

广发 ESG 责任投资混合型证券投资基金

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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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 ESG 责任投资混合
基金主代码	017199
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 1 月 19 日
报告期末基金份额总额	543,945,382.69 份
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。
投资策略	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，通过自上而下的定性分析和定量分析，综合分析宏观经济形势、国家政策、市场流动

	<p>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，从而确定固定收益类资产和权益类资产的配置比例，并依据各因素的动态变化进行及时调整。</p> <p>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。</p> <p>具体投资策略包括：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。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>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%</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>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。</p> <p>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</p>

	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。	
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	
下属分级基金的基金简称	广发 ESG 责任投资混合 A	广发 ESG 责任投资混合 C
下属分级基金的交易代码	017199	017200
报告期末下属分级基金的份额总额	465,362,297.81 份	78,583,084.88 份

§ 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 ESG 责任投资混合 A	广发 ESG 责任投资混合 C
1.本期已实现收益	-29,384,212.05	-5,148,931.16
2.本期利润	-39,585,499.74	-6,793,571.25
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0808	-0.0792
4.期末基金资产净值	407,363,054.15	68,545,909.97
5.期末基金份额净值	0.8754	0.8723

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 ESG 责任投资混合 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	-8.38%	0.52%	-3.13%	0.77%	-5.25%	-0.25%
过去六个月	-10.36%	0.53%	-6.34%	0.72%	-4.02%	-0.19%
自基金合同生效起至今	-12.46%	0.47%	-7.80%	0.73%	-4.66%	-0.26%

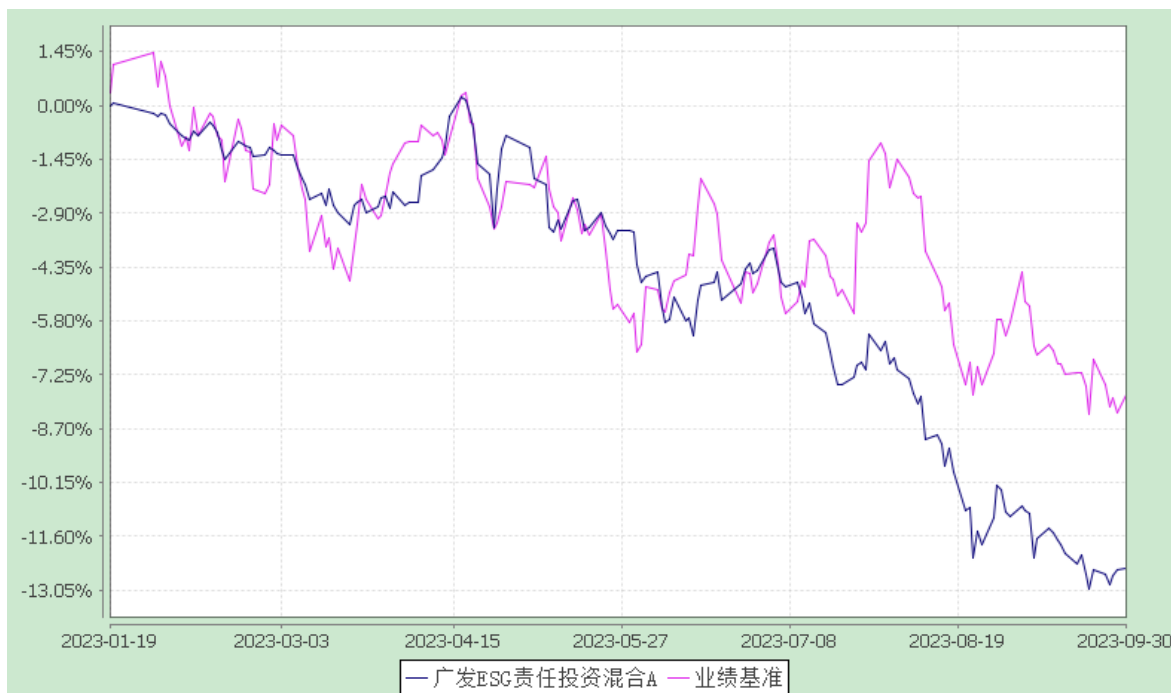
2、广发 ESG 责任投资混合 C:

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	-8.51%	0.52%	-3.13%	0.77%	-5.38%	-0.25%
过去六个月	-10.59%	0.53%	-6.34%	0.72%	-4.25%	-0.19%
自基金合同生效起至今	-12.77%	0.47%	-7.80%	0.73%	-4.97%	-0.26%

