257,100	22,144,023.00	0.23
102	600690	海尔智家	1,068,331	21,804,635.71	0.23
103	002352	顺丰控股	684,100	21,384,966.00	0.22
104	688777	中控技术	180,620	21,222,850.00	0.22
105	601985	中国核电	2,347,300	21,196,119.00	0.22
106	002460	赣锋锂业	321,800	21,045,720.00	0.22
107	002709	天赐材料	407,300	20,947,439.00	0.22
108	002938	鹏鼎控股	198,500	20,917,930.00	0.22
109	603799	华友钴业	433,060	20,899,475.60	0.22
110	300757	罗博特科	33,500	20,736,500.00	0.22
111	300033	同花顺	86,000	20,726,000.00	0.22
112	000977	浪潮信息	293,391	20,537,370.00	0.22
113	600160	巨化股份	385,506	20,435,673.06	0.21
114	300442	润泽科技	234,300	19,463,301.00	0.20
115	002851	麦格米特	116,200	19,426,316.00	0.20
116	000425	徐工机械	2,340,700	18,936,263.00	0.20
117	688126	沪硅产业	472,274	18,839,009.86	0.20
118	000938	紫光股份	646,200	18,649,332.00	0.20
119	002202	金风科技	780,300	18,649,170.00	0.20
120	601600	中国铝业	2,268,200	18,644,604.00	0.20
121	600938	中国海油	682,900	18,540,735.00	0.19
122	600028	中国石化	4,150,000	18,509,000.00	0.19
123	300346	南大光电	197,060	18,257,609.00	0.19
124	600460	士兰微	331,600	18,125,256.00	0.19
125	002466	天齐锂业	294,700	18,071,004.00	0.19
126	601766	中国中车	3,468,600	18,036,720.00	0.19
127	300661	圣邦股份	124,733	17,896,690.84	0.19
128	002600	领益智造	1,031,700	17,889,678.00	0.19
129	600050	中国联通	4,447,600	17,790,400.00	0.19
130	300567	精测电子	55,900	17,753,840.00	0.19
131	002837	英维克	218,630	17,394,202.80	0.18
132	002080	中材科技	191,700	17,253,000.00	0.18
133	002049	紫光国微	194,300	17,244,125.00	0.18
134	002185	华天科技	758,500	16,922,135.00	0.18
135	002407	多氟多	335,643	16,859,347.89	0.18
136	002138	顺络电子	230,100	16,820,310.00	0.18
137	601628	中国人寿	474,800	16,784,180.00	0.18
138	002179	中航光电	363,100	16,775,220.00	0.18
139	688002	睿创微纳	107,482	16,626,390.58	0.17
140	601100	恒立液压	153,500	16,510,460.00	0.17
141	000568	泸州老窖	210,750	16,337,340.00	0.17
142	601872	招商轮船	922,600	16,210,082.00	0.17
143	300395	菲利华	120,300	16,087,719.00	0.17
144	600879	航天电子	753,660	16,045,421.40	0.17

