

广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金  
联接基金（LOF）  
2024 年中期报告  
2024 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：中国工商银行股份有限公司  
送出日期：二〇二四年八月三十日

## 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，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 28 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 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>2 基金简介</b>	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
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
<b>4 管理人报告</b>	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
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
<b>5 托管人报告</b>	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
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	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
<b>7 投资组合报告</b>	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 期末投资目标基金明细	42
7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	52
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	52
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	52
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	52
7.11 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52

7.13 投资组合报告附注 .....	53
<b>8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>54</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	54
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	54
8.4 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 .....	55
<b>9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>55</b>
<b>10 重大事件揭示 .....</b>	<b>56</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	56
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 .....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	56
10.4 基金投资策略的改变 .....	56
10.5 本报告期持有的基金发生的主要影响事件 .....	56
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	56
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	56
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	56
10.9 其他重大事件 .....	62
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>62</b>
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 .....	62
<b>12 备查文件目录 .....</b>	<b>63</b>
12.1 备查文件目录 .....	63
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 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)	
基金简称	广发中证 500ETF 联接 (LOF)	
场内简称	中证 500LOF	
基金主代码	162711	
基金运作方式	上市契约型开放式	
基金合同生效日	2009 年 11 月 26 日	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,237,892,704.27 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2010-01-08	
下属分级基金的基金简称	广发中证 500ETF 联接 (LOF) A	广发中证 500ETF 联接 C
下属分级基金场内简称	中证 500LOF	-
下属分级基金的交易代码	162711	002903
报告期末下属分级基金的份额总额	1,223,845,807.57 份	1,014,046,896.70 份

#### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金	
基金主代码	510510	
基金运作方式	交易型开放式	
基金合同生效日	2013 年 4 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	2013 年 5 月 24 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	中国工商银行股份有限公司	

### 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控制在 0.35%以内，年化跟踪误差控制在 4%以内。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指类型基金，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。
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的比例不低于基金资产净值的 95%。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指类型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数中证 500 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	中国工商银行股份有限公司
信息披 露 负责人	姓名	项军
	联系电话	020-83936666
	电子邮箱	xiangj@gffunds.com.cn
客户服务电话	95105828	95588
传真	020-34281105	010-66105798
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55号
办公地址	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55号
邮政编码	510308	100140
法定代表人	葛长伟	廖林

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.gffunds.com.cn
基金中期报告备置地点	广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

## 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
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

注：本基金的 A 类基金份额的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，C 类基金份额的注册登记机构为广发基金管理有限公司。

## 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		
<b>3.1.1 期间数据和指标</b>		<b>报告期内（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）</b>
本期已实现收益	-88,361,625.87	-62,431,215.04
本期利润	-111,427,451.03	-66,977,906.97
加权平均基金份额本期利润	-0.0910	-0.0631
本期加权平均净值利润率	-7.40%	-6.49%
本期基金份额净值增长率	-7.22%	-7.31%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>		<b>报告期末(2024 年 6 月 30 日)</b>
期末可供分配利润	214,793,549.32	-70,293,201.35
期末可供分配基金份额利润	0.1755	-0.0693
期末基金资产净值	1,438,639,356.89	943,753,695.35
期末基金份额净值	1.1755	0.9307
<b>3.1.3 累计期末指标</b>		<b>报告期末(2024 年 6 月 30 日)</b>
广发中证 500ETF 联接	广发中证 500ETF 联接 C	

	(LOF) A	
基金份额累计净值增长率	17.55%	-6.93%

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 500ETF 联接（LOF）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
过去一个月	-5.90%	0.90%	-6.55%	0.91%	0.65%	-0.01%
过去三个月	-4.98%	1.06%	-6.16%	1.09%	1.18%	-0.03%
过去六个月	-7.22%	1.50%	-8.46%	1.53%	1.24%	-0.03%
过去一年	-15.21%	1.19%	-16.71%	1.21%	1.50%	-0.02%
过去三年	-22.61%	1.12%	-26.00%	1.14%	3.39%	-0.02%
自基金合同生效起至今	17.55%	1.47%	11.78%	1.50%	5.77%	-0.03%

广发中证 500ETF 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
过去一个月	-5.91%	0.90%	-6.55%	0.91%	0.64%	-0.01%
过去三个月	-5.02%	1.06%	-6.16%	1.09%	1.14%	-0.03%
过去六个月	-7.31%	1.50%	-8.46%	1.53%	1.15%	-0.03%
过去一年	-15.38%	1.19%	-16.71%	1.21%	1.33%	-0.02%
过去三年	-23.07%	1.12%	-26.00%	1.14%	2.93%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-6.93%	1.19%	-12.77%	1.22%	5.84%	-0.03%

注：(1) 自 2013 年 10 月 10 日起，本基金的业绩比较基准由“95%×中证 500 指数收益率+5%×银行同业存款收益率”变更为“95%×中证 500 指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）”。

(2) 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 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）

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

(2009 年 11 月 26 日至 2024 年 6 月 30 日)

广发中证 500ETF 联接（LOF）A



广发中证 500ETF 联接 C



注：自 2013 年 10 月 10 日起，本基金的业绩比较基准由“95%×中证 500 指数收益率+5%×银行同业存款收益率”变更为“95%×中证 500 指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）”。

## 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		
刘杰	本基金的基金经理；广发中证 500	2014-04-01	-	20 年	刘杰先生，工学学士，持有中国证券投资基金业从业证

	交易型开放式指 数证券投资基金 的基金经理；广 发创业板交易型 开放式指数证券 投资基金的基金 经理；广发创业 板交易型开放式 指数证券投资基金 发起式联接基 金的基金经理； 广发纳斯达克 100 交易型开 放式指数证券投资 基金的基金经 理；广发纳斯达 克 100 交易型开 放式指数证券投资 基金联接基金 （QDII）的基金 经理；广发恒生 科技交易型开 放式指数证券投资 基金（QDII）的 基金经理；广发 中证香港创新药 交易型开放式指 数证券投资基金 （QDII）的基金 经理；广发全球 医疗保健指数证 券投资基金的基 金经理；广发纳 斯达克生物科技 指数型发起式证 券投资基金的基 金经理；广发北 证 50 成份指数型 证券投资基金的 基金经理；广发 恒生消费交易型 开放式指数证券 投资基金(QDII) 的基金经理；广 发中证香港创新			书。曾任广发基金管理有限公司信息技术部系统开发专员、数量投资部研究员、广发沪深 300 指数证券投资基金基金经理(自 2014 年 4 月 1 日至 2016 年 1 月 17 日)、广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2018 年 4 月 25 日)、广发量化稳健混合型证券投资基金基金经理(自 2017 年 8 月 4 日至 2018 年 11 月 30 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 2016 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 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 2016 年 1 月 25 日至 2019 年 11 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 2016 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2016 年 8 月 30 日至 2019 年 11 月 14 日)、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基金经理(自 2016 年 9 月 26 日至 2019 年 11 月 14 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 2017 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 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 2018 年 4 月 26 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发标普全球农业指数证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2020 年 2 月 28 日)、广发粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金
--	--	--	--	--

