

# 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

## 2026 年第 2 季度报告

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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年七月二十日

## § 1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 7 月 16 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 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |                                                                    |
|------------|--------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 广发中证国新港股通央企红利 ETF                                                  |
| 场内简称       | 红利香港                                                               |
| 基金主代码      | 520900                                                             |
| 交易代码       | 520900                                                             |
| 基金运作方式     | 交易型开放式                                                             |
| 基金合同生效日    | 2024 年 6 月 26 日                                                    |
| 报告期末基金份额总额 | 1,798,675,047.00 份                                                 |
| 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。 |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>本基金投资于标的指数成份股、备选成份股（含存托凭证）的比例不低于基金资产净值的 90%且不低于非现金基金资产的 80%。</p> <p>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 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。</p> <p>具体投资策略包括：1、股票（含存托凭证）投资策略；2、债券投资策略；3、资产支持证券投资策略；4、金融衍生品投资策略；5、参与转融通证券出借业务策略。</p>                                                                                                         |
| 业绩比较基准 | 中证国新港股通央企红利指数同期收益率（使用估值汇率折算）                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 风险收益特征 | <p>本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。</p> <p>本基金投资于港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。</p> |
| 基金管理人  | 广发基金管理有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 基金托管人  | 招商银行股份有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |

注：本基金的扩位证券简称为“港股通红利 ETF 广发”。

§ 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<br>(2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日) |
|----------------|-----------------------------------------|
| 1.本期已实现收益      | 27,251,385.69                           |
| 2.本期利润         | -274,178,655.44                         |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.1646                                 |
| 4.期末基金资产净值     | 1,660,599,546.25                        |
| 5.期末基金份额净值     | 0.9232                                  |

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

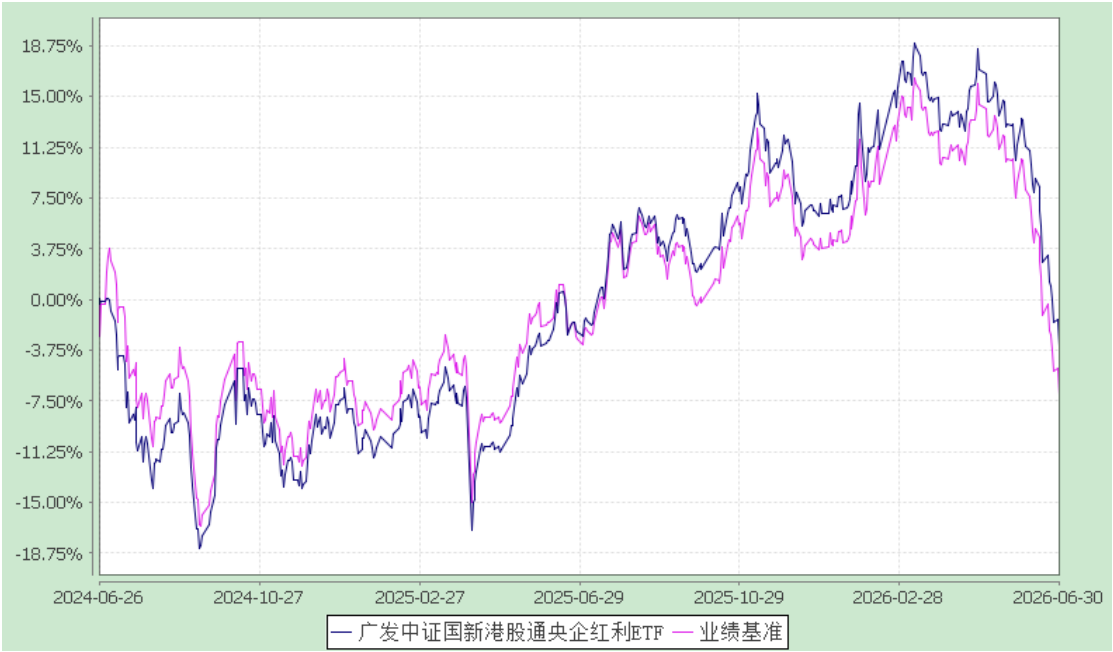
| 阶段    | 净值增长率①  | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③   | ②-④    |
|-------|---------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | -14.19% | 0.92%     | -15.54%    | 0.96%         | 1.35% | -0.04% |
| 过去六个  | -9.17%  | 1.08%     | -10.44%    | 1.11%         | 1.27% | -0.03% |

| 月          |        |       |        |       |       |        |
|------------|--------|-------|--------|-------|-------|--------|
| 过去一年       | -0.79% | 0.96% | -3.92% | 0.98% | 3.13% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | -3.40% | 1.15% | -7.02% | 1.19% | 3.62% | -0.04% |