145	002241	歌尔股份	709,100	15,976,023.00	0.17
146	603288	海天味业	477,207	15,824,184.12	0.17
147	601006	大秦铁路	3,394,000	15,646,340.00	0.16
148	000408	藏格矿业	224,600	15,569,272.00	0.16
149	300390	天华新能	166,100	15,532,011.00	0.16
150	601658	邮储银行	3,136,100	15,460,973.00	0.16
151	605117	德业股份	145,563	15,455,879.34	0.16
152	688017	绿的谐波	36,607	15,296,601.02	0.16
153	688469	芯联集成-U	1,438,724	15,264,861.64	0.16
154	600905	三峡能源	4,080,400	15,138,284.00	0.16
155	600489	中金黄金	830,909	14,997,907.45	0.16
156	601888	中国中免	277,560	14,907,747.60	0.16
157	002625	光启技术	490,700	14,878,024.00	0.16
158	688396	华润微	150,794	14,709,954.70	0.15
159	600893	航发动力	380,700	14,596,038.00	0.15
160	000630	铜陵有色	2,294,500	14,593,020.00	0.15
161	600673	东阳光	430,000	14,439,400.00	0.15
162	600010	包钢股份	6,452,940	14,390,056.20	0.15
163	601127	赛力斯	232,500	14,240,625.00	0.15
164	688271	联影医疗	140,307	14,203,277.61	0.15
165	688111	金山办公	66,237	14,111,792.85	0.15
166	300037	新宙邦	151,800	14,094,630.00	0.15
167	300058	蓝色光标	1,022,180	14,065,196.80	0.15
168	601689	拓普集团	247,610	13,970,156.20	0.15
169	002273	水晶光电	393,400	13,957,832.00	0.15
170	002027	分众传媒	2,881,000	13,944,040.00	0.15
171	600118	中国卫星	169,742	13,927,331.10	0.15
172	600019	宝钢股份	2,488,800	13,514,184.00	0.14
173	300751	迈为股份	47,400	13,388,604.00	0.14
174	000426	兴业银锡	404,900	13,345,504.00	0.14
175	600760	中航沈飞	323,100	13,279,410.00	0.14
176	000807	云铝股份	594,700	13,166,658.00	0.14
177	601168	西部矿业	474,700	12,883,358.00	0.14
178	600104	上汽集团	1,315,900	12,843,184.00	0.14
179	600989	宝丰能源	630,900	12,826,197.00	0.13
180	600362	江西铜业	294,900	12,769,170.00	0.13
181	300450	先导智能	312,800	12,737,216.00	0.13
182	601727	上海电气	1,801,700	12,611,900.00	0.13
183	600875	东方电气	436,800	12,566,736.00	0.13
184	600988	赤峰黄金	475,600	12,517,792.00	0.13
185	002001	新和成	439,000	12,476,380.00	0.13
186	688099	晶晨股份	120,537	12,403,257.30	0.13
187	605589	圣泉集团	193,200	12,281,724.00	0.13
188	002422	科伦药业	317,100	12,214,692.00	0.13

189	600667	太极实业	418,200	12,203,076.00	0.13
190	600885	宏发股份	353,760	12,201,182.40	0.13
191	601390	中国中铁	2,917,400	12,165,558.00	0.13
192	002126	银轮股份	242,400	12,071,520.00	0.13
193	000538	云南白药	254,400	12,050,928.00	0.13
194	000960	锡业股份	280,700	11,983,083.00	0.13
195	002738	中矿资源	202,900	11,969,071.00	0.13
196	600392	盛和资源	400,900	11,934,793.00	0.13
197	600547	山东黄金	515,900	11,912,131.00	0.13
198	600795	国电电力	2,547,500	11,896,825.00	0.13
199	000831	中国稀土	211,600	11,741,684.00	0.12
200	600585	海螺水泥	685,500	11,619,225.00	0.12
201	600418	江淮汽车	449,000	11,597,670.00	0.12
202	601669	中国电建	2,458,400	11,554,480.00	0.12
203	300316	晶盛机电	188,000	11,355,200.00	0.12
204	002812	恩捷股份	168,900	11,301,099.00	0.12
205	002648	卫星化学	481,100	11,301,039.00	0.12
206	600141	兴发集团	239,500	11,249,315.00	0.12
207	002129	TCL 中环	922,700	11,090,854.00	0.12
208	600096	云天化	364,751	11,088,430.40	0.12
209	300015	爱尔眼科	1,335,463	11,030,924.38	0.12
210	301358	湖南裕能	145,200	11,016,324.00	0.12
211	601179	中国西电	729,876	10,889,749.92	0.11
212	300782	卓胜微	98,080	10,747,606.40	0.11
213	600346	恒力石化	604,900	10,712,779.00	0.11
214	601868	中国能建	3,979,598	10,625,526.66	0.11
215	600482	中国动力	323,300	10,604,240.00	0.11
216	002195	岩山科技	1,616,500	10,571,910.00	0.11
217	600497	驰宏锌锗	866,795	10,496,887.45	0.11
218	000066	中国长城	549,600	10,469,880.00	0.11
219	002558	巨人网络	379,800	10,467,288.00	0.11
220	300418	昆仑万维	256,300	10,344,268.00	0.11
221	600580	卧龙电驱	311,100	10,297,410.00	0.11
222	000625	长安汽车	1,422,300	10,197,891.00	0.11
223	600066	宇通客车	378,400	10,144,904.00	0.11
224	600426	华鲁恒升	421,700	10,087,064.00	0.11
225	600157	永泰能源	6,247,800	10,058,958.00	0.11
226	000157	中联重科	1,422,900	9,917,613.00	0.10
227	002532	天山铝业	922,400	9,897,352.00	0.10
228	600221	海航控股	7,329,000	9,894,150.00	0.10
229	600895	张江高科	265,300	9,882,425.00	0.10
230	600711	盛屯矿业	881,300	9,667,861.00	0.10
231	688036	传音控股	163,553	9,641,449.35	0.10
232	002340	格林美	1,458,100	9,638,041.00	0.10

