

# 广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金（LOF）

## 2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年十月二十五日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	广发恒生中型股指数（LOF）
场内简称	恒生中型
基金主代码	501303
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 9 月 21 日
报告期末基金份额总额	46,175,738.47 份
投资目标	本基金采用被动式指数化投资策略，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力求实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数，以完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股

	票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。在正常市场情况下，本基金力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪误差进一步扩大。		
业绩比较基准	人民币计价的恒生综合中型股指数收益率×95%+人民币活期存款收益率（税后）×5%		
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金资产投资于港股，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、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。		
基金管理人	广发基金管理有限公司		
基金托管人	中国银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	广发恒生中型股指数（LOF）A	广发恒生中型股指数 C	广发恒生中型股指数（LOF）E
下属分级基金场内简称	恒生中型	-	-
下属分级基金的交易代码	501303	004996	018238
报告期末下属分级基金的份额总额	29,111,268.18 份	12,303,589.63 份	4,760,880.66 份

注：本基金的扩位证券简称为“恒生中型股 LOF”。

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2023年7月1日-2023年9月30日)		
	广发恒生中型股 指数（LOF）A	广发恒生中型股 指数 C	广发恒生中型股 指数（LOF）E
1.本期已实现收益	-196,852.43	-91,499.29	-54,005.31
2.本期利润	-1,078,877.18	-488,316.52	149,246.78
3.加权平均基金份额 本期利润	-0.0385	-0.0385	0.0516
4.期末基金资产净值	22,474,693.25	9,230,820.48	3,643,247.53
5.期末基金份额净值	0.7720	0.7503	0.7652

注：（1）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（2）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

###### 1、广发恒生中型股指数（LOF）A:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-4.87%	1.02%	-3.93%	1.09%	-0.94%	-0.07%
过去六个月	-7.14%	0.99%	-9.09%	1.06%	1.95%	-0.07%

过去一年	5.16%	1.30%	4.81%	1.42%	0.35%	-0.12%
过去三年	-18.25%	1.40%	-20.99%	1.49%	2.74%	-0.09%
过去五年	-14.44%	1.41%	-17.73%	1.47%	3.29%	-0.06%
自基金合同生效起至今	-22.80%	1.36%	-25.54%	1.43%	2.74%	-0.07%

## 2、广发恒生中型股指数 C:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-5.00%	1.02%	-3.93%	1.09%	-1.07%	-0.07%
过去六个月	-7.42%	0.99%	-9.09%	1.06%	1.67%	-0.07%
过去一年	4.54%	1.30%	4.81%	1.42%	-0.27%	-0.12%
过去三年	-19.70%	1.40%	-20.99%	1.49%	1.29%	-0.09%
过去五年	-16.76%	1.41%	-17.73%	1.47%	0.97%	-0.06%
自基金合同生效起至今	-24.97%	1.36%	-25.54%	1.43%	0.57%	-0.07%

## 3、广发恒生中型股指数（LOF）E:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-4.91%	1.02%	-3.93%	1.09%	-0.98%	-0.07%
自基金合同生效起至今	-9.43%	1.00%	-10.60%	1.07%	1.17%	-0.07%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金（LOF）  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017年9月21日至2023年9月30日)