	药交易型开放式指数证券投资基 金发起式联接基金（QDII）的基 金经理；广发深 证 100 交易型开 放式指数证券投资 基金的基金经理； 广发中证红利交 易型开放式指 数证券投资基 金的基金经理； 广发恒生消费交 易型开放式指 数证券投资基 金发起式联接基 金（QDII）的基 金经理；指数投资 部总经理助理			基金联接基金基金经理(自 2020年5月21日至2021年 7月2日)、广发美国房地 产指数证券投资基 金基金经理(自2018年8月6 日至2021年9月16日)、广发全 球医疗保健指数证券投资基 金基金经理(自2018年8月6 日至2021年9月16日)、广发纳 斯达克生物科技指 数型发起式证券投资基 金基金经理(自2018年8月6 日至2021年9月16日)、广发道 琼斯美国石油开发与生产指 数证券投资基 金(QDII-LOF)基金经理(自 2018年8月6日至2021年9 月16日)、广发粤港澳大湾 区创新100交易型开 放式指数证券投资基 金基金经理(自2019年12月16 日至2021年9月16日)、广发中 证央企创新驱动交 易型开放式指 数证券投资基 金基金经理(自2019 年9月20日至2021年11月 17日)、广发中证央 企创新驱动驱动交 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6 日至2021年11月 17日)、广发纳斯达 克100指 数证券投资基 金基金经理(自2018年8月6 日至2022年3月31日)、广发恒 生中国企业精明指 数型发起式证券投资基 金(QDII)基金 经理(自2019年5月9 日至2022年4月28日)、广发沪 深300交易型开 放式指 数证券投资基 金基金经理(自2015 年8月20日至2023年2月 22日)、广发沪深300交易型 开放式指 数证券投资基 金联接基金基金经 理(自2016年1 月18日至2023年2月22日)、 广发恒生科技指 数证券投资基 金(QDII)基金经 理(自
--	--	--	--	---

					2021年8月11日至2023年3月7日)、广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)基金经理(自2018年8月6日至2023年12月13日)、广发美国房地产指数证券投资基金基金经理(自2022年11月16日至2023年12月13日)、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)基金经理(自2023年3月8日至2024年3月30日)。
--	--	--	--	--	--

- 注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。  
 2.证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 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，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

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控与及时的分析评估，保证公平交易原则的实现。

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，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公平分配投资指令。金融工程与风险管理部风险控制岗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；稽核岗通过对投资、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 14 次，其中 13 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 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金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

2024 年上半年，A 股市场总体呈现先抑后扬的趋势，2 月以来伴随流动性积极化解，叠加稳市场、稳预期的多项政策密集出台，投资者情绪逐步改善。上半年，沪深 300 指数上涨 0.89%，中证 500 指数下跌 8.96%，创业板指数下跌 10.99%，北证 50 下跌 34.52%，深证 100 下跌 4.16%。

2024 年上半年，大盘相对占优，表现较优的大盘股包括股息率较高行业、供给端出清行业和制造业出海热潮的相关行业。上半年，行业表现较好的有银行、公用事业、家用电器，与高股息、全球经济呈现修复态势和国内出口增速超预期存在一定关系，表现较弱的行业主要是与内需增速相关性较强以及部分估值水平较高的行业，包括计算机、社会服务、商贸零售、医药生物等行业。

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 500ETF 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。

报告期内，本基金跟踪误差来源主要是成份股调整、申购赎回和停牌股票估值调整等因素。

中证 500 指数有着高波动、高收益的特征。就中长期表现而言，中证 500 指数收益相较大部分市场宽基指数存在一定优势；就短期表现而言，其往往被誉为“反弹急先锋”，值得投资者关注。

##### 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 -7.22%，C 类基金份额净值增长率为 -7.31%，同期业绩比较基准收益率为 -8.46%。

#### 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，随着物价因素边际改善和复苏深化，下半年 A 股企业盈利增速可能好于上半年，

同时，A 股企业资产负债表仍相对健康，在稳增长政策支持下，预计内需逐步提升，并且在海外经济景气度较高的背景下，外需有望增速上扬，未来需求侧边际修复有望带动 ROE 周期性改善，并且当前 A 股估值处于历史中低水平，基本面好转有望带动投资者风险偏好回升。同时，下半年美国降息周期或有望开启，在全球资金再配置过程中，部分资金可能会流向包括中国在内的新兴市场，鉴于 A 股市场整体处于估值相对较低位置，届时 A 股有望相对受益。

#### 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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，本基金的管理人——广发基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现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

本托管人依法对广发基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	162,388,189.34	210,796,565.09
结算备付金		23,710,739.42	13,292,783.84
存出保证金		10,739,376.80	7,661,380.63
交易性金融资产	6.4.7.2	2,195,141,321.38	2,394,967,917.19
其中：股票投资		2,799,774.02	8,776,108.80

基金投资		2,192,340,547.29	2,386,191,808.39
债券投资		1,000.07	-
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		81,065.23	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,091,066.37	1,119,682.23
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	1,581,832.35	5,921,824.94
资产总计		2,394,733,590.89	2,633,760,153.92
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		10,439,272.37	10,438,616.86
应付赎回款		1,016,742.99	8,865,600.85
应付管理人报酬		92,183.09	98,674.25
应付托管费		18,436.64	19,734.87
应付销售服务费		160,593.09	184,940.61
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	613,310.47	324,979.31
负债合计		12,340,538.65	19,932,546.75
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.8	2,237,892,704.27	2,284,594,802.56
未分配利润	6.4.7.9	144,500,347.97	329,232,804.61
净资产合计		2,382,393,052.24	2,613,827,607.17
负债和净资产总计		2,394,733,590.89	2,633,760,153.92

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，广发中证 500ETF 联接(LOF)A 基金份额净值人民币 1.1755 元，基金份额总额 1,223,845,807.57 份；广发中证 500ETF 联接 C 基金份额净值人民币 0.9307 元，

基金份额总额 1,014,046,896.70 份；总份额总额 2,237,892,704.27 份。

## 6.2 利润表

会计主体：广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-176,608,355.45	82,450,469.17
1.利息收入		593,789.17	414,985.34
其中：存款利息收入	6.4.7.10	593,789.17	414,985.34
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）		-149,640,447.08	15,162,159.51
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-2,154,248.52	-602,166.75
基金投资收益	6.4.7.12	-154,034,698.74	15,346,739.66
债券投资收益	6.4.7.13	0.07	0.47
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	6,510,390.83	380,111.68
股利收益	6.4.7.17	38,109.28	37,474.45
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	-27,612,517.09	66,672,954.20
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	50,819.55	200,370.12
<b>减：二、营业总支出</b>		1,797,002.55	1,740,769.56
1. 管理人报酬		556,036.69	496,900.69
2. 托管费		111,207.34	99,380.13
3. 销售服务费		1,030,299.52	986,704.13
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		-	56,846.48