233	300803	指南针	104,600	9,588,682.00	0.10
234	000933	神火股份	451,600	9,573,920.00	0.10
235	600011	华能国际	1,258,600	9,552,774.00	0.10
236	600048	保利发展	2,054,784	9,513,649.92	0.10
237	600143	金发科技	612,082	9,456,666.90	0.10
238	605499	东鹏饮料	76,615	9,456,589.45	0.10
239	600436	片仔癀	85,444	9,337,320.32	0.10
240	600438	通威股份	769,200	9,315,012.00	0.10
241	300017	网宿科技	713,000	9,276,130.00	0.10
242	002821	凯莱英	57,200	9,266,400.00	0.10
243	600115	中国东航	2,428,417	9,252,268.77	0.10
244	002493	荣盛石化	858,100	9,224,575.00	0.10
245	002236	大华股份	558,000	9,201,420.00	0.10
246	002131	利欧股份	1,933,500	9,184,125.00	0.10
247	600570	恒生电子	430,796	9,128,567.24	0.10
248	600886	国投电力	683,100	9,092,061.00	0.10
249	002456	欧菲光	957,217	9,055,272.82	0.10
250	600352	浙江龙盛	740,000	8,961,400.00	0.09
251	601233	桐昆股份	409,900	8,874,335.00	0.09
252	003816	中国广核	2,244,000	8,774,040.00	0.09
253	300339	润和软件	227,800	8,772,578.00	0.09
254	603659	璞泰来	302,855	8,761,595.15	0.09
255	601058	赛轮轮胎	752,900	8,680,937.00	0.09
256	601360	三六零	997,000	8,663,930.00	0.09
257	000301	东方盛虹	751,300	8,602,385.00	0.09
258	688213	思特威-W	80,140	8,580,589.80	0.09
259	688047	龙芯中科	56,684	8,567,314.28	0.09
260	600026	中远海能	475,000	8,521,500.00	0.09
261	300759	康龙化成	293,300	8,485,169.00	0.09
262	002074	国轩高科	307,700	8,464,827.00	0.09
263	300438	鹏辉能源	101,100	8,376,135.00	0.09
264	688235	百济神州	32,827	8,358,082.47	0.09
265	688578	艾力斯	76,168	8,317,545.60	0.09
266	002555	三七互娱	440,300	8,308,461.00	0.09
267	600009	上海机场	358,000	8,269,800.00	0.09
268	688122	西部超导	130,515	8,197,647.15	0.09
269	600196	复星医药	364,800	8,197,056.00	0.09
270	000768	中航西飞	398,200	8,155,136.00	0.09
271	000975	山金国际	473,200	8,044,400.00	0.08
272	601111	中国国航	1,328,400	8,036,820.00	0.08
273	300001	特锐德	211,500	8,001,045.00	0.08
274	300207	欣旺达	420,700	7,989,093.00	0.08
275	002517	恺英网络	489,600	7,956,000.00	0.08
276	002472	双环传动	191,300	7,940,863.00	0.08