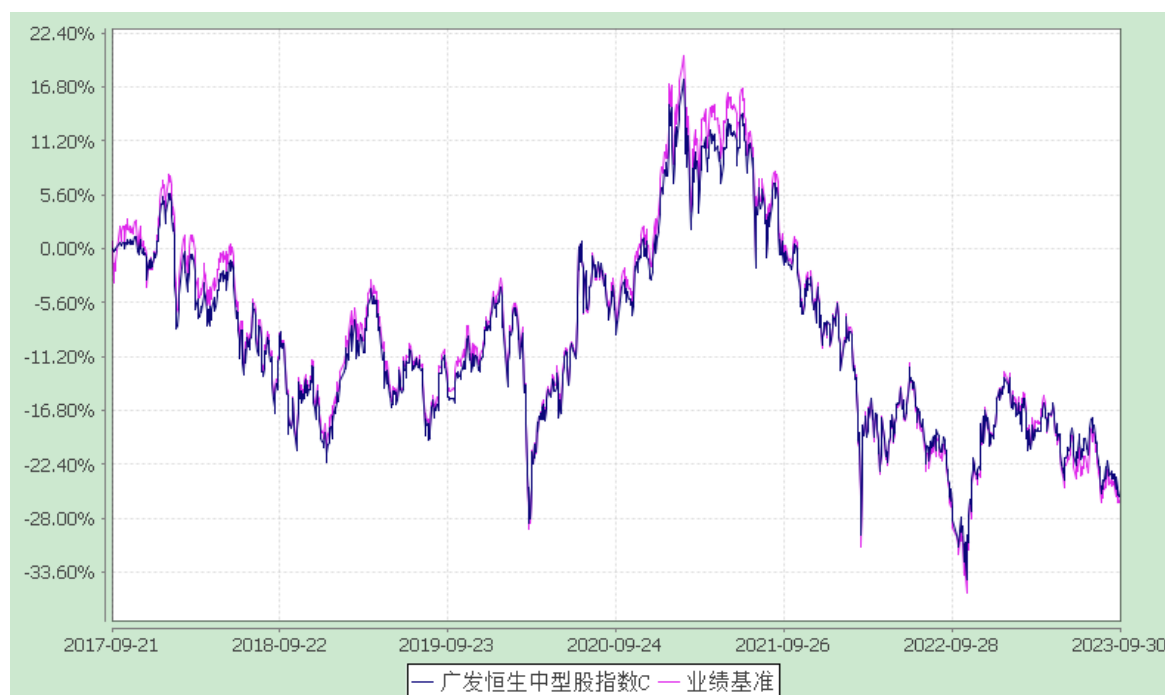
### 1、广发恒生中型股指数（LOF）A:

（2017 年 9 月 21 日至 2023 年 9 月 30 日）



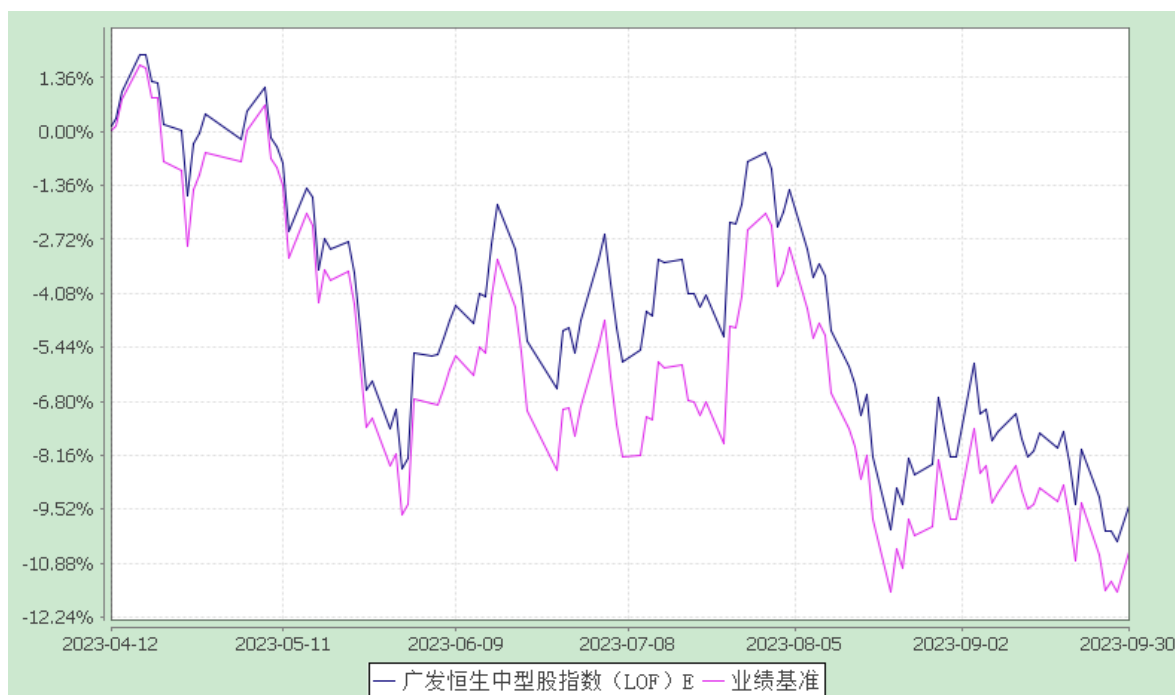
## 2、广发恒生中型股指数 C:

