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 2020 年 11 月 20 日进入第 24 个封闭期。截至 2021 年 1 月 29 日，本基金持有股票资产 1,474,280,366.63 元，占基金资产净值的比例为 62.22%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 1,367,142,900.00 元，占基金资产净值的比例为 57.70%。

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。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书。

特此公告。

广发基金管理有限公司

2021 年 2 月 3 日