277	600415	小商品城	781,300	7,938,008.00	0.08
278	600029	南方航空	1,530,401	7,927,477.18	0.08
279	600674	川投能源	557,900	7,905,443.00	0.08
280	002601	龙佰集团	476,900	7,859,312.00	0.08
281	300458	全志科技	198,700	7,840,702.00	0.08
282	601186	中国铁建	1,311,700	7,804,615.00	0.08
283	600219	南山铝业	1,954,375	7,797,956.25	0.08
284	002128	电投能源	336,900	7,789,128.00	0.08
285	603129	春风动力	30,300	7,750,740.00	0.08
286	002595	豪迈科技	166,040	7,737,464.00	0.08
287	601877	正泰电器	306,600	7,686,462.00	0.08
288	600233	圆通速递	486,800	7,667,100.00	0.08
289	601117	中国化学	1,039,360	7,639,296.00	0.08
290	300115	长盈精密	272,300	7,608,062.00	0.08
291	600372	中航机载	687,143	7,455,501.55	0.08
292	002155	湖南黄金	310,760	7,417,841.20	0.08
293	600839	四川长虹	1,057,600	7,382,048.00	0.08
294	301236	软通动力	177,700	7,318,965.00	0.08
295	002465	海格通信	567,900	7,252,083.00	0.08
296	300568	星源材质	383,700	7,182,864.00	0.08
297	300347	泰格医药	147,800	7,094,400.00	0.07
298	300454	深信服	73,675	7,087,535.00	0.07
299	000963	华东医药	250,800	7,052,496.00	0.07
300	000547	航天发展	366,900	7,026,135.00	0.07
301	600741	华域汽车	452,000	7,015,040.00	0.07
302	300024	机器人	357,900	6,918,207.00	0.07
303	002920	德赛西威	84,533	6,889,439.50	0.07
304	603650	彤程新材	70,100	6,868,398.00	0.07
305	688506	百利天恒	23,289	6,847,664.67	0.07
306	002130	沃尔核材	358,500	6,797,160.00	0.07
307	688676	金盘科技	79,271	6,709,497.44	0.07
308	300012	华测检测	481,900	6,679,134.00	0.07
309	688331	荣昌生物	51,012	6,644,823.12	0.07
310	002497	雅化集团	326,200	6,644,694.00	0.07
311	002432	九安医疗	93,900	6,636,852.00	0.07
312	000878	云南铜业	416,700	6,617,196.00	0.07
313	001979	招商蛇口	1,026,900	6,602,967.00	0.07
314	300496	中科创达	106,800	6,599,172.00	0.07
315	002271	东方雨虹	548,500	6,510,695.00	0.07
316	300083	创世纪	477,200	6,499,464.00	0.07
317	002414	高德红外	489,200	6,486,792.00	0.07
318	000034	神州数码	231,640	6,428,010.00	0.07
319	603979	金诚信	108,600	6,410,658.00	0.07
320	601021	春秋航空	140,600	6,408,548.00	0.07

321	300866	安克创新	61,000	6,374,500.00	0.07
322	002444	巨星科技	204,800	6,369,280.00	0.07
323	300474	景嘉微	105,300	6,368,544.00	0.07
324	000661	长春高新	94,920	6,321,672.00	0.07
325	000733	振华科技	111,500	6,315,360.00	0.07
326	002756	永兴材料	108,529	6,147,082.56	0.06
327	300763	锦浪科技	67,800	6,125,730.00	0.06
328	601319	中国人保	905,900	6,123,884.00	0.06
329	688266	泽璟制药-U	52,133	6,081,835.78	0.06
330	300748	金力永磁	196,200	6,052,770.00	0.06
331	300073	当升科技	125,800	6,043,432.00	0.06
332	600699	均胜电子	278,800	6,024,868.00	0.06
333	601615	明阳智能	516,794	5,979,306.58	0.06
334	002078	太阳纸业	477,600	5,965,224.00	0.06
335	300142	沃森生物	457,600	5,944,224.00	0.06
336	000423	东阿阿胶	130,019	5,897,661.84	0.06
337	300432	富临精工	293,500	5,896,415.00	0.06
338	601677	明泰铝业	354,400	5,883,040.00	0.06
339	300919	中伟新材	134,402	5,880,087.50	0.06
340	002025	航天电器	76,900	5,861,318.00	0.06
341	603606	东方电缆	140,340	5,825,513.40	0.06
342	601800	中国交建	1,017,100	5,807,641.00	0.06
343	600039	四川路桥	741,400	5,797,748.00	0.06
344	000002	万科 A	1,956,700	5,791,832.00	0.06
345	603087	甘李药业	101,800	5,778,168.00	0.06
346	002252	上海莱士	1,324,900	5,750,066.00	0.06
347	600226	亨通股份	595,400	5,709,886.00	0.06
348	688599	天合光能	403,447	5,696,671.64	0.06
349	688608	恒玄科技	33,664	5,628,284.16	0.06
350	300724	捷佳伟创	79,300	5,598,580.00	0.06
351	688169	石头科技	58,797	5,583,951.09	0.06
352	688223	晶科能源	1,173,698	5,575,065.50	0.06
353	600588	用友网络	587,992	5,397,766.56	0.06
354	002064	华峰化学	564,700	5,359,003.00	0.06
355	601633	长城汽车	354,669	5,351,955.21	0.06
356	001965	招商公路	580,400	5,316,464.00	0.06
357	000786	北新建材	289,800	5,242,482.00	0.06
358	688390	固德威	48,230	5,233,437.30	0.06
359	002831	裕同科技	146,800	5,220,208.00	0.05
360	688180	君实生物-U	154,287	5,217,986.34	0.05
361	300677	英科医疗	130,600	5,115,602.00	0.05
362	002294	信立泰	159,340	5,081,352.60	0.05
363	000519	中兵红箭	239,300	5,042,051.00	0.05
364	601618	中国中冶	2,046,800	4,994,192.00	0.05