（2017 年 9 月 21 日至 2023 年 9 月 30 日）



## 3、广发恒生中型股指数（LOF）E:

（2023 年 4 月 12 日至 2023 年 9 月 30 日）



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘杰	本基金的基金经理；广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)的基金经理；广发创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证	2018-08-06	-	19 年	刘杰先生，工学学士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司信息技术部系统开发专员、数量投资部研究员、广发沪深 300 指数证券投资基金基金经理(自 2014 年 4 月 1 日至 2016 年 1 月 17 日)、广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2018 年 4 月 25 日)、广发量化稳健混合型证券投资基金基金经理(自 2017 年 8 月 4 日至 2018 年 11 月 30 日)、广发中小企业

	<p>券投资基金联接基金（QDII）的基金经理；广发恒生科技交易型开放式指数证券投资基金联接基金(QDII)的基金经理；广发恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理；广发中证香港创新药交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理；广发全球医疗保健指数证券投资基金的基金经理；广发美国房地产指数证券投资基金的基金经理；广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发北证 50 成份指数型证券投资基金的基金经理；广发恒生消费交易型开放式指数证券投资基金(QDII)的基金经理；指数投资部总经理助理</p>			<p>300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2016 年 8 月 30 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2016 年 9 月 26 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2017 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2018 年 4 月 26 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发标普全球农业指数证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2020 年 2 月 28 日)、广发粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2020 年 5 月 21 日至 2021 年 7 月 2 日)、广发美国房地产指数证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发全球医疗保健指数证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月</p>
--	---	--	--	---



					<p>16 日)、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金(QDII-LOF)基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2019 年 12 月 16 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2019 年 9 月 20 日至 2021 年 11 月 17 日)、广发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2019 年 11 月 6 日至 2021 年 11 月 17 日)、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2022 年 3 月 31 日)、广发恒生中国企业精明指数型发起式证券投资基金(QDII)基金经理(自 2019 年 5 月 9 日至 2022 年 4 月 28 日)、广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 8 月 20 日至 2023 年 2 月 22 日)、广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2016 年 1 月 18 日至 2023 年 2 月 22 日)、广发恒生科技指数证券投资基金(QDII)基金经理(自 2021 年 8 月 11 日至 2023 年 3 月 7 日)。</p>
姚曦	本基金的基金经理；广发中证主要消费交易型开	2021-11-17	-	8 年	姚曦，商科硕士，持有中国证券证券投资基金业从业证书。

<p>放式指数证券投资基金的基金经理；广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金(QDII-LOF)的基金经理；广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证光伏龙头 30 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发中证全指汽车交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发上海金交易型开放式证券投资基金的基金经理；广发上海金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理</p>				<p>曾任广发期货有限公司发展研究中心研究员、广发基金管理有限公司指数投资部研究员、广发中证京津冀协同发展主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2021 年 11 月 23 日至 2022 年 12 月 21 日)、广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2021 年 11 月 23 日至 2023 年 6 月 11 日)、广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2021 年 11 月 23 日至 2023 年 6 月 11 日)、广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2023 年 6 月 12 日至 2023 年 7 月 24 日)、广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2023 年 6 月 12 日至 2023 年 7 月 24 日)。</p>
--	--	--	--	--

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金

的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控与及时的分析评估，保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面，公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度，投资组合的投资标的必须来源于公司备选库，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公平分配投资指令。金融工程与风险管理部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生任何不公平的交易事项。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 23 次，其中 19 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，其余 4 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023 年 3 季度，受到国内国际市场情绪影响，港股市场呈现震荡行情，恒生指数下跌 5.85%，恒生科技指数上涨 0.24%，恒生中型股下跌 3.70%，港股市场整体表现上看对于来自美联储加息政策的影响更为敏感。国内经济边际转好，海外流动性环境偏紧，港股维持底部震荡态势。国内经济数据显示消费、投资和生产等逐步回暖。同时，相关货币政策支持也有助于实体经济持续转好。

对于恒生科技中互联网企业而言，在宏观以及房地产等稳增长相关的政策持续出

台后，线上消费也受益于经济和消费信心的回暖，2023年8月线上零售总额1.23万亿元，同比上升9.5%，增速相比2023年7月的8.9%有所提升，业绩层面，2023年2季度主要公司收入及利润均超预期，在宏观预期回暖及各公司更加积极的经营举措下，降本增效取得成果，成为重要看点。

