

广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划

基金产品资料概要更新

编制日期：2024年10月23日

送出日期：2024年10月24日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

基金简称	广发资管价值增长灵活配置混合	基金代码	871003
基金管理人	广发证券资产管理（广东）有限公司	基金托管人	交通银行股份有限公司
基金合同生效日	2020-05-07		
基金类型	混合型	交易币种	人民币
运作方式	契约型开放式	开放频率	每个交易日，非港股通交易日除外
基金经理	刘文靓	开始担任本基金基金经理的日期	2022-11-28
		证券从业日期	2021-09-23

注：本集合计划存续期至2024年12月31日。本集合计划自2024年12月31日后，按照中国证监会有关规定执行。如2024年12月31日后，不符合法律法规或中国证监会的要求而须终止本集合计划的，无须召开份额持有人大会。

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

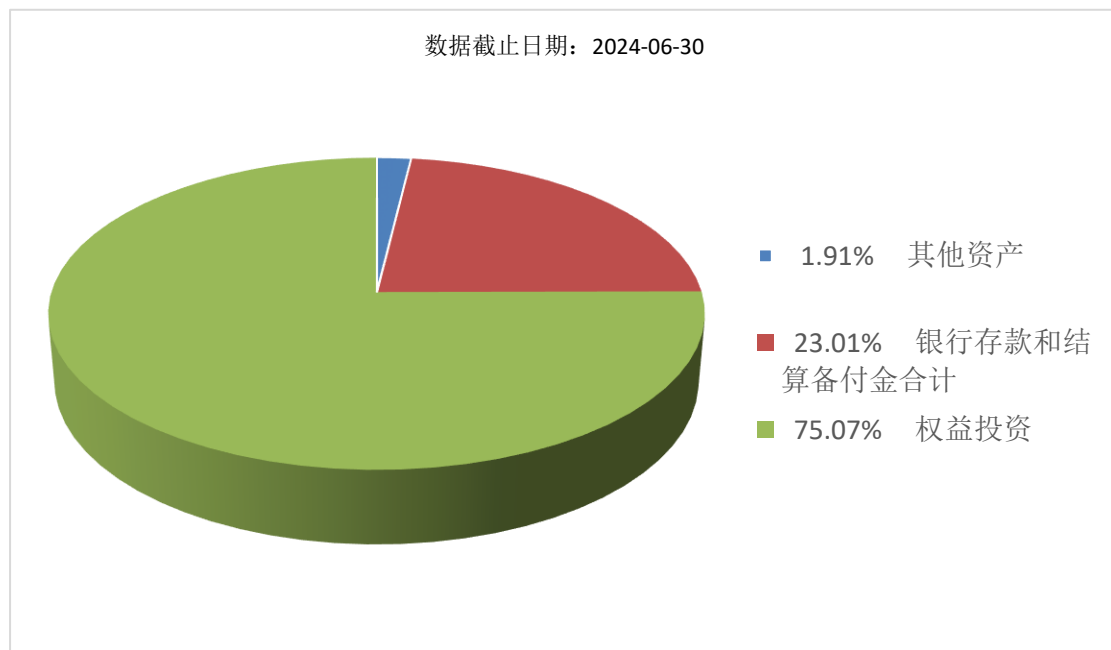
投资目标	通过主动的资产配置和价值成长策略对股票进行投资布局，实现产品资产在管理期限内稳健增值。
投资范围	本集合计划的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含主板、中小板、创业板、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的相关证券市场股票及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券、次级债及其他中国证监会允许投资的债券）、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。股票资产占集合计划资产的0-95%，港股通标的最高投资比例不超过股票资产的50%。每个交易日日终在扣除股指期货合约及股票期权保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、股

	<p>指期货合约和股票期权占用的交易保证金和应收申购款等。股指期货、股票期权的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本集合计划投资于同业存单的比例不超过集合计划资产的20%。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种或对投资比例要求发生变更，集合计划管理人在履行适当程序后，可以相应调整本集合计划的投资范围和投资比例规定。</p>
主要投资策略	1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、港股投资策略；4、固定收益类投资策略；5、新股申购投资策略；6、股指期货投资策略；7、股票期权投资策略；8、现金类管理工具投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60% + 中债总指数收益率×30% + 恒生中国企业指数收益率×10%
风险收益特征	<p>本集合计划为灵活配置混合型集合资产管理计划（大集合产品），其预期风险收益水平高于债券型基金、货币市场基金，低于股票型基金，属于中风险产品。</p> <p>本集合计划可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本集合计划还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、以及通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。</p>