365	600516	方大炭素	809,200	4,992,764.00	0.05
366	603806	福斯特	296,700	4,981,593.00	0.05
367	600177	雅戈尔	660,776	4,975,643.28	0.05
368	688188	柏楚电子	46,110	4,919,937.00	0.05
369	002176	江特电机	491,200	4,916,912.00	0.05
370	601607	上海医药	317,900	4,895,660.00	0.05
371	688065	凯赛生物	101,586	4,860,890.10	0.05
372	300972	万辰集团	28,000	4,855,480.00	0.05
373	302132	中航成飞	83,200	4,852,224.00	0.05
374	000623	吉林敖东	272,600	4,833,198.00	0.05
375	603260	合盛硅业	99,786	4,815,672.36	0.05
376	300699	光威复材	167,800	4,807,470.00	0.05
377	300832	新产业	113,960	4,786,320.00	0.05
378	000617	中油资本	720,800	4,750,072.00	0.05
379	002085	万丰奥威	428,300	4,749,847.00	0.05
380	002318	久立特材	196,600	4,698,740.00	0.05
381	300342	天银机电	98,500	4,629,500.00	0.05
382	300558	贝达药业	71,000	4,619,970.00	0.05
383	002459	晶澳科技	570,100	4,617,810.00	0.05
384	300251	光线传媒	416,300	4,616,767.00	0.05
385	002065	东华软件	644,900	4,604,586.00	0.05
386	600085	同仁堂	197,200	4,557,292.00	0.05
387	002266	浙富控股	900,200	4,555,012.00	0.05
388	600499	科达制造	328,800	4,537,440.00	0.05
389	002044	美年健康	900,600	4,530,018.00	0.05
390	605090	九丰能源	121,800	4,527,306.00	0.05
391	688472	阿特斯	413,804	4,477,359.28	0.05
392	300409	道氏技术	223,500	4,454,355.00	0.05
393	603596	伯特利	179,071	4,448,123.64	0.05
394	600515	海南机场	1,622,546	4,445,776.04	0.05
395	002223	鱼跃医疗	173,230	4,445,081.80	0.05
396	300003	乐普医疗	373,200	4,422,420.00	0.05
397	000400	许继电气	203,200	4,409,440.00	0.05
398	688617	惠泰医疗	24,207	4,395,022.92	0.05
399	301550	斯菱智驱	47,900	4,379,497.00	0.05
400	000032	深桑达 A	175,300	4,373,735.00	0.05
401	002405	四维图新	673,800	4,359,486.00	0.05
402	600521	华海药业	301,600	4,343,040.00	0.05
403	000415	渤海租赁	1,063,200	4,327,224.00	0.05
404	688005	容百科技	140,952	4,313,131.20	0.05
405	000683	博源化工	747,700	4,306,752.00	0.05
406	000999	华润三九	191,400	4,304,586.00	0.05
407	601216	君正集团	962,100	4,290,966.00	0.05
408	600862	中航高科	237,900	4,289,337.00	0.05

