

# 广发ESG责任投资混合型证券投资基金（广发ESG责任投资混合

## C) 基金产品资料概要

编制日期：2022年12月13日

送出日期：2022年12月19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 ESG 责任投资混合  | 基金代码           | 017199       |
| 下属基金简称  | 广发 ESG 责任投资混合 C  | 下属基金代码         | 017200       |
| 基金管理人   | 广发基金管理有限公司   | 基金托管人          | 中国农业银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | -  |                |              |
| 基金类型    | 混合型  | 交易币种           | 人民币          |
| 运作方式    | 普通开放式  | 开放频率           | 每个开放日        |
| 基金经理    | 王海涛  | 开始担任本基金基金经理的日期 | -            |
|         |  | 证券从业日期         | 2003-05-01   |
| 其他      | 《基金合同》生效后，连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元人民币情形的，基金管理人应在定期报告中予以披露；连续五十个工作日出现前述情形的，基金管理人应当终止基金合同，并按照基金合同的约定程序进行清算，不需要召开基金份额持有人大会进行表决。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。 |                |              |

注：本基金为偏股混合型基金。

### 二、基金投资与净值表现

#### (一) 投资目标与投资策略

|      |  |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金秉持ESG责任投资理念，通过对公司及行业所处的基本面进行深入分析和把握，选择优质上市公司，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。   |
| 投资范围 | 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括境内依法发行上市的股票（包括创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券（包括超短期融资券）以及其他中国证监会允许投资的债券）、债券回购、资产支持证券、银行存款、货币市场工具、同业存单、股指期货、国债期货、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）。<br>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。<br>本基金为混合型基金，基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例为60%-95%，投资于港股通标的股票不超过股票资产的50%，本基金非现金 |

资产中不低于 80%的资产将投资于通过 ESG 责任投资方法选择的证券。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构以后对投资比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。

具体包括：1、大类资产配置；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、金融衍生品投资策略。

ESG责任投资，是指在投资研究实践中融入ESG理念，在基于传统财务分析的基础上，通过环境（Environmental）、社会（Social）、公司治理（Governance）三个维度，考察企业中长期发展潜力，以期找到既创造股东价值又创造社会价值、具有可持续成长能力的投资标的。本基金综合考虑目前国内外上述较为成熟的ESG评级体系指标，在选用通用指标的同时也考虑不同行业特征下的行业指标，通过定性和定量相结合的策略将ESG评价情况纳入投资参考，具体来看ESG投资主要关注以下指标：

#### （1）环境维度

环境维度主要衡量企业管理者在给定环境风险敞口下为减小企业经营对环境不利影响所做的努力及取得的成效，其目的是评价企业是否实现既定的环境目标。企业环境绩效主要涉及两个层面，一是环境风险暴露，主要是指行业整体运营特性导致企业在环境方面存在较大成本约束或监管约束的风险；二是环境风险管理能力，主要是指企业应对环境风险采取的措施和相应的表现。重点关注能源与气候变化、水资源、环境管理、生物多样性、废气、废水、原材料与废弃物等指标。

#### （2）社会维度

社会维度主要衡量企业在从事生产经营活动中对股东承担法律责任的同时，对员工、客户、社区和环境等主体所承担责任的履行情况。考察企业社会责任应当覆盖企业在生产经营活动中涉及的多方主体。重点关注雇佣、发展与培训、产品质量、职业健康与生产安全、社区、客户与消费者、信息安全与隐私保护、研发与创新、供应链、可持续产品等指标。

#### （3）公司治理维度

公司治理主要衡量企业决策机制和制衡机制对其可持续经营的影响，包含两个层面，一是企业经营决策的主要参与者之间责任和权利分配，是指由股东、董事会和高级管理人员三者组成的一种组织结构；二是协调企业与所有利益相关者之间利益关系的机制，主要包括保护股东权利、优化董事会结构及功能、完善信息披露等方面的制度安排。重点关注公司治理、商业道德、战略管理等指标。

未来，随着ESG责任投资评估方法以及上市公司ESG信息披露规则等进一步完善，本基金可以结合监管要求与市场环境的变化，在履行适当程序后对ESG相关评价指标进行动态调整，并在更新招募说明书中更新。

## 主要投资策略

## 业绩比较基准

沪深300ESG基准指数收益率×60%+人民币计价的恒生指数收益率×20%+中债-新综合财富（总值）指数收益率×20%

## 风险收益特征

本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

本基金资产若投资于港股，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（汇率波动可能对基金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。

注：详见《广发 ESG 责任投资混合型证券投资基金招募说明书》及其更新文件中“基金的投资”。

## （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

无

### （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

无

## 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)<br>/持有期限 (N) | 收费方式/费率 | 备注            |
|-----------|-----------------------------|---------|---------------|
| 认购费       | -                           | -       | 本基金 C 类份额无认购费 |
| 申购费 (前收费) | -                           | -       | 本基金 C 类份额无申购费 |
| 赎回费       | N < 7 日                     | 1.50%   |               |
|           | 7 日 ≤ N < 30 日              | 0.50%   |               |
|           | N ≥ 30 日                    | 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  |
|-------|---|
| 管理费   | 1.50%   |
| 托管费   | 0.25%   |
| 销售服务费 | 0.50%   |
| 其他费用  | 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用、会计师费、律师费、诉讼费、仲裁费、基金份额持有人大会费用、基金的证券、期货交易费用、基金的银行汇划费用、账户开户费用和账户维护费、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用，和按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。 |

