

景顺长城 ESG 量化股票型证券投资基金

基金产品资料概要

编制日期：2022 年 4 月 25 日

送出日期：2022 年 4 月 26 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 | 景顺 ESG 量化股票 | 基金代码 | 014634 |
| 下属基金简称 | 景顺 ESG 量化股票 A | 下属基金交易代码 | 014634 |
| 下属基金简称 | 景顺 ESG 量化股票 C | 下属基金交易代码 | 014635 |
| 基金管理人 | 景顺长城基金管理有限公司 | 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | - | 上市交易所及上市日期 | - |
| 基金类型 | 股票型 | 交易币种 | 人民币 |
| 运作方式 | 开放式（普通开放式） | 开放频率 | 每个开放日 |
| 基金经理 | 黎海威 | 开始担任本基金基金经理的日期 | - |
| | | 证券从业日期 | 2003 年 9 月 15 日 |
| 基金经理 | 周春泉 | 开始担任本基金基金经理的日期 | - |
| | | 证券从业日期 | 2012 年 6 月 1 日 |

注：基金合同生效后，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；基金合同存续期内，如果存在连续 50 个工作日出现前述情形的，基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会。

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

| | |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金主要通过量化模型精选符合 ESG 要求的股票，在严格控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。 |
| 投资范围 | 本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、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、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换公司债）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金可以根据法律法规的规定参与融资业务。 |

| | |
|--------|---|
| | 本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 80%–95%，投资于 ESG 股票的资产不低于非现金基金资产的 80%。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保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计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。 |
| 主要投资策略 | 1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、股指期货投资策略；5、国债期货投资策略；6、股票期权投资策略；7、资产支持证券投资策略；8、参与融资业务的投资策略；9、信用衍生品投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300ESG 基准指数收益率×90%+商业银行活期存款利率(税后)×10% |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。 |

注：了解详细情况请阅读基金合同及招募说明书“基金的投资”部分。

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

(三) 自基金合同生效以来/最近十年（孰短）基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

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：

景顺 ESG 量化股票 A

| 费用类型 | 份额 (S) 或金额 (M) /持有期限 (N) | 收费方式/费率 | 备注 |
|--------------|-----------------------------|--------------|--------|
| 认购费 | M<1,000,000 | 1.20% | 普通投资群体 |
| | 1,000,000≤M<5,000,000 | 0.80% | 普通投资群体 |
| | M≥5,000,000 | 1,000.00 元/笔 | 普通投资群体 |
| | M<1,000,000 | 0.12% | 养老金客户 |
| | 1,000,000≤M<5,000,000 | 0.08% | 养老金客户 |
| | M≥5,000,000 | 1,000.00 元/笔 | 养老金客户 |
| 申购费 (前收费) | M<1,000,000 | 1.50% | 普通投资群体 |
| | 1,000,000≤M<5,000,000 | 1.20% | 普通投资群体 |
| | M≥5,000,000 | 1,000.00 元/笔 | 普通投资群体 |
| | M<1,000,000 | 0.15% | 养老金客户 |
| | 1,000,000≤M<5,000,000 | 0.12% | 养老金客户 |
| | M≥5,000,000 | 1,000.00 元/笔 | 养老金客户 |
| 赎回费 | N<7 天 | 1.50% | - |
| | 7 天≤N<30 天 | 0.75% | - |
| | 30 天≤N<180 天 | 0.50% | - |
| | N≥180 天 | 0 | - |

景顺 ESG 量化股票 C

| 费用类型 | 份额 (S) 或金额 (M) /持有期限 (N) | 收费方式/费率 |
|------|-----------------------------|---------|
| 赎回费 | N<7 天 | 1.50% |

| | | |
|--|---------------------|-------|
| | 7天 \leq N $<$ 30天 | 0.50% |
| | N \geq 30天 | 0 |

(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 | 景顺 ESG 量化股票 A | - |
| | 景顺 ESG 量化股票 C | 0.60% |

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

一、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。

二、本基金的特定风险

本基金为股票型基金，基于投资范围的规定，本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 80%-95%，投资于 ESG 股票的资产不低于非现金基金资产的 80%，无法规避股票市场的投资风险，尤其是系统性风险。

1、本基金主要采用三大类量化模型分别用以评估资产定价、控制风险和优化交易。基于模型结果，基金管理人结合市场环境和股票特性，精选个股产出投资组合，以追求超越业绩比较基准表现的业绩水平。基金可能因为模型计算的误差或模型中变量因子不完善而导致判断结论的失误，从而导致投资损失。

2、本基金可按照基金合同的约定投资流通受限证券。但由于投资流通受限证券在锁定期内无法变现，处于锁定期内的证券可能因为市场调整的影响而出现价格波动的风险。

3、金融衍生品投资风险

本基金可投资于股指期货、国债期货和股票期权等金融衍生品。投资股指期货、国债期货和股票期权主要存在以下风险：市场风险、市场流动性风险、基差风险、结算流动性风险、保证金风险、信用风险、作业风险。

4、资产支持证券投资风险

本基金将资产支持证券纳入到投资范围当中，可能带来以下风险：信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险、法律风险。

5、信用衍生品投资风险

为对冲信用风险，本基金可能投资于信用衍生品，信用衍生品的投资可能面临流动性风险、偿付风险以及价格波动风险等。

6、科创板股票投资风险：本基金如投资国内上市的科创板股票，会面临因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特定风险，包括但不限于流动性风险、退市风险、投资集中的风险、股价大幅波动的风险和科创板法律法规修改的风险等。

7、可转换债券(可交换公司债)投资风险

包括利息损失风险、公司经营风险(信用风险)、提前赎回风险。

8、参与融资业务的风险

本基金可根据法律法规和基金合同的约定参与融资业务，可能存在杠杆投资风险和对手方交易风险等融资业务特定风险。

9、存托凭证投资风险

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险。

10、基金合同自动终止风险

基金合同生效后，连续 50 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，基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会。基金份额持有人将可能面临基金合同自动终止的风险。

以上所述因素可能会给本基金投资带来特殊交易风险。

三、其他风险

1、市场风险；2、流动性风险；3、管理风险；4、信用风险；5、操作和技术风险；6、合规性风险；7、税负增加风险；8、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、9、其他风险。

(二) 重要提示

基金合同生效后，基金产品资料概要的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等。

景顺长城 ESG 量化股票型证券投资基金经中国证监会 2021 年 12 月 9 日证监许可【2021】3888 号文准予募集注册。中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景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，但不保证投资本基金一定盈利，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。

因基金合同产生或与之相关的争议，各方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费由败诉方承担。

基金管理人深知个人信息对投资者的重要性，致力于投资者个人信息的保护。基金管理人承诺按照法律法规和相关监管要求的规定处理投资者的个人信息，包括通过基金管理人直销、销售机构或场内经纪机构购买景顺长城基金管理有限公司旗下基金产品的所有个人投资者。基金管理人需处理的机构投资者信息中可能涉及其法定代表人、受益所有人、经办人等个人信息，也将遵守上述承诺进行处理。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[www.igwfmc.com][客服电话：400-8888-606]

- 1、《景顺长城 ESG 量化股票型证券投资基金基金合同》、《景顺长城 ESG 量化股票型证券投资基金托管协议》、《景顺长城 ESG 量化股票型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

六、其他情况说明

无。