8. 其他费用	6.4.7.21	99,459.00	100,938.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-178,405,358.00	80,709,699.61
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-178,405,358.00	80,709,699.61
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-178,405,358.00	80,709,699.61

注：比较数据已根据更新发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行重新列示：即将上年度利润表中的“证券出借利息收入”合并于“其他利息收入”中列示。

### 6.3 净资产变动表

会计主体：广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	2,284,594,802.56	329,232,804.61	2,613,827,607.17
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	2,284,594,802.56	329,232,804.61	2,613,827,607.17
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-46,702,098.29	-184,732,456.64	-231,434,554.93
(一)、综合收益总额	-	-178,405,358.00	-178,405,358.00
(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）	-46,702,098.29	-6,327,098.64	-53,029,196.93
其中：1.基金申购款	511,687,059.53	-20,684,366.22	491,002,693.31
2.基金赎回款	-558,389,157.82	14,357,267.58	-544,031,890.24
(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	2,237,892,704.27	144,500,347.97	2,382,393,052.24
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	2,091,820,635.97	480,472,207.06	2,572,292,843.03
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	2,091,820,635.97	480,472,207.06	2,572,292,843.03
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-35,748,832.97	73,091,380.94	37,342,547.97
(一)、综合收益总额	-	80,709,699.61	80,709,699.61
(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）	-35,748,832.97	-7,618,318.67	-43,367,151.64
其中：1.基金申购款	456,576,570.20	115,815,051.81	572,391,622.01
2.基金赎回款	-492,325,403.17	-123,433,370.48	-615,758,773.65
(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	2,056,071,803.00	553,563,588.00	2,609,635,391.00

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 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）(原名为广发中证 500 指数证券

投资基金(LOF)，以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(“中国证监会”)证监许可[2009]982号文核准，由基金发起人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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发中证 500 指数证券投资基金基金合同》(后更名为《广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金合同》，以下简称“基金合同”)发起，于 2009 年 11 月 26 日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。本基金已向中国证监会备案，并于 2009 年 11 月 26 日获得确认。

本基金募集期为 2009 年 10 月 22 日至 2009 年 11 月 20 日，为契约型开放式基金，存续期限不定，首次募集资金为人民币 8,635,797,223.98 元，有效认购房户数为 107,956 户。其中，认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计人民币 634,322.52 元，按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所有限公司验资。基金合同于 2009 年 11 月 26 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 8,635,797,223.98 份。

根据本基金的管理人于 2013 年 10 月 11 日发布的《关于广发中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会决议生效公告》，本基金变更为广发中证 500ETF 的联接基金，允许本基金投资股指期货，参与融资融券及通过证券金融公司办理转融通业务，并相应地对基金合同中有关本基金的名称、基金份额申购和赎回、基金的投资和估值、基金的费用、基金份额持有人大会及其他部分条款，按照相关法律法规及中国证监会的有关规定进行修改。《广发中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》修订为《广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金合同》，原《广发中证 500 指数证券投资基金（LOF）基金合同》同日起失效。

本基金于 2016 年 6 月 15 日起，经基金管理人与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，在原有份额的基础上增设场外 C 类基金份额，原份额转为 A 类基金份额。A 类基金份额注册登记业务办理机构为中国证券登记结算有限责任，在投资者认购/申购基金时收取认购/申购费用，而不计提销售服务费；C 类基金份额注册登记业务办理机构为广发基金管理有限公司，在投资者认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费。本基金 A 类基金份额的申购与赎回包括场外和场内两种方式。本基金 C 类基金份额在场外申购和赎回。两类基金份额分别设置代码，并分别计算基金份额净值。两类份额之间不得相互转换。

本基金于 2016 年 6 月 15 日起增设场外 C 类基金份额，原份额转为 A 类份额。

#### 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、应用指南、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管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》、《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》、《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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 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**

##### **(1) 印花税**

境内证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。根据财政部、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》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

##### **(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加**

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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费附加。

### （3）企业所得税

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、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。

### （4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，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，减按 25% 计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

### （5）境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《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[2016]127 号文《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

## 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 2024 年 6 月 30 日
活期存款	162,388,189.34
等于：本金	162,372,042.69
加：应计利息	16,146.65
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	162,388,189.34

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	2,863,596.34	-	2,799,774.02	-63,822.32

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,000.00	0.07	1,000.07	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,000.00	0.07	1,000.07	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		2,378,489,807.11	-	2,192,340,547.29	-186,149,259.82
其他		-	-	-	-
合计		2,381,354,403.45	0.07	2,195,141,321.38	-186,213,082.14

#### 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 2024年6月30日				备注	
	合同/名义 金额	公允价值				
		资产	负债			
利率衍生工具	-	-	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	-	-	
权益衍生工具	81,475,018.18	-	-	-	-	
其中：股指期货投资	81,475,018.18	-	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	-	-	
合计	81,475,018.18	-	-	-	-	

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
IC2407	IC2407	80.00	78,681,600.00	-2,793,418.18
合计	-	-	-	-2,793,418.18
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-2,793,418.18
净额	-	-	-	-

注：衍生金融资产项下的衍生工具为国债/股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持国债/股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指/国债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为 0。

#### 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 2024 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	-
应收退补款	476,101.65
可收退补款	1,105,730.70
合计	1,581,832.35

#### 6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	287.96
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	517,547.13
其中：交易所市场	517,547.13
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	95,475.38
合计	613,310.47

#### 6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

广发中证 500ETF 联接（LOF）A		
项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	1,216,903,093.75	1,216,903,093.75
本期申购	52,020,509.06	52,020,509.06
本期赎回（以“-”号填列）	-45,077,795.24	-45,077,795.24
本期末	1,223,845,807.57	1,223,845,807.57

金额单位：人民币元

广发中证 500ETF 联接 C		
项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
上年度末	1,067,691,708.81	1,067,691,708.81
本期申购	459,666,550.47	459,666,550.47
本期赎回（以“-”号填列）	-513,311,362.58	-513,311,362.58
本期末	1,014,046,896.70	1,014,046,896.70

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 500ETF 联接（LOF）A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,713,189,422.83	-1,388,328,438.00	324,860,984.83
本期期初	1,713,189,422.83	-1,388,328,438.00	324,860,984.83
本期利润	-88,361,625.87	-23,065,825.16	-111,427,451.03
本期基金份额交易产生的变动数	9,823,978.15	-8,463,962.63	1,360,015.52
其中：基金申购款	71,311,005.41	-59,857,358.66	11,453,646.75
基金赎回款	-61,487,027.26	51,393,396.03	-10,093,631.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,634,651,775.11	-1,419,858,225.79	214,793,549.32

单位：人民币元

广发中证 500ETF 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	271,480,070.35	-267,108,250.57	4,371,819.78
本期期初	271,480,070.35	-267,108,250.57	4,371,819.78
本期利润	-62,431,215.04	-4,546,691.93	-66,977,906.97
本期基金份额交易产生的变动数	-10,175,001.60	2,487,887.44	-7,687,114.16