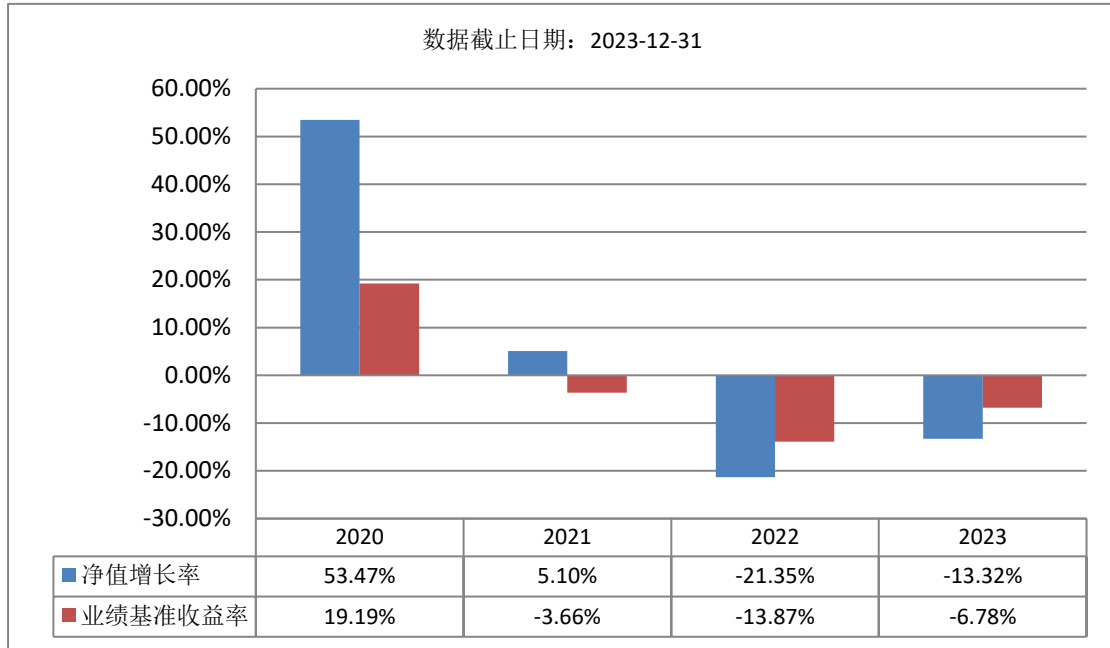
注：详见《广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划招募说明书》的“九、集合计划的投资”。

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表



(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



注：集合合同生效当年期间的相关数据按实际存续期计算。本集合计划的过往业绩不代表未来表现。

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) /持有期限 (N)	收费方式/费率	备注
申购费 (前收费)	M < 100 万元	1.00%	
	100 万元 ≤ M < 300 万元	0.50%	
	300 万元 ≤ M < 500 万元	0.20%	
	M ≥ 500 万元	0.00%	
赎回费	N < 7 天	1.50%	
	7 天 ≤ N < 30 天	0.75%	
	30 天 ≤ N < 90 天	0.60%	
	90 天 ≤ N < 180 天	0.50%	
	180 天 ≤ N < 730 天	0.30%	
	N ≥ 730 天	0.00%	

(二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率或金额	收费方
管理费	1.20%	基金管理人、销售机构

托管费	0.18%	基金托管人
审计费用	36,000.00	会计师事务所
信息披露费	120,000.00	规定披露报刊
其他费用	《集合合同》生效后与集合计划相关的律师费和诉讼费；份额持有人大会费用；集合计划的证券、股指期货交易费用；集合计划的银行汇划费用和银行账户维护费；因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；按照国家有关规定和《集合合同》约定，可以在集合计划财产中列支的其他费用。费用类别详见本集合计划《集合合同》及《招募说明书》或其更新。	
		相关服务机构

