

广发基金管理有限公司

关于广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金运用股指期货进行对冲 的投资策略的执行情况公告

广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）自 2022 年 5 月 20 日进入第 30 个封闭期。截至 2022 年 8 月 5 日，本基金持有股票资产 127,797,297.53 元，占基金资产净值的比例为 70.02%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 116,788,200.00 元，占基金资产净值的比例为 63.99%。

本基金最新的股指期货交易情况（包括投资政策、持仓情况、损失情况等）、股指期货投资的特定风险，请投资者关注本基金的基金合同、更新的招募说明书及相关最新公告。

风险提示：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，也不保证最低收益。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分，并提出适当性匹配意见。投资者在投资基金前应认真阅读基金合同、招募说明书（更新）和基金产品资料概要（更新）等基金法律文件，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

特此公告。

广发基金管理有限公司

2022 年 8 月 10 日