其中：基金申购款	109,560,409.85	-141,698,422.82	-32,138,012.97
基金赎回款	-119,735,411.45	144,186,310.26	24,450,898.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	198,873,853.71	-269,167,055.06	-70,293,201.35

#### 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	330,864.34
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	260,104.87
其他	2,819.96
合计	593,789.17

#### 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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	99,485.44
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-2,253,733.96
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-2,154,248.52

##### 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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	78,266,665.19
减：卖出股票成本总额	76,815,555.70
减：交易费用	1,351,624.05
买卖股票差价收入	99,485.44

##### 6.4.7.11.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	3,055,770,200.00
减：现金支付申购款总额	1,586,826,048.33
减：申购股票成本总额	1,471,197,885.63

减：交易费用	-
申购差价收入	-2,253,733.96

#### 6.4.7.12 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	3,219,860,208.20
减：卖出/赎回基金成本总额	3,373,716,306.42
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	178,600.52
基金投资收益	-154,034,698.74

#### 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
	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	0.07
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	0.07

##### 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
	2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	6,510,390.83

**6.4.7.17 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	38,109.28
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	38,109.28

**6.4.7.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	-24,099,898.91
——股票投资	19,198.76
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-24,119,097.67
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-3,512,618.18
——权证投资	-
——股指期货投资	-3,512,618.18
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	-27,612,517.09

**6.4.7.19 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	48,379.00
基金转换费收入	2,440.55
合计	50,819.55

**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 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	35,803.04
信息披露费	59,672.34

证券出借违约金	-
银行汇划费	3,982.29
其他	1.33
合计	99,459.00

#### 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	基金发起人、基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东、基金销售机构
广发中证 500 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
广发期货有限公司	基金管理人控股股东的全资子公司
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人股东

#### 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	上年度可比期间
----	----	---------

	2024年1月1日至2024年6月 30日	2023年1月1日至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	556,036.69	496,900.69
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,592,827.69	1,824,670.64
应支付基金管理人的净管理费	-1,036,791.00	-1,327,769.95

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。本基金管理费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值—前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值，若为负数，则 E 取 0

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	111,207.34	99,380.13

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。本基金托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值—前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值，若为负数，则 E 取 0

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节

假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 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 2024年1月1日至2024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 500ETF 联接（LOF）A	广发中证 500ETF 联接 C	合计
广发基金管理有限公司	-	307,787.64	307,787.64
中国工商银行股份有限公司	-	8,275.20	8,275.20
广发证券股份有限公司	-	4,624.55	4,624.55
合计	-	320,687.39	320,687.39
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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 500ETF 联接（LOF）A	广发中证 500ETF 联接 C	合计
广发基金管理有限公司	-	78,373.01	78,373.01
中国工商银行股份有限公司	-	41.05	41.05
广发证券股份有限公司	-	5,769.77	5,769.77
合计	-	84,183.83	84,183.83

注：本基金 A 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 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性划出，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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	
	2024年1月1日至2024年6月30日	广发中证500ETF 联接（LOF）A	2023年1月1日至2023年6月30日	广发中证500ETF联 接C
报告期初持有的基 金份额	-	9,441,979.04	-	-
报告期内申购/买入 总份额	-	-	-	-
报告期内因拆分变 动份额	-	-	-	-
减：报告期内赎回/ 卖出总份额	-	-	-	-
报告期末持有的基 金份额	-	9,441,979.04	-	-
报告期末持有的基 金份额占基金总份 额比例	-	0.93%	-	-

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 500ETF 联接（LOF）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 500ETF 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。

#### 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	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023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
中国工商银行股份有限公司	162,388,189. 34	330,864.34	178,633,081. 15	327,849.98

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商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

本基金本报告期内及上年可比期间内通过广发期货有限公司进行期货交易，该关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立，该类交易的佣金按合同约定的佣金率进行计算。

本基金本报告期末持有 1,426,469,222.00 份目标 ETF 基金广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金份额（2023 年 12 月 31 日：1,429,970,521.00 份），占其总份额的比例为 74.96%（2023 年 12 月 31 日：81.11%）。

本基金本报告期末持有 400 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（2023 年 12 月 31 日：800 股），成本总额为人民币 6,318.47 元（2023 年 12 月 31 日：13,293.33 元），估值总额为 6,360.00 元（2023 年 12 月 31 日：13,312.00 元），占本基金资产净值的比例为 0.00%（2023 年 12 月 31 日：0.00%）。

#### 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（2024 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：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
113685	升 24 转债	2024-06-17	1 个月内(含)	新债流通受限	100.00	100.01	10.00	1,000.00	1,000.07	-

注：截至本报告期末 2024 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股

票和权证。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 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 2024 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 2024 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 2024 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，在董事会下设立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；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规稽核部、金融工程与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。合规稽核部、金融工程与风险管理部对公司总经理负责。本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总经理和风险控制委员会、督察长、合规稽核部、金融工程与风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

#### 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，将对基金资产造成的损失。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。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。

#### 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均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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	1,000.07	-
未评级	-	-
合计	1,000.07	-

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。

#### 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份额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。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，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品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，资产变现能力强。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金投资标的为具有良好流动性的金融工具，主要投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，本身具有较好的流动性；在投资限制中采取多种措施保障本基金分散投资；同时，本基金投资策略成熟，能够支持不同市场情形下的投资者赎回要求。实际投资中，本基金投资组合的流动性能够与本基金申购和赎回的安排相匹配。

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

#### 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中债券的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
货币资金	162,388,189.34	-	-	-	162,388,189.34
结算备付金	23,710,739.42	-	-	-	23,710,739.42
存出保证金	10,739,376.80	-	-	-	10,739,376.80
交易性金融资产	1,000.07	-	-	2,195,140,321.31	2,195,141,321.38
应收清算款	-	-	-	81,065.23	81,065.23
应收申购款	54,332.19	-	-	1,036,734.18	1,091,066.37
其他资产	-	-	-	1,581,832.35	1,581,832.35
资产总计	196,893,637.82	-	-	2,197,839,953.07	2,394,733,590.89
<b>负债</b>					
应付清算款	-	-	-	10,439,272.37	10,439,272.37
应付赎回款	-	-	-	1,016,742.99	1,016,742.99
应付管理人报酬	-	-	-	92,183.09	92,183.09
应付托管费	-	-	-	18,436.64	18,436.64
应付销售服务费	-	-	-	160,593.09	160,593.09
其他负债	-	-	-	613,310.47	613,310.47
负债总计	-	-	-	12,340,538.65	12,340,538.65
利率敏感度缺口	196,893,637.82	-	-	2,185,499,414.42	2,382,393,052.24
上年度末 2023年12月31	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

