

大成 ESG 责任投资混合型发起式证券投资基金(A 类份额)

基金产品资料概要更新

编制日期：2026 年 4 月 30 日

送出日期：2026 年 5 月 29 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	大成 ESG 责任投资混合发起式	基金代码	015780
下属基金简称	大成 ESG 责任投资混合发起式 A	下属基金交易代码	015780
基金管理人	大成基金管理有限公司	基金托管人	中国银行股份有限公司
基金合同生效日	2022 年 6 月 24 日		
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	每个开放日
基金经理	侯春燕	开始担任本基金基金经理的日期	2022 年 6 月 24 日
		证券从业日期	2010 年 6 月 21 日
其他	<p>《基金合同》生效之日起满三年后的对应日，若基金资产净值低于 2 亿元，《基金合同》自动终止并按其约定程序进行清算，无需召开基金份额持有人大会审议，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续《基金合同》期限。如届时有效的法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充的，则本基金按照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。</p> <p>《基金合同》生效三年后继续存续的，连续 20 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 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会。</p> <p>法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。</p>		

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

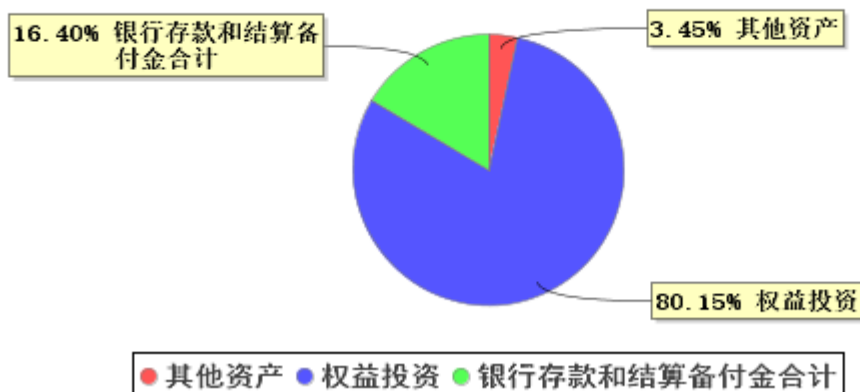
详见《大成 ESG 责任投资混合型发起式证券投资基金更新招募说明书》第八部分“基金的投资”。

投资目标	本基金在严格控制风险并保持良好流动性的前提下，坚持 ESG 责任投资理念，力争获得超额收益与长期资本增值。
投资范围	本基金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（包括主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、存托凭证、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票

	<p>(简称“港股通标的股票”)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款等)、货币市场工具、股指期货、国债期货,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的相关规定。本基金可参与融资业务。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。</p> <p>基金的投资组合比例为:本基金投资于股票、存托凭证的比例为基金资产的 60%-95%(港股通标的股票投资比例不超过本基金股票资产的 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;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,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、国债期货的投资比例遵循国家相关法律法规。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。</p>
<p>主要投资策略</p>	<p>本基金的投资策略分为两方面:一方面体现在采取“自上而下”的方式对权益类、固定收益类等不同类别资产进行大类配置;另一方面体现在对单个投资品种的精选上。</p> <p>(一) 大类资产配置策略</p> <p>本基金将密切关注股票、债券市场的运行状况与风险收益特征,综合分析宏观经济形势、国家政策、市场流动性和估值水平等因素,判断金融市场运行趋势和不同资产类别在经济周期的不同阶段的相对投资价值,对各大类资产的风险收益特征进行评估,制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。</p> <p>(二) ESG 责任投资方法的界定</p> <p>ESG 责任投资是指在投资决策过程中,除了基于传统的财务回报因素外,也要从环境(Environmental)、社会(Social)、公司治理(Governance)三个角度,评估企业经营的可持续性,以及对社会价值观的影响。</p> <p>(三) 股票投资策略</p> <p>1、个股投资策略; 2、港股投资策略; 3、组合股票的投资吸引力评估分析; 4、投资组合构建与优化。</p> <p>(四) 债券投资策略</p> <p>(五) 资产支持证券投资策略</p> <p>(六) 可转换债券投资策略</p> <p>(七) 可交换债券投资策略</p> <p>(八) 股指期货投资策略</p> <p>(九) 国债期货投资策略</p> <p>(十) 存托凭证投资策略</p> <p>(十一) 融资买入股票策略</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>沪深 300ESG 基准指数收益率×70%+中债综合指数收益率×20%+恒生指数收益率×10%</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金是混合型证券投资基金,预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金。本基金若投资港股通标的股票,则需承担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定风险。</p>