注：本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

## 四、风险揭示与重要提示

### （一）风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

#### 1、本基金特有风险

（1）本基金非现资产中不低于 80% 的资产将投资于通过 ESG 责任投资方法选择的证券，与之相关特有风险包括但不限于：

1) ESG 责任投资是一种长期理念, 本基金在投资决策和投资行为中会注重考量上市公司在环境 (E)、社会 (S) 和公司治理 (G) 三个方面的表现, 但将 ESG 责任投资理念纳入决策并不意味着本基金一定盈利, 本基金投资于股票场所获取的收益受多种因素影响, 最终能否带来收益具有较大不确定性, 存在无法获得收益甚至亏损的风险。投资者须在理性判断的基础上做出选择。

2) 基金管理人采用 ESG 责任投资方法指导决策, ESG 责任投资方法的缺陷在一定程度上也会影响本基金表现。首先, ESG 责任投资方法在国内应用的时间较短, 可能会存在投资方法不完善, 执行效果不好等问题; 其次, 面对不断变换的市场环境, ESG 责任投资方法所遵循的理念和具体执行方法可能处于不断发展和完善的过程中; 最后, 在上市公司 ESG 指标的定量评估模型具体假设中, 核心参数假设的变动均可能影响整体效果的稳定性。因此, 在实际运作假设中, 遵循 ESG 责任投资方法构建的组合在一定程度上可能无达到预期的投资效果。

3) 本基金坚持 ESG 责任投资, 精选在环境 (E)、社会 (S) 和公司治理 (G) 三个方面表现较好的上市公司进行投资, 但由于 ESG 责任投资理念引入国内的时间较短, 目前存在缺少规范内的 ESG 信息披露规则、上市公司 ESG 相关信息不完整、缺乏客观公允的第三方 ESG 评价服务等等障碍, 可能影响基金管理人对于投资标的的评估以及本基金投资策略的执行。

(2) 本基金是混合型基金, 既能投资股票, 亦能投资债券, 因此股票、债券等市场的变化均会影响到本基金的业绩表现。

(3) 投资港股通标的股票的风险

1) 港股交易失败风险; 2) 汇率风险; 3) 港股通可投资标的范围调整带来的风险; 4) 境外市场的风险; 5) 本基金存在不对港股进行投资的可能。

(4) 投资股指期货的风险

1) 基差风险; 2) 合约品种差异造成的风险; 3) 标的物风险; 4) 衍生品模型风险。

(5) 投资国债期货的风险

国债期货的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。

(6) 投资股票期权的风险

本基金投资股票期权可能给本基金带来额外风险, 包括杠杆风险、期权价格与基金投资品种价格的相关度降低带来的风险等, 由此可能增加本基金净值的波动性。

(7) 投资资产支持证券的风险

资产支持证券的投资风险主要包括流动性风险、利率风险及评级风险等。

(8) 投资存托凭证的风险

本基金投资存托凭证, 可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响, 存托凭证的境外基础证券的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。

(9) 本基金《基金合同》生效后, 连续五十个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元人民币的情形, 基金管理人应当终止基金合同, 并按照基金合同的约定程序进行清算, 不需要召开基金份额持有人大会进行表决。法律法规或中国证监会另有规定时, 从其规定。因此投资人将面临基金触及上述事项导致清盘的风险。

2、开放式基金的共有风险

(1) 市场风险; (2) 管理风险; (3) 职业道德风险; (4) 流动性风险; (5) 合规性风险; (6) 投资管理风险; (7) 本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险等。

3、其他风险

## (二) 重要提示

中国证监会对本基金募集的注册, 并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证, 也不表明投资于本基金没有风险。

基金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基金财产, 但不保证基金一定盈利, 也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额, 即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金产品资料概要信息发生重大变更的, 基金管理人将在三个工作日内更新, 其他信息发生变更的, 基金管理人每年更新一次。因此, 本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后, 如需及时、准确获取基金的相关信息, 敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告及定期报告等。

如投资者对基金合同有争议的, 争议解决处理方式详见基金合同“争议的处理和适用的法律”部分或

相关章节。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见广发基金官方网站 [www.gffunds.com.cn] [客服电话：95105828 或 020-83936999]

- (1) 《广发 ESG 责任投资混合型证券投资基金基金合同》
- (2) 《广发 ESG 责任投资混合型证券投资基金托管协议》
- (3) 《广发 ESG 责任投资混合型证券投资基金招募说明书》
- (4) 定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- (5) 基金份额净值
- (6) 基金销售机构及联系方式
- (7) 其他重要资料