日					
<b>资产</b>					
货币资金	210,796,565.09	-	-	-	210,796,565.09
结算备付金	13,292,783.84	-	-	-	13,292,783.84
存出保证金	7,661,380.63	-	-	-	7,661,380.63
交易性金融资产	-	-	-	2,394,967,917.19	2,394,967,917.19
应收申购款	69,015.90	-	-	1,050,666.33	1,119,682.23
其他资产	-	-	-	5,921,824.94	5,921,824.94
资产总计	231,819,745.46	-	-	2,401,940,408.46	2,633,760,153.92
<b>负债</b>					
应付清算款	-	-	-	10,438,616.86	10,438,616.86
应付赎回款	-	-	-	8,865,600.85	8,865,600.85
应付管理人报酬	-	-	-	98,674.25	98,674.25
应付托管费	-	-	-	19,734.87	19,734.87
应付销售服务费	-	-	-	184,940.61	184,940.61
其他负债	-	-	-	324,979.31	324,979.31
负债总计	-	-	-	19,932,546.75	19,932,546.75
利率敏感度缺口	231,819,745.46	-	-	2,382,007,861.71	2,613,827,607.17

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		上年度末	
	2024 年 6 月 30 日	占基金资产净值比例 (%)	2023 年 12 月 31 日	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,799,774.02	0.12	8,776,108.80	0.34
交易性金融资产—基金投资	2,192,340,547.29	92.02	2,386,191,808.39	91.29
交易性金融资产—债券投资	1,000.07	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	-	-	-	-
<b>合计</b>	<b>2,195,141,321.38</b>	<b>92.14</b>	<b>2,394,967,917.19</b>	<b>91.63</b>

#### 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			
	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）		
分析		本期末	上年度末	
		2024 年 6 月 30 日	2023 年 12 月 31 日	
	上升 5%	116,131,981.63	129,931,254.46	
	下降 5%	-116,131,981.63	-129,931,254.46	

#### 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 2024 年 6 月 30 日
第一层次	2,195,140,321.31
第二层次	1,000.07
第三层次	-
合计	2,195,141,321.38

#### 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	2,799,774.02	0.12
	其中：普通股	2,788,731.02	0.12
	存托凭证	11,043.00	0.00
2	基金投资	2,192,340,547.29	91.55
3	固定收益投资	1,000.07	0.00
	其中：债券	1,000.07	0.00
	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	186,098,928.76	7.77
8	其他各项资产	13,493,340.75	0.56
9	合计	2,394,733,590.89	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 500 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	2,192,340,547.29	92.02

## 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	9,091.00	0.00
B	采矿业	111,579.00	0.00
C	制造业	1,857,222.00	0.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	83,292.00	0.00
E	建筑业	28,969.00	0.00
F	批发和零售业	59,973.32	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	55,854.00	0.00
H	住宿和餐饮业	9,536.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	182,429.20	0.01
J	金融业	178,571.50	0.01
K	房地产业	29,394.00	0.00
L	租赁和商务服务业	13,693.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	63,144.00	0.00

N	水利、环境和公共设施管理业	23,772.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	10,843.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	76,779.00	0.00
S	综合	5,632.00	0.00
	合计	2,799,774.02	0.12

注：上述行业分类的数据已包含存托凭证。

### 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	300502	新易盛	1,200	126,660.00	0.01
2	300394	天孚通信	840	74,272.80	0.00
3	300207	欣旺达	3,000	45,510.00	0.00
4	301236	软通动力	1,200	42,252.00	0.00
5	300003	乐普医疗	2,700	40,068.00	0.00
6	300474	景嘉微	600	37,938.00	0.00
7	300136	信维通信	1,800	35,244.00	0.00
8	300724	捷佳伟创	600	32,406.00	0.00
9	300073	当升科技	900	30,879.00	0.00
10	300012	华测检测	3,000	30,180.00	0.00
10	300001	特锐德	1,500	30,180.00	0.00
11	300699	光威复材	1,200	29,796.00	0.00
12	300146	汤臣倍健	2,100	28,455.00	0.00
13	300866	安克创新	390	27,771.90	0.00
14	300395	菲利华	900	27,675.00	0.00
15	300114	中航电测	600	27,150.00	0.00
16	300285	国瓷材料	1,500	26,775.00	0.00
17	300144	宋城演艺	3,300	26,499.00	0.00
18	300037	新宙邦	900	25,704.00	0.00
19	300383	光环新网	3,000	25,350.00	0.00
20	300251	光线传媒	3,000	25,230.00	0.00
21	300487	蓝晓科技	600	25,056.00	0.00
22	300529	健帆生物	900	24,489.00	0.00
23	300604	长川科技	900	24,453.00	0.00

24	300373	扬杰科技	600	23,340.00	0.00
25	300118	东方日升	1,800	21,780.00	0.00
26	300253	卫宁健康	3,600	21,240.00	0.00
27	300676	华大基因	600	21,006.00	0.00
28	300390	天华新能	1,200	20,616.00	0.00
29	300009	安科生物	2,400	20,496.00	0.00
30	300568	星源材质	2,400	19,680.00	0.00
31	601058	赛轮轮胎	1,400	19,600.00	0.00
32	300558	贝达药业	600	19,530.00	0.00
33	300296	利亚德	4,200	18,900.00	0.00
34	300601	康泰生物	1,200	18,732.00	0.00
35	600066	宇通客车	700	18,060.00	0.00
36	300070	碧水源	4,200	17,598.00	0.00
37	601077	渝农商行	3,300	16,566.00	0.00
38	601168	西部矿业	900	16,155.00	0.00
39	300748	金力永磁	1,200	15,552.00	0.00
40	600988	赤峰黄金	900	14,706.00	0.00
41	601233	桐昆股份	900	14,364.00	0.00
42	600418	江淮汽车	900	14,256.00	0.00
43	600157	永泰能源	12,000	14,160.00	0.00
44	300595	欧普康视	900	14,112.00	0.00
45	601567	三星医疗	400	14,000.00	0.00
46	300776	帝尔激光	300	13,788.00	0.00
47	600096	云天化	700	13,594.00	0.00
48	688525	佰维存储	200	12,830.00	0.00
49	601555	东吴证券	2,100	12,390.00	0.00
50	600765	中航重机	600	12,240.00	0.00
51	300357	我武生物	600	12,132.00	0.00
52	600352	浙江龙盛	1,400	12,026.00	0.00
53	600398	海澜之家	1,300	12,012.00	0.00
54	688099	晶晨股份	200	11,864.00	0.00
55	601128	常熟银行	1,550	11,733.50	0.00
56	688777	中控技术	300	11,310.00	0.00
57	601108	财通证券	1,700	11,237.00	0.00
58	688390	固德威	200	11,224.00	0.00
59	600885	宏发股份	400	11,072.00	0.00
60	689009	九号公司	300	11,043.00	0.00
61	600873	梅花生物	1,100	11,022.00	0.00
62	300438	鹏辉能源	600	11,004.00	0.00
63	600879	航天电子	1,400	10,878.00	0.00
64	600177	雅戈尔	1,500	10,680.00	0.00
65	601577	长沙银行	1,300	10,634.00	0.00
66	600109	国金证券	1,400	10,570.00	0.00
67	600079	人福医药	600	10,302.00	0.00