注：1、本集合计划交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从集合计划资产扣除。

2、审计费用、信息披露费为集合计划整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以集合计划定期报告披露为准。

（三）基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

基金运作综合费率（年化）
1.41%

注：本集合计划管理费、托管费率为集合计划现行费率，其他运作费用以最近一次集合计划年报披露的相关数据为基准测算。

四、风险揭示与重要提示

（一）风险揭示

本集合计划不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买本集合计划时应认真阅读本集合计划的《招募说明书》等销售文件。

本集合计划面临包括但不限于以下风险：市场风险，包括政策风险、经济周期风险、利率风险、上市公司经营风险、衍生品风险、购买力风险、信用风险等；管理风险；流动性风险；管理人因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责的风险；合规性风险；以及其他风险等。

本集合计划还面临以下特有风险：

（1）推广期及开放期本集合计划达到一定规模时，管理人有权停止认/申购。投资者可能面临因上述原因而无法参与本集合计划的风险。

（2）本集合计划存续期间，连续 20 个工作日出现份额持有人数量不满 200 人或者集合计划资产净值低于 5000 万元情形的，投资者可能面临集合计划因上述原因转换运作方式、与其他集合计划合并或者终止集合合同的风险。

（3）本合同签署后，对于法律法规规定和集合合同约定可不经份额持有人大会决议通过的事项，由管理人和托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。投资者可能面临由于上述原因发生合同变更的风险。

（4）变更集合合同涉及法律法规规定或本合同约定应经份额持有人大会决议通过的事项的，应召开份额持有人大会决议通过。部分投资者可能因为未能提供有效的联系方式或者未能将变动后的联系方式及时通知管理人，而无法及时获知合同变更事项，从而存在风险。

(5) 本集合计划合同等文书可以电子签名方式签订。无须另行签署纸质合同或其他文书。投资者应妥善保管密码,经投资者密码等有效身份验证登录投资者账户后的所有操作视同投资者本人行为,投资者承担由此产生的一切民事责任和法律后果。

(6) 集合计划参与股指期货的风险,具体包括:

1) 由于股票多头和股指期货空头头寸在流动性、风险收益特征及交易规则上的不同可能造成两个头寸对相同市场风险的反应存在差异,尤其是对大幅度的市场波动反应不一定完全同步,从而加大投资组合市场价值的短期风险。

2) 股指期货采用保证金交易的特征使投资组合的空头头寸在沪深 300 股指期货上涨时需要追加保证金,如果无法及时补足保证金将面临空头头寸被平仓的风险。

3) 使用股指期货对冲市场风险的过程中,委托财产可能因为股指期货合约与标的指数价格波动不一致而面临期现基差风险。在需要将期货合约展期时,合约平仓时的价格与下一个新合约开仓时的价格之差也存在不确定性,面临跨期基差风险。

(7) 集合计划参与股票期权的风险,具体包括市场风险、流动性风险、保证金风险、基差风险、信用风险、操作风险。

(8) 集合计划投资港股通标的的风险

本集合计划资产若投资于港股,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(汇率波动可能对集合计划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。

(9) 本集合计划自本集合合同变更生效日起存续期至 2024 年 12 月 31 日,本集合计划份额持有人将面临在 2024 年 12 月 31 日集合合同到期的风险。

(二) 重要提示

中国证监会对本集合计划合同变更的审批,并不表明其对本集合计划的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本集合计划没有风险。

本集合计划管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划财产,但不保证本集合计划一定盈利,也不保证最低收益。

本集合计划投资者自依集合计划合同取得基金份额,即成为集合计划份额持有人和集合计划合同的当事人。

本集合计划产品资料概要信息发生重大变更的,本集合计划管理人将在三个工作日内更新,其他信息发生变更的,本集合计划管理人每年更新一次。因此,本文件内容相比本集合计划的实际情况可能会存在一定的滞后,如需及时、准确获取本集合计划的相关信息,敬请同时关注本集合计划管理人发布的相关临时公告等。

五、其他资料查询方式

以下资料详见集合计划管理人网站[www.gfam.com.cn][(020)95575]

广发资管价值增长灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同、托管协议、招募说明书

定期报告,包括集合计划季度报告、中期报告和年度报告

集合计划份额净值

集合计划销售机构及联系方式

其他重要资料