广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年十月二十七日

§1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品概况

基金简称	广发中证 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
报告期末基金份额总额	3,695,372,395.76 份
投资目标	本基金通过主要投资于目标 ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为 ETF 联接基金，主要通过投资于目标 ETF 实现对标的指数的紧密跟踪。本基金力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35%以内，年化跟踪误

	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。		
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		
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	2,493,809,293.61 份	1,147,334,269.43 份	54,228,832.72 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

2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
投资策略	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。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日)		
	广发中证	广发中证	广发中证

	A500ETF 联接 A	A500ETF 联接 C	A500ETF 联接 Y
1.本期已实现收益	34,363,424.29	16,369,240.59	785,737.98
2.本期利润	-382,699,483.22	-186,838,238.74	-8,631,967.69
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1674	-0.1672	-0.1679
4.期末基金资产净值	2,849,808,383.29	1,306,127,311.99	61,967,332.74
5.期末基金份额净值	1.1428	1.1384	1.1427

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、广发中证 A500ETF 联接 A：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-13.09%	1.43%	-14.23%	1.43%	1.14%	0.00%
过去六个月	-0.59%	1.40%	-2.62%	1.40%	2.03%	0.00%
过去一年	-2.25%	1.23%	-4.10%	1.24%	1.85%	-0.01%
自基金合同生效起至今	14.28%	1.13%	14.53%	1.14%	-0.25%	-0.01%

2、广发中证 A500ETF 联接 C：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-13.14%	1.43%	-14.23%	1.43%	1.09%	0.00%
过去六个月	-0.69%	1.40%	-2.62%	1.40%	1.93%	0.00%
过去一年	-2.45%	1.23%	-4.10%	1.24%	1.65%	-0.01%
自基金合同生效起至今	13.84%	1.13%	14.53%	1.14%	-0.69%	-0.01%

3、广发中证 A500ETF 联接 Y：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-13.09%	1.43%	-14.23%	1.43%	1.14%	0.00%
过去六个月	-0.59%	1.40%	-2.62%	1.40%	2.03%	0.00%
过去一年	-2.25%	1.23%	-4.10%	1.24%	1.85%	-0.01%
自基金合同生效起至今	16.35%	1.13%	12.36%	1.13%	3.99%	0.00%

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

广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2024 年 11 月 5 日至 2026 年 9 月 30 日)

1、广发中证 A500ETF 联接 A：



2、广发中证 A500ETF 联接 C：



3、广发中证 A500ETF 联接 Y：



§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2024-11-18	-	27.4 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

	发中证央企创新驱动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				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

	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				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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

程动态监控，通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 29 次，其中 27 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 2 次为不同投资经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关投资经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

作为 ETF 联接基金，本基金秉承指数化被动投资策略，主要持有广发中证 A500ETF 及指数成份股等，间接复制指数，同时积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，进一步降低基金的跟踪误差。

2026 年 3 季度，全球宏观环境受地缘冲突持续演化及主要经济体政策节奏调整影响，外部不确定性有所上升，全球流动性环境趋于复杂。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货币政策节奏的关注明显增强，全球风险偏好整体偏谨慎。国内方面，7 月中央政治局会议提出宏观政策要发力提效，加快财政支出和债券资金使用进度，有力推进“两重”建设和“两新”工作。货币政策保持适度宽松，综合运用并适时调整货币政策工具。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，中国经济在应对外部复杂环境的过程中，展现出一定的韧性，发展重心也更加聚焦于内部动能的修复与产业链安全能力提升。

2026 年 3 季度，受市场风险偏好下降、科技成长板块集中回调影响，指数中覆盖的制造业、科技等成长方向承压明显。但中证 A500 指数凭借行业覆盖广、结构相对均衡的特点，较好地分散了单一板块波动带来的影响，整体表现优于部分单一赛道指数。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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为-13.09%，C 类基金份额净值增长率为-13.14%，Y 类基金份额净值增长率为-13.09%，同期业绩比较基准收益率为-14.23%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	162,710,711.95	3.69
	其中：股票	162,710,711.95	3.69
2	基金投资	3,810,190,730.65	86.51
3	固定收益投资	149,853,900.63	3.40
	其中：债券	149,853,900.63	3.40
	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	250,667,905.17	5.69
8	其他资产	30,931,718.69	0.70

9	合计	4,404,354,967.09	100.00

5.2 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（元）	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	3,810,190,730.65	90.33