68	300682	朗新集团	1,200	10,212.00	0.00
69	600497	驰宏锌锗	1,900	10,146.00	0.00
70	600529	山东药玻	400	10,136.00	0.00
71	603979	金诚信	200	10,106.00	0.00
72	600985	淮北矿业	600	10,044.00	0.00
73	600348	华阳股份	1,000	9,960.00	0.00
74	600060	海信视像	400	9,896.00	0.00
75	603606	东方电缆	200	9,762.00	0.00
76	600642	申能股份	1,100	9,713.00	0.00
77	688213	思特威-W	200	9,700.00	0.00
78	603816	顾家家居	300	9,687.00	0.00
79	688114	华大智造	200	9,482.00	0.00
80	601615	明阳智能	1,000	9,440.00	0.00
81	688234	天岳先进	200	9,384.00	0.00
82	603087	甘李药业	200	9,264.00	0.00
83	601990	南京证券	1,200	9,216.00	0.00
84	688065	凯赛生物	200	9,078.00	0.00
85	600839	四川长虹	2,000	8,980.00	0.00
86	600536	中国软件	300	8,976.00	0.00
87	601666	平煤股份	800	8,960.00	0.00
88	601717	郑煤机	600	8,880.00	0.00
89	601179	中国西电	1,100	8,844.00	0.00
90	688180	君实生物-U	300	8,715.00	0.00
91	688331	荣昌生物	200	8,640.00	0.00
92	600549	厦门钨业	500	8,625.00	0.00
93	603290	斯达半导	100	8,611.00	0.00
94	600521	华海药业	500	8,525.00	0.00
95	601997	贵阳银行	1,600	8,432.00	0.00
96	600298	安琪酵母	300	8,379.00	0.00
97	600038	中直股份	200	8,222.00	0.00
98	601696	中银证券	900	8,172.00	0.00
99	601162	天风证券	3,700	8,066.00	0.00
100	601198	东兴证券	1,000	7,960.00	0.00
101	688063	派能科技	200	7,942.00	0.00
102	600021	上海电力	800	7,912.00	0.00
103	600863	内蒙华电	1,700	7,888.00	0.00
104	603179	新泉股份	200	7,848.00	0.00
105	603589	口子窖	200	7,838.00	0.00
106	600820	隧道股份	1,200	7,836.00	0.00
107	688122	西部超导	200	7,664.00	0.00
108	600141	兴发集团	400	7,632.00	0.00
109	600563	法拉电子	100	7,618.00	0.00
110	300888	稳健医疗	300	7,590.00	0.00
111	601000	唐山港	1,600	7,520.00	0.00

112	600369	西南证券	2,100	7,518.00	0.00
113	600862	中航高科	400	7,512.00	0.00
114	688220	翱捷科技-U	200	7,492.00	0.00
115	603345	安井食品	100	7,431.00	0.00
116	600699	均胜电子	500	7,410.00	0.00
117	600895	张江高科	400	7,392.00	0.00
118	600704	物产中大	1,700	7,378.00	0.00
119	601966	玲珑轮胎	400	7,348.00	0.00
120	600546	山煤国际	500	7,310.00	0.00
121	600970	中材国际	600	7,236.00	0.00
122	600153	建发股份	800	7,144.00	0.00
123	600583	海油工程	1,200	7,092.00	0.00
123	600155	华创云信	1,200	7,092.00	0.00
124	603596	伯特利	180	7,002.00	0.00
125	605358	立昂微	300	6,942.00	0.00
126	600392	盛和资源	800	6,896.00	0.00
127	603160	汇顶科技	100	6,875.00	0.00
128	600872	中炬高新	300	6,807.00	0.00
129	600380	健康元	600	6,702.00	0.00
130	600637	东方明珠	1,100	6,688.00	0.00
131	600118	中国卫星	300	6,669.00	0.00
132	601216	君正集团	1,800	6,642.00	0.00
133	600143	金发科技	1,000	6,610.00	0.00
134	688297	中无人机	200	6,606.00	0.00
135	600329	达仁堂	200	6,478.00	0.00
136	600282	南钢股份	1,300	6,474.00	0.00
137	600516	方大炭素	1,500	6,465.00	0.00
138	600998	九州通	1,319	6,436.72	0.00
139	600008	首创环保	2,400	6,432.00	0.00
140	601231	环旭电子	400	6,420.00	0.00
141	601665	齐鲁银行	1,300	6,383.00	0.00
141	603939	益丰药房	260	6,383.00	0.00
142	603156	养元饮品	300	6,381.00	0.00
143	600498	烽火通信	400	6,360.00	0.00
143	603228	景旺电子	200	6,360.00	0.00
144	600566	济川药业	200	6,342.00	0.00
145	600909	华安证券	1,500	6,315.00	0.00
146	600535	天士力	500	6,290.00	0.00
147	601016	节能风电	2,100	6,279.00	0.00
148	688385	复旦微电	200	6,276.00	0.00
149	600170	上海建工	2,900	6,235.00	0.00
150	600582	天地科技	900	6,201.00	0.00
151	603568	伟明环保	300	6,174.00	0.00
152	600511	国药股份	200	6,158.00	0.00

153	601156	东航物流	300	6,105.00	0.00
154	600580	卧龙电驱	500	6,075.00	0.00
155	603338	浙江鼎力	100	6,042.00	0.00
156	601991	大唐发电	2,000	6,020.00	0.00
157	603000	人民网	300	5,997.00	0.00
158	688772	珠海冠宇	400	5,960.00	0.00
159	601933	永辉超市	2,400	5,952.00	0.00
160	600373	中文传媒	400	5,936.00	0.00
161	688248	南网科技	200	5,926.00	0.00
162	603893	瑞芯微	100	5,917.00	0.00
163	600499	科达制造	700	5,901.00	0.00
164	301029	怡合达	300	5,898.00	0.00
165	603298	杭叉集团	300	5,892.00	0.00
166	600867	通化东宝	700	5,859.00	0.00
167	600166	福田汽车	2,600	5,850.00	0.00
167	600325	华发股份	900	5,850.00	0.00
168	600612	老凤祥	100	5,819.00	0.00
169	300861	美畅股份	300	5,805.00	0.00
169	601636	旗滨集团	900	5,805.00	0.00
170	600129	太极集团	200	5,784.00	0.00
170	601456	国联证券	600	5,784.00	0.00
171	600737	中粮糖业	600	5,754.00	0.00
172	600816	建元信托	2,100	5,691.00	0.00
173	600004	白云机场	600	5,688.00	0.00
174	600486	扬农化工	100	5,645.00	0.00
175	600673	东阳光	800	5,632.00	0.00
176	688002	睿创微纳	200	5,594.00	0.00
177	600801	华新水泥	400	5,500.00	0.00
178	603885	吉祥航空	500	5,495.00	0.00
179	600707	彩虹股份	800	5,448.00	0.00
180	603077	和邦生物	3,300	5,445.00	0.00
181	603882	金域医学	200	5,438.00	0.00
182	601866	中远海发	2,100	5,418.00	0.00
183	600763	通策医疗	100	5,405.00	0.00
184	688521	芯原股份	200	5,350.00	0.00
185	601958	金钼股份	500	5,205.00	0.00
186	600435	北方导航	600	5,172.00	0.00
187	600655	豫园股份	1,000	5,150.00	0.00
188	603927	中科软	280	5,065.20	0.00
189	600131	国网信通	300	5,061.00	0.00
190	600739	辽宁成大	600	5,022.00	0.00
191	600755	厦门国贸	700	5,019.00	0.00
192	600598	北大荒	400	4,996.00	0.00
193	600416	湘电股份	500	4,970.00	0.00

