全球多元稳健策略说明书

【重要提示】

广发基金提供的基金投顾服务不能确保您获得盈利或本金不受损失，广发基金不以任何方式向您做出不受损失或者取得最低收益的承诺。基金投顾服务的过往业绩并不预示其未来业绩表现，为其他客户创造的收益并不构成业绩表现的保证。基金投顾机构向客户提供基金投资组合策略建议的风险特征与客户购买单只基金不同，可能存在基金投资组合策略成分基金风险等级高于基金投资组合策略风险等级的情况。因基金投资顾问业务尚处于试点阶段，存在因基金投顾机构的试点资格被取消不能继续提供服务的风险。

本基金投资组合策略可投资于QDII基金，因此将间接承担QDII基金所面临的海外市场风险、汇率风险、政治风险、法律和政府管制风险、会计核算风险及税务风险等境外投资风险。

1.策略名称：

全球多元稳健

2.策略目标：

通过多元化配置，寻求较低回撤、较低波动和长期稳健增值

3.业绩基准：

沪深300指数收益率*8.5%+人民币计价的MSCI全球指数收益率*8.5%+按上海黄金交易所Au 99.99现货实盘合约收盘价计算的收益率*3%+中债综合全价（总值）指数收益率*80%

4.风险等级：

R2

5.适合投资者类型：

C2-稳健偏谨慎型、C3-稳健型、C4-稳健偏进取型、C5-进取型

6.投资范围：股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金、QDII 基金、互认基金、商品基金及其他中国证监会允许的公募基金。

股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金、QDII 基金、商品基金及其他中国证监会允许的公募基金。其中权益类基金仓位（包括股票型基金、股票指数基金、偏股混合型基金等）占基金投资组合策略 12%-22%，商品基金仓位占基金投资组合策略 0-5%；固定收益类基金仓位（包括货币市场基金、债券型基金、偏债混合型基金、债券指数基金等）占基金投资组合策略 75%-85%；其中，偏股混合型基金指最新披露的定期报告中股票资产占基金资产的比例不低于 50%的基金，偏债混合型基金指不属于上述偏股混合型基金的其他混合型基金。

因证券市场波动、基金规模变动等投资策略以外的因素导致投资比例超过上述范围的，将在 3 个月内通过调仓进行调整，经监管部门认可的情形除外。

7.策略理念：

本基金投资组合策略主要配置固定收益类资产，少量配置于权益类资产，基金投资组合通过多元配置结合基金遴选的方式，力争长期稳定战胜基准。

8.策略描述：

本基金投资组合策略主要配置固定收益类资产，少量配置于权

益类资产，并通过 QDII 基金以及商品基金的投资来实现多元投资。

通过广发基金自主研发的大类资产研究体系与基金优选体系的赋能进行基金投资组合策略构建，力争实现策略目标。

大类资产方面，结合基金投资组合策略的风险收益特征以及大类资产风险收益特征制定本基金投资组合策略战略配置目标。同时结合当前大类资产研究、细分资产研究、宏观基本面研究、估值面研究、情绪技术面研究以及风险研判等，在中短期维度上进行适当的战术资产配置，以期达到追求收益和控制回撤的目的。

在基金优选方面，对全市场基金进行定量分析和定性跟踪研究，优选公募基金构建投资组合。

动态跟踪基金投资组合策略表现与基准的偏离情况，以及底层基金表现，对基金投资组合策略进行动态管理，力争实现资产的长期稳健增值。

9. 备选基金信息：

本基金投资组合策略备选基金类型包括股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金、QDII 基金、互认基金、商品基金及其他中国证监会允许的公募基金。

对于被动管理型基金和货币市场基金，在其细分类别中，按照其业绩、规模、流动性等进行评估，判断其投资价值。

对于主动管理型基金（货币市场基金除外），通过业绩指标分析（收益、风险、风险调整后收益等）、业绩归因分析（资产配置贡献、行业/风格贡献、个股/个券贡献等）、持仓结构分析（持仓稳定性，集中度、特异性等）、基金其他分析（基金规模/流动性、持有人户数及结构、管理人持有比例）等各项分析，对于不同类别

的基金进行审慎评估，判断其投资价值。

10. 风险控制：

（1）执行分散投资要求。在持仓集中度上，对于基金投资组合策略配置持仓中的分散性进行约束与监控。

（2）执行投资分级授权。对投资人员的投资标的、投资比例等权限进行分级审批和管理。

（3）监控模型风险和配置策略的有效性。通过对基金投资组合策略风险特征稳定性、与既定投资目标的匹配性、与原定配置比例的相符性等维度建立监测机制，对基金投资组合策略执行情况进行持续跟踪，当相关指标突破了既定阈值时及时预警。

（4）监控市场及成分基金风险。每日对基金投资组合策略的盈亏情况、波动率、回撤、成分基金的相关性、成分基金盈亏情况、成分基金的风险占比进行监控。定期对基金投资组合策略和市场情况进行回顾和调整，必要时进行调仓。

（5）管理流动性风险。持续监控基金投资组合策略成分基金的申购、赎回情况，包括基金投资组合策略调仓期间对成分基金规模变化的影响，及时评估和监测各成分基金的流动性风险。

（6）如因证券市场波动、基金规模变动等投资策略以外的因素导致投资比例超过约定范围的，将在 3 个月内通过调仓进行调整，经监管部门认可的情形除外。

11. 投顾服务费率：0.40%/每年

12. 风险提示：

广发基金提供的基金投顾服务不能确保您获得盈利或本金不受损失，广发基金不以任何方式向您做出不受损失或者取得最低收益的

承诺。基金投顾服务的过往业绩并不预示其未来业绩表现，为其他客户创造的收益并不构成业绩表现的保证。基金投顾机构向客户提供基金投资组合策略建议的风险特征与客户购买单只基金不同，可能存在基金投资组合策略成分基金风险等级高于基金投资组合策略风险等级的情况。因基金投资顾问业务尚处于试点阶段，存在因基金投顾机构的试点资格被取消不能继续提供服务的风险。

本基金投资组合策略可投资于QDII基金，因此将间接承担QDII基金所面临的海外市场风险、汇率风险、政治风险、法律和政府管制风险、会计核算风险及税务风险等境外投资风险。