409	000039	中集集团	523,700	4,247,207.00	0.04
410	600704	物产中大	891,900	4,209,768.00	0.04
411	600803	新奥股份	265,100	4,188,580.00	0.04
412	603766	隆鑫通用	350,400	4,180,272.00	0.04
413	600312	平高电气	233,300	4,120,078.00	0.04
414	600018	上港集团	868,400	4,098,848.00	0.04
415	000887	中鼎股份	228,200	4,082,498.00	0.04
416	603605	珀莱雅	67,700	4,056,584.00	0.04
417	600332	白云山	199,800	4,003,992.00	0.04
418	600153	建发股份	500,400	3,968,172.00	0.04
419	000967	盈峰环境	376,400	3,963,492.00	0.04
420	300122	智飞生物	338,900	3,961,741.00	0.04
421	600765	中航重机	306,300	3,957,396.00	0.04
422	000830	鲁西化工	329,000	3,948,000.00	0.04
423	600166	福田汽车	1,349,900	3,928,209.00	0.04
424	688116	天奈科技	102,638	3,920,771.60	0.04
425	600323	瀚蓝环境	141,131	3,875,457.26	0.04
426	002410	广联达	470,600	3,840,096.00	0.04
427	002007	华兰生物	310,800	3,788,652.00	0.04
428	300896	爱美客	42,700	3,723,440.00	0.04
429	601799	星宇股份	40,100	3,633,862.00	0.04
430	603568	伟明环保	234,950	3,613,531.00	0.04
431	600398	海澜之家	684,400	3,579,412.00	0.04
432	002603	以岭药业	238,600	3,579,000.00	0.04
433	688114	华大智造	69,964	3,573,761.12	0.04
434	601000	唐山港	855,200	3,549,080.00	0.04
435	002389	航天彩虹	197,940	3,517,393.80	0.04
436	600529	山东药玻	190,300	3,511,035.00	0.04
437	688009	中国通号	734,840	3,497,838.40	0.04
438	600208	衢州发展	1,226,930	3,472,211.90	0.04
439	601018	宁波港	1,101,700	3,470,355.00	0.04
440	600486	扬农化工	68,425	3,469,147.50	0.04
441	000738	航发控制	188,400	3,445,836.00	0.04
442	600316	洪都航空	123,000	3,436,620.00	0.04
443	600008	首创环保	1,255,700	3,415,504.00	0.04
444	600170	上海建工	1,528,475	3,393,214.50	0.04
445	000932	华菱钢铁	971,600	3,371,452.00	0.04
446	603486	科沃斯	66,400	3,369,800.00	0.04
447	600998	九州通	717,300	3,364,137.00	0.04
448	600820	隧道股份	629,600	3,280,216.00	0.03
449	600161	天坛生物	281,958	3,265,073.64	0.03
450	300118	东方日升	260,800	3,246,960.00	0.03
451	688303	大全能源	186,165	3,244,855.95	0.03
452	601238	广汽集团	636,400	3,232,912.00	0.03