194	601098	中南传媒	400	4,968.00	0.00
194	688349	三一重能	200	4,968.00	0.00
195	600258	首旅酒店	400	4,940.00	0.00
196	601880	辽港股份	4,000	4,920.00	0.00
197	600884	杉杉股份	600	4,872.00	0.00
198	600390	五矿资本	1,200	4,860.00	0.00
199	601611	中国核建	600	4,854.00	0.00
200	600995	南网储能	500	4,830.00	0.00
201	688561	奇安信-U	200	4,724.00	0.00
202	603486	科沃斯	100	4,718.00	0.00
203	600859	王府井	400	4,696.00	0.00
204	603225	新凤鸣	300	4,677.00	0.00
205	600483	福能股份	400	4,664.00	0.00
206	688005	容百科技	200	4,656.00	0.00
207	603658	安图生物	100	4,607.00	0.00
208	600754	锦江酒店	200	4,596.00	0.00
209	600848	上海临港	500	4,555.00	0.00
210	603858	步长制药	300	4,545.00	0.00
210	600901	江苏金租	900	4,545.00	0.00
211	600968	海油发展	1,100	4,532.00	0.00
212	600399	抚顺特钢	800	4,504.00	0.00
212	601598	中国外运	800	4,504.00	0.00
213	601212	白银有色	1,600	4,448.00	0.00
214	601155	新城控股	500	4,435.00	0.00
215	600271	航天信息	600	4,416.00	0.00
216	600528	中铁工业	600	4,392.00	0.00
217	601928	凤凰传媒	400	4,384.00	0.00
218	688538	和辉光电-U	2,200	4,356.00	0.00
219	600977	中国电影	400	4,304.00	0.00
220	600959	江苏有线	1,600	4,224.00	0.00
221	603456	九洲药业	300	4,116.00	0.00
222	601118	海南橡胶	900	4,095.00	0.00
223	600056	中国医药	400	4,048.00	0.00
224	603728	鸣志电器	100	4,023.00	0.00
225	600906	财达证券	700	4,011.00	0.00
226	600062	华润双鹤	200	3,916.00	0.00
227	603379	三美股份	100	3,914.00	0.00
228	600517	国网英大	900	3,897.00	0.00
229	601399	国机重装	1,500	3,870.00	0.00
230	688567	孚能科技	400	3,840.00	0.00
230	600098	广州发展	600	3,840.00	0.00
231	600871	石化油服	2,200	3,828.00	0.00
232	601298	青岛港	400	3,824.00	0.00
233	600377	宁沪高速	300	3,780.00	0.00

234	603712	七一二	200	3,638.00	0.00
235	600208	新湖中宝	2,300	3,634.00	0.00
236	603737	三棵树	100	3,627.00	0.00
237	600967	内蒙一机	500	3,600.00	0.00
238	600578	京能电力	1,100	3,564.00	0.00
238	603707	健友股份	300	3,564.00	0.00
239	600315	上海家化	200	3,556.00	0.00
240	601019	山东出版	300	3,546.00	0.00
241	600350	山东高速	400	3,540.00	0.00
242	600022	山东钢铁	2,900	3,538.00	0.00
243	600925	苏能股份	700	3,535.00	0.00
244	600663	陆家嘴	400	3,528.00	0.00
245	688006	杭可科技	200	3,490.00	0.00
245	600500	中化国际	1,000	3,490.00	0.00
246	601106	中国一重	1,500	3,465.00	0.00
247	601608	中信重工	900	3,429.00	0.00
248	601965	中国汽研	200	3,378.00	0.00
249	601568	北元集团	900	3,339.00	0.00
250	600316	洪都航空	200	3,326.00	0.00
251	688425	铁建重工	900	3,312.00	0.00
252	688172	燕东微	200	3,236.00	0.00
253	603218	日月股份	300	3,081.00	0.00
254	603517	绝味食品	200	3,080.00	0.00
255	601992	金隅集团	2,200	3,014.00	0.00
256	600095	湘财股份	500	2,980.00	0.00
257	603650	彤程新材	100	2,955.00	0.00
258	600827	百联股份	400	2,952.00	0.00
259	603883	老百姓	160	2,937.60	0.00
260	600032	浙江新能	400	2,912.00	0.00
261	600378	昊华科技	100	2,890.00	0.00
262	600126	杭钢股份	700	2,877.00	0.00
263	603233	大参林	200	2,860.00	0.00
264	600339	中油工程	900	2,808.00	0.00
265	600481	双良节能	600	2,802.00	0.00
266	603529	爱玛科技	100	2,733.00	0.00
267	603127	昭衍新药	200	2,654.00	0.00
268	600808	马钢股份	1,300	2,626.00	0.00
269	603056	德邦股份	200	2,620.00	0.00
270	601228	广州港	800	2,440.00	0.00
271	688779	长远锂科	500	2,315.00	0.00
272	600928	西安银行	700	2,289.00	0.00
273	603317	天味食品	200	2,282.00	0.00
274	600927	永安期货	200	2,230.00	0.00
275	603305	旭升集团	200	2,112.00	0.00

276	688387	信科移动-U	400	2,016.00	0.00
277	601139	深圳燃气	300	2,004.00	0.00
278	600764	中国海防	100	1,963.00	0.00
279	600299	安迪苏	200	1,940.00	0.00
280	601858	中国科传	100	1,912.00	0.00
281	603185	弘元绿能	100	1,709.00	0.00
282	600956	新天绿能	200	1,634.00	0.00
283	601828	美凯龙	600	1,530.00	0.00
284	603688	石英股份	50	1,480.50	0.00
285	601158	重庆水务	300	1,440.00	0.00
286	603826	坤彩科技	40	1,158.80	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	601058	赛轮轮胎	19,051,438.88	0.73
2	601168	西部矿业	17,245,990.00	0.66
3	600157	永泰能源	14,647,682.00	0.56
4	601077	渝农商行	14,052,673.00	0.54
5	601555	东吴证券	14,051,475.00	0.54
6	600160	巨化股份	13,852,426.00	0.53
7	600988	赤峰黄金	13,778,865.06	0.53
8	600418	江淮汽车	13,608,996.18	0.52
9	600066	宇通客车	13,442,229.95	0.51
10	600096	云天化	12,661,873.00	0.48
11	601108	财通证券	12,554,877.20	0.48
12	600885	宏发股份	11,841,039.00	0.45
13	600415	小商品城	11,695,738.00	0.45
14	688114	华大智造	11,683,899.55	0.45
15	300750	宁德时代	11,679,741.50	0.45
16	601233	桐昆股份	11,659,326.00	0.45
17	600109	国金证券	11,361,009.00	0.43
18	600482	中国动力	11,334,924.98	0.43
19	600352	浙江龙盛	11,304,173.00	0.43
20	603939	益丰药房	11,233,493.40	0.43

