

上海证券交易所

创新产品部（基金）函〔2026〕77号

关于广发上证50交易型开放式指数证券投资基金份额折算相关事项的通知

各会员单位：

根据广发基金管理有限公司（以下简称广发基金）公告《广发基金管理有限公司关于广发上证50交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额拆分并调整最小申购、赎回单位及相关业务安排的公告》，广发上证50交易型开放式指数证券投资基金（基金代码：510950，以下简称广发上证50ETF）将于2026年4月24日（份额折算权益登记日）日末进行折算，并于次一交易日生效。上海证券交易所（以下简称本所）现就折算业务涉及的融资融券、约定购回式证券交易业务有关事项通知如下：

一、融资融券业务安排

投资者信用账户中持有的广发上证50ETF基金份额将在折算完成后按照折算比例进行调整。折算期间，会员应密切关注客户信用账户持有基金份额变化情况；会员在计算客户维持担保比

例等指标时，应确保计算的基金份额市值不受折算事项影响。

折算期间，如会员和投资者进行以广发上证 50ETF 份额为担保品的追加、提取担保物等业务，可能会出现担保物数量与预期不符的情形。投资者可后续再次发起担保品划转进行相应调整。

二、约定购回式证券交易业务安排

2026 年 4 月 23 日至 4 月 24 日，本所将根据广发基金申请暂停以广发上证 50ETF 为标的证券的约定购回式证券交易业务，包括初始交易、购回交易。在份额折算权益登记日及之前，如有存续的待购回交易，中国证券登记结算有限责任公司上海分公司将于该日根据折算比例完成份额变更登记。

请各会员单位密切关注广发上证 50ETF 折算相关事项及后续信息披露内容，按照有关要求进行处理。同时，会员应当就本通知相关事项及时与客户进行沟通，切实保护客户合法权益。

特此通知。

上海证券交易所创新产品部

2026 年 4 月 21 日