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

广发中证国新港股通央企红利交易型开放式指数证券投资基金  
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 6 月 26 日至 2026 年 6 月 30 日)



§ 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       |        |                        |
| 吕鑫 | 本基金的基金经理；广发中证智选高股息策略 | 2025-04-30  | 2026-06-17 | 10 年   | 吕鑫先生，中国籍，工学硕士，持有中国证券投资 |

|         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |            |   |      |                                                                                                                                                                                                                                 |
|---------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|---|------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|         | 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发国证通信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；广发中证半导体材料设备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；广发国证通信交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证半导体材料设备主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证 800 自由现金流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 200 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证卫星产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证智选高股息策略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 800 自由现金流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；广发国证机器人产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理 |            |   |      | 基金从业证书。曾任建信基金管理有限责任公司金融工程与指数投资部助理研究员、基金经理，大家资产管理有限责任公司权益投资部高级投资经理，广发基金管理有限公司指数投资部量化研究员、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 2025 年 4 月 30 日至 2026 年 6 月 17 日)、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基金经理(自 2025 年 4 月 30 日至 2026 年 6 月 17 日)。 |
| 霍华<br>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                                                                                                                                                                                                                                                                     | 2024-06-26 | - | 18 年 | 霍华明先生，中国籍，理学硕士，持有中国证券投资基金从业证书。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交易型开放式指                                                                                                                                |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>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；广发中证建设工程交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证建设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 A500 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</p> |  |  |  | <p>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)、广发中证建设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</p> |
|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |    |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                         |
|--|----|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | 经理 |  |  |  | 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)。 |
|--|----|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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

2.证券从业的含义遵从中国证监会及行业协会相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，通过持续完善工作制度、流程和提高技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司还通过事后分析、监察稽核和信息披露等手段加强对公平交易过程和结果的监督。在投资决策的内部控制方面，公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度，投资组合的投资标的必须来源于公司备选库，投资组合经理在授权范围内可以自

主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，按照“时间优先、价格优先、比例分配、平等对待”的原则，公平分配投资指令。公司对投资交易实施全程动态监控，通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 49 次，均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，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

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 2 季度，全球宏观环境呈现出由地缘冲突引发的供应压力逐步缓解、向阶段性缓和过渡的态势。季度内，受海峡运输波动影响，全球能源相关物流效率一度受到制约，引发市场对潜在通胀压力的关注。随着 6 月下旬相关对话与协调成果的显现，以及海峡航行秩序的初步恢复，市场情绪在季度末有所缓和。国内方面，宏观政策在这一阶段更侧重于应对外部波动带来的多重冲击。财政与货币政策或在积极缓解外部物流和能源价格波动对产业链带来的制约，并根据形势变化进行灵活调整。产业层面，外部风险的波动在一定程度上提升了市场主体对供应链安全和自主可控的重视，国产替代进程也在这一背景下得到进一步深化。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稳定性提升。港股市场方面，季度初受全球地缘局势扰动与外部流动性波动影响，避险情绪一度推高了市场风险溢价。6 月以

来，市场此前对于冲突长期化的担忧有所减弱，风险溢价呈现出微弱的边际回落迹象，投资者的风险偏好或正处于缓慢修复的窗口期。

2026 年 2 季度，央企市值管理进入常态化执行阶段，政策导向从释放短期改革预期，转向评估外部压力下的经营稳健性与现金流可持续性。产业端，受地缘余波与海峡物流受限影响，多数行业仍承压于供应链牵制与成本波动。但能源、通信、公用事业等高权重央企凭经营底色消化扰动；6 月下旬航运瓶颈初步化解，这类龙头“高韧性、稳派息”特征获市场验证，防御属性与价值修复潜力逐步受到更多关注。