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	300750	宁德时代	11,638,383.00	0.45
2	300760	迈瑞医疗	4,693,531.00	0.18
3	300059	东方财富	4,693,464.00	0.18
4	300124	汇川技术	3,191,391.00	0.12
5	300498	温氏股份	2,940,597.00	0.11
6	300274	阳光电源	2,555,765.00	0.10
7	300308	中际旭创	2,538,502.48	0.10
8	300015	爱尔眼科	1,671,517.26	0.06
9	300122	智飞生物	1,601,371.50	0.06
10	300014	亿纬锂能	1,334,012.00	0.05
11	300896	爱美客	1,289,604.00	0.05
12	688256	寒武纪-U	1,067,944.52	0.04
13	300394	天孚通信	996,690.00	0.04
14	300502	新易盛	967,876.00	0.04
15	300418	昆仑万维	933,280.00	0.04
16	300408	三环集团	889,440.00	0.03
17	300782	卓胜微	799,261.06	0.03
18	300142	沃森生物	765,974.00	0.03
19	300347	泰格医药	741,675.00	0.03
20	300433	蓝思科技	647,507.00	0.02

### 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	1,542,017,907.79
卖出股票收入（成交）总额	78,266,665.19

### 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	-	-
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）	1,000.07	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,000.07	0.00

### 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	113685	升 24 转债	10	1,000.07	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

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 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** 本基金投资的前十名证券的发行主体中，华测检测认证集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局、中国人民银行分支行等监管机构的处罚。

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。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**7.13.2** 本报告期内，基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

### 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	10,739,376.80
2	应收清算款	81,065.23
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,091,066.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	1,581,832.35
9	合计	13,493,340.75

### 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 500ETF 联接 (LOF) A	63,452	19,287.74	412,629.5 57.64	33.72%	811,216.2 49.93	66.28%
广发中证 500ETF 联接 C	61,369	16,523.76	655,424.9 55.02	64.63%	358,621.9 41.68	35.37%
合计	124,821	17,928.82	1,068,054 ,512.66	47.73%	1,169,838, 191.61	52.27%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

广发中证 500ETF 联接（LOF）A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	蔡静岚	306,734.00	2.88%
2	吴本明	300,018.00	2.82%
3	赵天相	220,000.00	2.07%
4	梁少梅	209,006.00	1.96%
5	庄晓静	200,232.00	1.88%
6	黄乔	200,012.00	1.88%
7	洪桂芳	200,000.00	1.88%
8	尹晓林	150,009.00	1.41%
9	孙婧	149,800.00	1.41%
10	陈永宏	148,004.00	1.39%

### 8.3 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 500ETF 联接（LOF）A	538,785.46	0.0440%
	广发中证 500ETF 联接 C	127,661.91	0.0126%
	合计	666,447.37	0.0298%

#### 8.4 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	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、基金经理和研究部门负责人持有本开放式基金	广发中证 500ETF 联接（LOF）A	0
	广发中证 500ETF 联接 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	广发中证 500ETF 联接（LOF）A	0
	广发中证 500ETF 联接 C	0
	合计	0

### 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发中证 500ETF 联接（LOF）A	广发中证 500ETF 联接 C
基金合同生效日（2009 年 11 月 26 日）基金份额总额	8,635,797,223.98	-
本报告期期初基金份额总额	1,216,903,093.75	1,067,691,708.81
本报告期基金总申购份额	52,020,509.06	459,666,550.47
减：本报告期基金总赎回份额	45,077,795.24	513,311,362.58
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,223,845,807.57	1,014,046,896.70

## 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 2024 年 5 月 14 日发布公告，葛长伟先生自 2024 年 5 月 13 日起任公司董事长；于 2024 年 6 月 8 日发布公告，项军先生自 2024 年 6 月 7 日起任公司督察长。

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、基金托管业务的诉讼事项。

### 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重大影响事件

本基金为联接基金，目标基金为广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金。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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易 单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股 票成交总 额的比例	佣金	占当期佣 金总量的 比例	
华泰证券	5	1,620,284,572.98	100.00%	1,208,671.56	100.00%	-
国联证券	1	-	-	-	-	-

广发证券	8	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
兴业证券	4	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
东亚前海证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	3	-	-	-	-	-
中信建投证券	4	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	4	-	-	-	-	-
华兴证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国新证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	减少 2 个
华福证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
中国银河	2	-	-	-	-	-
太平洋	2	-	-	-	-	-
光大证券	3	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	减少 2 个
国投证券	5	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
财信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	3	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
诚通证券	3	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-

湘财证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	5	-	-	-	-	-
中银证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
高盛中国	1	-	-	-	-	新增 1 个
中原证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	4	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
中金财富	3	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	3	-	-	-	-	-
申万宏源西部	1	-	-	-	-	新增 1 个
渤海证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	4	-	-	-	-	-
中泰证券	4	-	-	-	-	减少 1 个
东海证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-

注：1、交易单元选择标准：

- (1) 财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；
- (2) 经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (3) 具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；
- (4) 具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；
- (6) 能提供其他基金运作和管理所需的服务。

2、交易单元选择流程：

- (1) 对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。
- (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
华泰 证券	1,000.00	100.00 %	-	-	-	-	3,364,068 ,197.72	100.00 %
国联 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华林 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东亚 前海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国银河	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-

东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛中国	-	-	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
申万宏源西部	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-

## 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 2023 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-01-19
2	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-29
3	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-04-19

## 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	20240101-202401 22,20240229-2024 0630	479,47 8,231.0 7	-	-	479,478,231. 07	21.43%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>1、当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；</p> <p>2、在极端情况下，基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；</p> <p>3、当个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；</p> <p>4、在特定情况下，当个别投资者大额赎回，可能导致本基金资产规模和基金份额持有人数量未能满足合同约定，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；</p> <p>5、在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时，持有基金份额占比较高的投资者可能拥有较大话语权。</p> <p>本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管理机制，切实保护持有人利益。</p>							

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会《关于核准广发中证 500 指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会决议的批复》
- 2.《广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》
- 3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- 4.《广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)托管协议》
- 5.法律意见书
- 6.基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7.基金托管人业务资格批件、营业执照

### 12.2 存放地点

广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

### 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](http://www.gffunds.com.cn)。

广发基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日