453	603885	吉祥航空	309,700	3,186,813.00	0.03
454	002607	中公教育	1,738,000	3,128,400.00	0.03
455	603816	顾家家居	139,730	3,124,362.80	0.03
456	603939	益丰药房	172,700	3,105,146.00	0.03
457	688166	博瑞医药	87,662	3,069,046.62	0.03
458	600038	中直股份	119,200	3,014,568.00	0.03
459	600763	通策医疗	87,702	2,971,343.76	0.03
460	601567	三星电气	198,500	2,965,590.00	0.03
461	603392	万泰生物	109,348	2,949,115.56	0.03
462	601880	辽港股份	2,097,900	2,895,102.00	0.03
463	300573	兴齐眼药	70,927	2,890,984.52	0.03
464	300049	福瑞医科	73,800	2,869,344.00	0.03
465	300676	华大基因	81,700	2,864,402.00	0.03
466	600535	天士力	215,200	2,847,096.00	0.03
467	600511	国药股份	108,162	2,816,538.48	0.03
468	300100	双林股份	99,000	2,750,220.00	0.03
469	002244	滨江集团	358,300	2,723,080.00	0.03
470	000833	粤桂股份	116,200	2,721,404.00	0.03
471	600816	建元信托	1,109,700	2,707,668.00	0.03
472	002120	韵达股份	415,500	2,642,580.00	0.03
473	601155	新城控股	256,100	2,627,586.00	0.03
474	688063	派能科技	48,949	2,607,513.23	0.03
475	300144	宋城演艺	448,400	2,605,204.00	0.03
476	002544	普天科技	138,900	2,530,758.00	0.03
477	000998	隆平高科	330,600	2,492,724.00	0.03
478	600064	南京高科	340,000	2,424,200.00	0.03
479	601866	中远海发	1,093,600	2,416,856.00	0.03
480	600635	大众公用	561,500	2,403,220.00	0.03
481	300457	赢合科技	113,000	2,382,040.00	0.03
482	600754	锦江酒店	131,800	2,371,082.00	0.02
483	000035	中国天楹	483,366	2,334,657.78	0.02
484	600655	豫园股份	556,600	2,287,626.00	0.02
485	300601	康泰生物	193,320	2,192,248.80	0.02
486	600004	白云机场	294,851	2,140,618.26	0.02
487	603899	晨光股份	103,618	2,137,639.34	0.02
488	600663	陆家嘴	338,000	2,122,640.00	0.02
489	600258	首旅酒店	193,500	2,113,020.00	0.02
490	600859	王府井	228,400	2,096,712.00	0.02
491	002091	江苏国泰	281,700	2,036,691.00	0.02
492	300070	碧水源	633,500	2,020,865.00	0.02
493	000069	华侨城 A	1,129,939	1,853,099.96	0.02
494	600864	哈投股份	354,400	1,839,336.00	0.02
495	301078	孩子王	246,200	1,664,312.00	0.02
496	002292	奥飞娱乐	252,100	1,653,776.00	0.02

497	603833	欧派家居	51,900	1,562,709.00	0.02
498	002891	中宠股份	56,300	1,504,336.00	0.02
499	600325	华发股份	636,940	1,471,331.40	0.02
500	002572	索菲亚	162,000	1,182,600.00	0.01
501	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.01
502	301666	大普微-UW	1,220	565,262.60	0.01
503	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.00
504	688781	视涯科技-UW	6,335	267,083.60	0.00
505	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.00
506	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.00
507	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.00
508	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.00
509	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
510	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
511	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
512	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
513	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
514	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
515	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
516	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
517	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
518	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
519	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
520	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
521	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
522	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
523	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
524	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
525	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
526	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
527	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
528	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
529	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
530	920193	吉和昌	300	2,556.00	0.00
531	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
532	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
533	920136	永励精密	100	1,928.00	0.00
534	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
535	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	600519	贵州茅台	138,655,518.29	0.64
2	002371	北方华创	128,738,949.18	0.60
3	688041	海光信息	87,363,413.80	0.40
4	300750	宁德时代	79,638,065.86	0.37
5	688012	中微公司	68,921,102.25	0.32
6	300308	中际旭创	64,702,811.83	0.30
7	300394	天孚通信	64,340,293.26	0.30
8	300476	胜宏科技	48,274,214.50	0.22
9	300502	新易盛	46,176,480.80	0.21
10	688498	源杰科技	42,302,183.06	0.20
11	301308	江波龙	39,869,402.12	0.18
12	002384	东山精密	39,380,805.14	0.18
13	300223	北京君正	38,852,791.82	0.18
14	688008	澜起科技	38,179,082.52	0.18
15	688525	佰维存储	37,508,875.82	0.17
16	300604	长川科技	36,414,274.17	0.17
17	688777	中控技术	33,174,743.95	0.15
18	300274	阳光电源	32,748,243.58	0.15
19	300803	指南针	31,718,271.90	0.15
20	000333	美的集团	31,272,857.43	0.14