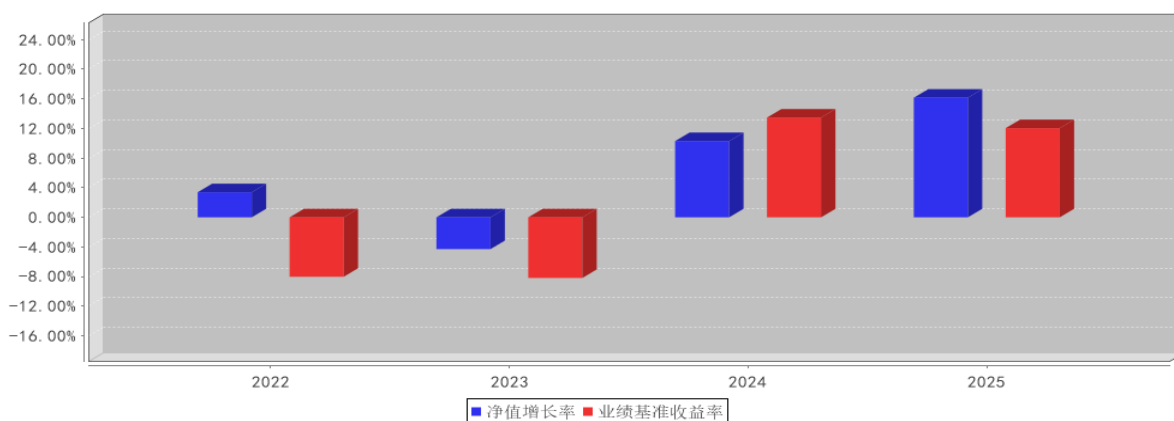
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表(2026年3月31日)



(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

大成ESG责任投资混合发起式A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图 (2025年12月31日)



注：1、基金的过往业绩不代表未来表现。

2、如合同生效当年不满完整自然年度的，按实际期限计算净值增长率。

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
申购费 (前收费)	M < 100 万元	1.5%
	100 万元 ≤ M < 300 万元	1.2%
	300 万元 ≤ M < 500 万元	0.8%
	M ≥ 500 万元	1,000 元/笔
赎回费	N < 7 天	1.5%
	7 天 ≤ N < 30 天	0.75%
	30 天 ≤ N < 180 天	0.5%
	180 天 ≤ N < 1 年	0.1%

	1 年 \leq N<2 年	0.05%
	N \geq 2 年	0%

注：养老金客户在基金管理人直销中心办理账户认证手续后，可享受申购费率一折优惠，申购费为固定金额的，则按原费率执行，不再享有费率折扣。

(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	收取方
管理费	1.2%	基金管理人和销售机构
托管费	0.2%	基金托管人
审计费用	5,000.00 元	会计师事务所
信息披露费	50,000.00 元	规定披露报刊
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的律师费、仲裁费和诉讼费；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；基金的开户费用、账户维护费用；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《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。	

注：（1）本基金交易证券等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

（2）审计费用、信息披露费为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

(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：

大成 ESG 责任投资混合发起式 A

基金运作综合费率（年化）
1.58%

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金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。

本基金特有风险：

1、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，与之相关的特有风险包括但不限于：

（1）ESG 责任投资是一种长期投资理念，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 责任投资理念纳入投资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投资选择。

（2）基金管理人采用 ESG 责任投资方法指导投资决策，ESG 责任投资方法的缺陷在一定程度上也会影响本基金的表现。首先，ESG 责任投资方法在国内实际应用的时间较短，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，在实际运作过程中，遵循 ESG 责任投资方法构建的投资组合在一定程度上可能无法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、通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于港股通标的股票的风险

3、股指期货与国债期货投资风险

4、本基金的投资范围包括存托凭证，本基金还可能面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与存托凭证发行机制相关的风险。

5、本基金投资资产支持证券，资产支持证券是一种债券性质的金融工具。资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。

6、基金合同终止的风险

由于本基金为发起式基金，根据相关法规规定，《基金合同》生效之日起满三年后的对应日，若基金资产净值低于 2 亿元，《基金合同》自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续《基金合同》期限。本基金将根据基金合同的约定进行基金财产清算并终止，投资人将面临基金终止清盘的风险。

7、启用侧袋机制的风险

当本基金启用侧袋机制时，实施侧袋机制期间，侧袋账户份额将停止披露基金份额净值，并不得办理申购、赎回和转换。因特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。

(二) 重要提示

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，敬请关注基金管理人发布的相关临时公告等。

大成 ESG 责任投资混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2022 年 4 月 28 日证监许可【2022】898 号文予以注册。

中国证监会对本基金募集的注册或核准，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。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[www.dcfund.com.cn]客服电话[4008885558]

1. 大成 ESG 责任投资混合型发起式证券投资基金基金合同、大成 ESG 责任投资混合型发起式证券投资基金托管协议、大成 ESG 责任投资混合型发起式证券投资基金招募说明书

2. 定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告

3. 基金份额净值

4. 基金销售机构及联系方式

5. 其他重要资料