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	660,727.00	0.02
B	采矿业	8,395,103.75	0.20
C	制造业	108,734,348.40	2.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,454,882.82	0.11
E	建筑业	1,981,000.00	0.05
F	批发和零售业	1,089,016.40	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	4,060,548.00	0.10
H	住宿和餐饮业	81,855.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,184,204.73	0.22
J	金融业	17,916,838.05	0.42
K	房地产业	1,105,294.00	0.03
L	租赁和商务服务业	1,209,609.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	2,753,668.00	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	290,585.80	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	59,200.00	0.00

Q	卫生和社会工作	325,835.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	130,553.00	0.00
S	综合	277,443.00	0.01
	合计	162,710,711.95	3.86

5.3.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	688825	长鑫科技	295,247	11,411,296.55	0.27
2	300308	中际旭创	5,900	4,769,796.00	0.11
3	600519	贵州茅台	3,300	4,153,446.00	0.10
4	300750	宁德时代	13,770	4,008,584.70	0.10
5	601318	中国平安	55,500	2,957,595.00	0.07
6	300502	新易盛	7,260	2,824,140.00	0.07
7	600036	招商银行	64,500	2,661,270.00	0.06
8	601899	紫金矿业	85,800	2,555,982.00	0.06
9	603259	药明康德	12,900	2,158,686.00	0.05
10	000333	美的集团	25,340	2,029,734.00	0.05

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	149,853,900.63	3.55
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	149,853,900.63	3.55

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	019792.SH	25 国债 19	1,098,000	111,279,081.20	2.64
2	019827.SH	26 国债 01	258,000	26,023,350.25	0.62
3	019835.SH	26 国债 09	125,000	12,551,469.18	0.30

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF2611	IF2611	15.00	19,459,800.00	104,700.00	买入的股指期货是与现货股票指数相关性较高的期货品种，用期货进行较小比例的现货替代，能够较好地实现流动性管理以及降低调仓

					成本等，也能保持整体持仓风险特征前后一致。
IC2610	IC2610	6.00	8,915,040.00	-124,680.00	买入的股指期货是与现货股票指数相关性较高的期货品种，用期货进行较小比例的现货替代，能够较好地实现流动性管理以及降低调仓成本等，也能保持整体持仓风险特征前后一致。
IF2610	IF2610	5.00	6,529,200.00	-36,610.00	买入的股指期货是与现货股票指数相关性较高的期货品种，用期货进行较小比例的现货替代，能够较好地实现流动性管理以及降低调仓成本等，也能保持整体持仓风险特征前后一致。
公允价值变动总额合计(元)					-56,590.00
股指期货投资本期收益(元)					-3,349,798.29
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-333,450.00

5.10.2 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。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（1）本基金本报告期末未持有国债期货。

（2）本基金本报告期内未进行国债期货交易。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 本基金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。

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

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,365,324.89
2	应收证券清算款	369,271.59
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	26,197,122.21
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	30,931,718.69

5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688825	长鑫科技	11,411,296.55	0.27	新股流通受限

§6 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
报告期期初基金份额总额	2,174,973,342.10	1,047,993,449.66	48,484,724.98
报告期期间基金总申购份额	837,441,406.63	297,363,713.35	8,598,435.24
减：报告期期间基金总赎回份额	518,605,455.12	198,022,893.58	2,854,327.50
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
报告期期末基金份额总额	2,493,809,293.61	1,147,334,269.43	54,228,832.72

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	33,190,671.67
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	33,190,671.67
报告期期末管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.00

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	赎回	2026-08-04	-33,190,671.67	-39,065,420.56	0.00%
合计			-33,190,671.67	-39,065,420.56	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关规定，在履行规定审批程序并经基金托管人同意后，本基金参加了上海燧原科技股份有限公司（以下简称“燧原科技”）首次公开发行股票的申购。燧原科技本次发行的联席主承销商广发证券股份有限公司为本公司的控股股东，保荐人（主承销商）中信证券股份有限公司、联席主承销商国泰海通证券股份有限公司为本公司旗下部分公募基金托管人及其关联方。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基金关联交易事项的公告》。

2、根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及相关法律法规、基金合同及招募说明书等规定，在履行规定审批程序并经基金托管人同意后，本基金参加了粤芯半导体技术股份有限公司（以下简称“粤芯半导体”）首次公开发行股票的申购。粤芯半导体本次发行的保荐人（联

席主承销商）广发证券股份有限公司为本基金管理人的控股股东，联席主承销商国泰海通证券股份有限公司为本基金管理人旗下部分公募基金托管人及其关联方。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基金关联交易事项的公告》。

§9 备查文件目录

9.1 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

9.2 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

9.3 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

二〇二六年十月二十七日