注：本项及下项 7.4.2、7.4.3 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，不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

7.4.2 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	300750	宁德时代	545,347,234.88	2.52
2	300308	中际旭创	419,639,233.75	1.94
3	300502	新易盛	255,172,621.18	1.18
4	002371	北方华创	230,629,802.08	1.07
5	000333	美的集团	213,545,272.20	0.99
6	002475	立讯精密	162,935,456.62	0.75
7	300059	东方财富	156,248,720.82	0.72

8	688256	寒武纪	144,403,047.24	0.67
9	002594	比亚迪	140,545,403.67	0.65
10	300274	阳光电源	138,061,127.58	0.64
11	300476	胜宏科技	132,539,562.76	0.61
12	300394	天孚通信	123,411,904.17	0.57
13	002384	东山精密	105,733,042.92	0.49
14	688012	中微公司	105,582,999.88	0.49
15	000858	五粮液	104,387,684.03	0.48
16	000651	格力电器	103,294,013.54	0.48
17	000725	京东方 A	91,954,859.00	0.43
18	002028	思源电气	83,701,253.33	0.39
19	300760	迈瑞医疗	80,418,948.70	0.37
20	000338	潍柴动力	77,491,071.94	0.36

7.4.3 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	3,476,285,420.63
卖出股票收入（成交）总额	9,682,741,167.04

7.5 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	-	-
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）	570,007.50	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	570,007.50	0.01

7.6 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	111025.SH	圣泉转债	5,700	570,007.50	0.01

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金是 ETF 基金，主要投资标的指数的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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金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。

本基金对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。

7.12.2 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约定的备选股票库的情况。

7.12.3 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	5,215,243.20

2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	60,492.63
8	其他	-
9	合计	5,275,735.83

7.12.4 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。

7.12.5 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

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		广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
8,425	842,015.20	6,751,382,766.00	95.17%	342,595,333.00	4.83%	2,901,398,331.00	40.90%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“广发中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	100.00	0.0000%

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的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2024 年 11 月 11 日）基金份额总额	1,999,978,099.00
本报告期期初基金份额总额	18,175,978,099.00
本报告期基金总申购份额	1,983,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	13,065,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	7,093,978,099.00

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 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。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 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。

10.6.2 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。

10.6.3 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。

10.6.4 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。

10.7 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

10.7.1 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	
申万宏源证券	6	13,155,432,884.87	100.00%	2,170,614.18	100.00%	-

注：1、选择标准

（1）属于公司基金合作券商名单；

（2）具备一定的券商交易模式基金合作经验；

（3）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；

（4）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。本基金管理人对符合上述标准、且有合作意愿的券商进行评估并确定合作券商。

（2）协议签署。本基金管理人与选定的合作券商、托管人签订经纪服务协议。

3、本基金使用券商结算模式，本报告期内本基金选择申万宏源证券作为证券经纪商，证券经纪

商申万宏源证券与基金管理人不存在关联方关系。

10.7.2 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	
	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
申万宏源证券	570,000.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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增加华鑫证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-02-27
3	广发基金管理有限公司关于旗下部分上交所 ETF 变更扩位证券简称的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-20
4	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
5	关于增加金融街证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-17
6	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
7	广发基金管理有限公司关于增加世纪证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-05-27
8	广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-10

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

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	期初份	申购份	赎回份	持有份额	份额占比

		例达到或者超过20%的时间区间	额	额	额		
机构	1	20260519-20260520,20260616-20260622	1,939,865,000.00	278,835,015.00	815,015,200.00	1,403,684,815.00	19.79%
广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	20260105-20260630	3,567,574,940.00	401,396,591.00	1,067,573,200.00	2,901,398,331.00	40.90%
产品特有风险							
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： 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； 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； 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； 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； 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。 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。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

经向上海证券交易所申请并获得同意，本基金管理人自 2026 年 3 月 20 日起变更本基金的扩位证券简称。详情可见本基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《广发基金管理有限公司关于旗下部分上交所 ETF 变更扩位证券简称的公告》。

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 交易型开放式指数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基金合同》

（三）《广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
（四）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