#### 4.5 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-14.19%，同期业绩比较基准收益率为-15.54%。

#### 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    | 1,627,096,720.68 | 95.19        |
|    | 其中：股票   | 1,627,096,720.68 | 95.19        |
| 2  | 基金投资    | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资  | -                | -            |
|    | 其中：债券   | -                | -            |
|    | 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      | 45,224,624.06    | 2.65   |
| 8 | 其他资产              | 36,913,395.44    | 2.16   |
| 9 | 合计                | 1,709,234,740.18 | 100.00 |

注：（1）上表中的权益投资项含可退替代款估值增值，而 5.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

（2）权益投资中通过港股通机制投资的港股公允价值为 1,627,096,720.68 元，占基金资产净值比例 97.98%。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别     | 公允价值（人民币）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----------|------------------|--------------|
| 能源       | 691,805,182.07   | 41.66        |
| 原材料      | 55,334,660.40    | 3.33         |
| 工业       | 282,805,707.10   | 17.03        |
| 非日常生活消费品 | -                | -            |
| 日常消费品    | 2,463,746.30     | 0.15         |
| 医疗保健     | 26,565,984.48    | 1.60         |
| 金融       | 36,527,565.09    | 2.20         |
| 信息技术     | 80,480,711.55    | 4.85         |
| 通讯业务     | 303,288,064.26   | 18.26        |
| 公用事业     | 111,359,027.68   | 6.71         |
| 房地产      | 36,466,071.75    | 2.20         |
| 合计       | 1,627,096,720.68 | 97.98        |

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

## 5.3 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  | 01088 | 中国神华     | 5,169,000  | 180,120,142.19 | 10.85 |
| 2  | 00857 | 中国石油股份   | 23,536,000 | 173,349,794.94 | 10.44 |
| 3  | 00883 | 中国海洋石油   | 9,431,000  | 166,447,115.42 | 10.02 |
| 4  | 00941 | 中国移动     | 2,371,500  | 156,851,205.65 | 9.45  |
| 5  | 00386 | 中国石油化工股份 | 35,064,000 | 121,819,348.80 | 7.34  |
| 6  | 01919 | 中远海控     | 8,385,500  | 94,754,770.59  | 5.71  |
| 7  | 06869 | 长飞光纤光缆   | 333,000    | 73,868,614.11  | 4.45  |
| 8  | 00728 | 中国电信     | 17,734,000 | 65,770,236.54  | 3.96  |
| 9  | 00762 | 中国联通     | 8,114,000  | 43,059,703.82  | 2.59  |
| 10 | 00788 | 中国铁塔     | 4,914,700  | 37,606,918.25  | 2.26  |

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.5 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 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<br>(买/卖) | 合约市值<br>(元) | 公允价值变动<br>(元) | 风险说明 |
|---------------|----|--------------|-------------|---------------|------|
| -             | -  | -            | -           | -             | -    |
| 公允价值变动总额合计(元) |    |              |             |               | -    |

|                   |           |
|-------------------|-----------|
| 股指期货投资本期收益(元)     | 14,435.75 |
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) | 83,160.00 |

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.9.2 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。

### 5.10 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。

### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | -             |
| 2  | 应收证券清算款 | 16,347,619.47 |
| 3  | 应收股利    | 20,505,283.34 |
| 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      | 36,913,395.44 |

### 5.11.4 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。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |                  |
|---------------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 1,459,175,047.00 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 512,500,000.00   |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 173,000,000.00   |
| 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               | 1,798,675,047.00 |

### § 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

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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

### §8 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

为更好地满足广大投资者的投资理财需求，根据《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》等法律法规的规定以及相关基金基金合同的约定，本基金管理人经与基金托管人协商一致，自 2026 年 4 月 9 日起下调本基金的管理费率及托管费率，同时根据最新法律法规对基金合同进行相应修改，并对上述基金基金合同等法律文件进行相应修订。详情可见本基金管理人网站（[www.gffunds.com.cn](http://www.gffunds.com.cn)）刊登的《广发基金管理有限公司关于旗下部分基金下调管理费率 and 托管费率并修订基金合同等法律文件的公告》。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

（一）中国证监会批准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募集的文件

（二）《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基金合同》

（三）《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托管协议》

（四）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](http://www.gffunds.com.cn)。

广发基金管理有限公司  
二〇二六年七月二十日