

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 2017 年 11 月 17 日进入第 12 个封闭期，截至 2018 年 2 月 2 日，本基金持有股票资产 87,137,257.44 元，占基金资产净值的比例为

48.53%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 79,591,440.00 元，占基金资产净值的比例为 44.33%。

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、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

2018 年 2 月 6 日