港股创新药企业研发投入过程较长，资金投入较大，美联储加息上升周期中，港股创新药企业2季度的表现受到较大压制，同时在3季度整体美联储加息预期好转的过程中，港股创新药的表现整体在港股中相对较好，同时医药反腐对于创新药企业的影响相对较小。

本基金跟踪的标的指数为恒生综合中型股指数，指数涵盖了恒生综合指数成份股中总市值占比位列80%-95%区间的成份股，多为优质的行业龙头，同时也包含部分在香港上市的沪深300成份股。报告期内，本基金交易和申购赎回正常，运作过程中未发生风险事件。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金A类基金份额净值增长率为-4.87%，C类基金份额净值增长率为-5.00%，E类基金份额净值增长率为-4.91%，同期业绩比较基准收益率为-3.93%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金于2023年8月2日至2023年9月30日出现了基金资产净值低于五千万元的情形。

### §5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	30,725,718.79	86.67
	其中：普通股	30,725,718.79	86.67
	存托凭证	-	-
2	固定收益投资	-	-

	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	4,194,292.41	11.83
7	其他资产	530,532.63	1.50
8	合计	35,450,543.83	100.00

注：权益投资中通过港股通机制投资的港股公允价值为 30,725,718.79 元，占基金资产净值比例 86.92%。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	1,064,753.61	3.01
原材料	2,783,187.56	7.87
工业	3,892,118.49	11.01
非日常生活消费品	5,173,882.28	14.64
日常消费品	1,725,608.73	4.88
医疗保健	4,331,211.74	12.25
金融	4,031,939.62	11.41
信息技术	1,681,373.46	4.76
通讯业务	2,309,396.76	6.53
公用事业	1,450,224.20	4.10
房地产	2,282,022.34	6.46
合计	30,725,718.79	86.92

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

## 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	02328	中国财险	96,000	886,210.35	2.51
2	02899	紫金矿业	80,241	882,105.95	2.50
3	00728	中国电信	204,000	733,810.36	2.08
4	00168	青岛啤酒股份	10,000	588,200.83	1.66
5	01910	新秀丽	21,000	518,369.19	1.47
6	01171	兖矿能源	35,000	475,332.34	1.34
7	00788	中国铁塔	690,000	474,873.53	1.34
8	02359	药明康德	5,260	452,506.29	1.28
9	01099	国药控股	20,800	433,268.18	1.23
10	06030	中信证券	28,500	415,300.99	1.17

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

- (1) 本基金本报告期末未持有股指期货。
- (2) 本基金本报告期内未进行股指期货交易。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

- (1) 本基金本报告期末未持有国债期货。
- (2) 本基金本报告期内未进行国债期货交易。

### 5.11 投资组合报告附注

**5.11.1** 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国人民财产保险股份有限公司、中信证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**5.11.2** 本报告期内，基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	34,613.30
3	应收股利	268,853.64
4	应收利息	-
5	应收申购款	13,963.13
6	其他应收款	213,102.56
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	530,532.63

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发恒生中型股	广发恒生中型股	广发恒生中型股指
----	---------	---------	----------

	指数（LOF）A	指数C	数（LOF）E
报告期期初基金份额总额	28,564,612.86	13,188,973.82	69,734.89
报告期期间基金总申购份额	2,147,530.32	-	29,000,784.22
减：报告期期间基金总赎回份额	1,600,875.00	885,384.19	24,309,638.45
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
报告期期末基金份额总额	29,111,268.18	12,303,589.63	4,760,880.66

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在运用固有资金（认）申购、赎回或买卖本基金的情况。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20230726-20230801	-	20,591,085.27	20,591,085.27	-	-



### 产品特有风险

报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：

- 1、当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；
- 2、在极端情况下，基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；
- 3、当个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；
- 4、在特定情况下，当个别投资者大额赎回，可能导致本基金资产规模和基金份额持有人数量未能满足合同约定，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；
- 5、在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时，持有基金份额占比较高的投资者可能拥有较大话语权。

本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1.中国证监会批准广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金（LOF）募集的文件
- 2.《广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金（LOF）基金合同》
- 3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- 4.《广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金（LOF）托管协议》
- 5.法律意见书
- 6.基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7.基金托管人业务资格批件、营业执照

### 9.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

### 9.3 查阅方式

- 1.书面查阅：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件；
- 2.网站查阅：基金管理人网址 [www.gffunds.com.cn](http://www.gffunds.com.cn)。

广发基金管理有限公司  
二〇二三年十月二十五日