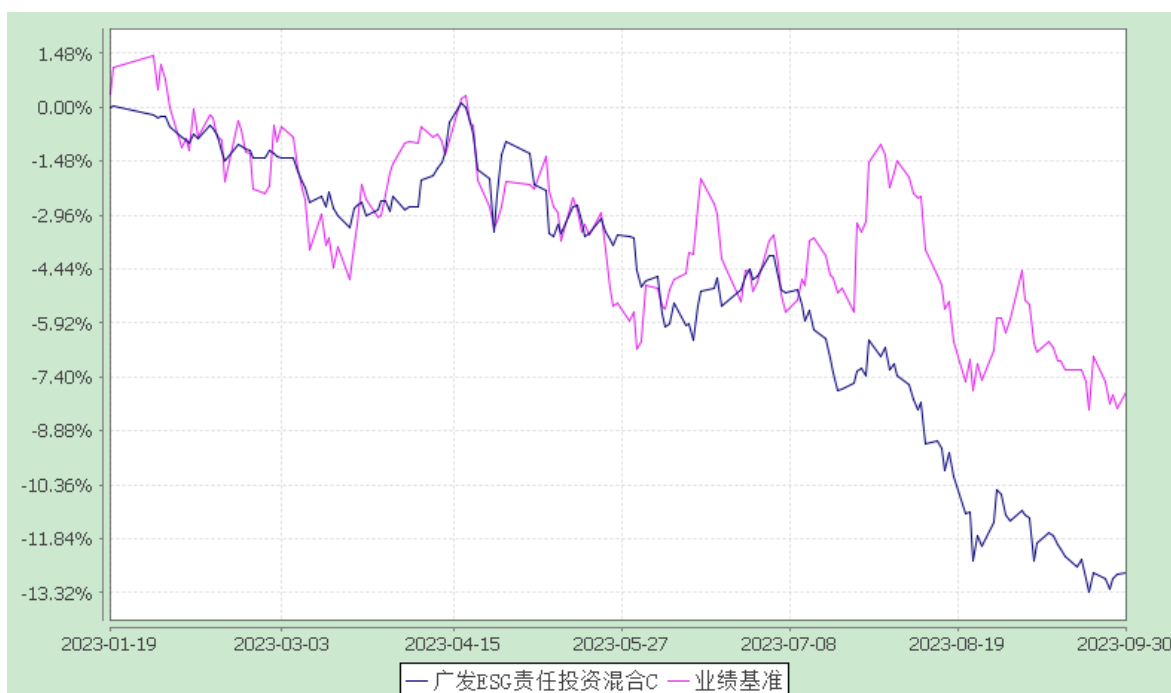
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发 ESG 责任投资混合型证券投资基金
 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
 (2023 年 1 月 19 日至 2023 年 9 月 30 日)

1、广发 ESG 责任投资混合 A:



2、广发 ESG 责任投资混合 C:



注：（1）本基金合同生效日期为 2023 年 1 月 19 日，至披露时点未满一年。

（2）本基金建仓期为基金合同生效后 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

§ 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		
王海涛	本基金的基金经理；广发大盘价值混合型证券投资基金的基金经理；广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广发稳健策略混合型证券投资基金的基金经理；广发睿享稳健增利混合型证券投资基金的基金经理；高级董事总经理、公司总经理助理	2023-01-19	-	20 年	王海涛先生，工商管理硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任美国 Business Excellence Inc. 投资经理，摩根士丹利亚洲有限公司全球财富管理部副总裁，兴全基金管理有限公司基金管理部总监助理、基金经理，专户管理部副总监、投资经理，新三板部副总监、投资经理。

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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
王海涛	公募基金	5	1,597,264,417.54	2021-12-07
	私募资产管理计划	5	8,575,394,240.43	2018-11-21
	其他组合	2	8,261,181,485.00	2019-12-09
	合计	12	18,433,840,142.97	

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

三季度，在美国通胀回升、美联储加息预期上修、美债利率上行的背景下，全球资本市场调整，A 股市场整体继续底部调整，大盘、价值风格表现较好。从宽基指数看，上证综合指数下跌 2.86%，沪深 300 指数下跌 3.98%，中证 500 指数下跌 5.13%，中证 1000 指数下跌 7.92%，创业板指数下跌 9.53%，科创 50 指数下跌 11.67%。从宏观经济看，经济逐步企稳修复，7 月底高层会议后，以及 8 月底调降印花税、收紧 IPO

和再融资、规范减持、降低融资保证金比例等政策持续加码出台后，市场都出现短暂小幅反弹，但投资者信心的建立、风险偏好的修复仍需要循序渐进。从申万一级行业指数表现看，三季度表现靠前的五大行业分别是非银金融、煤炭、石油石化、钢铁和银行；表现靠后的五大行业分别是电力设备、传媒、计算机、通信和国防军工。

报告期内，本基金一直保持较低仓位运作，但结构不够均衡，进入到 7 月份后，本基金经理基于对宏观经济政策方向的判断，调整了组合的配置结构，增持了银行、券商、采掘、化工等行业，清仓了部分受反腐影响较大的医药生物，减持了公用事业和新能源等行业，使得组合行业配置更加均衡。本基金持仓前五大行业分别为：公用事业、电子、电力设备、机械设备及银行，组合持有的个股 ESG 评级位于各行业内较为靠前位置。

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-8.38%，C 类基金份额净值增长率为-8.51%，同期业绩比较基准收益率为-3.13%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者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	304,495,287.37	62.97
	其中：普通股	304,495,287.37	62.97
	存托凭证	-	-
2	固定收益投资	1,289.99	0.00
	其中：债券	1,289.99	0.00
	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	70,791,649.50	14.64
	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	101,132,751.86	20.91
7	其他资产	7,130,759.75	1.47
8	合计	483,551,738.47	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 32,742,173.50 元，占基金资产净值比例 6.88%。

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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	36,033,101.00	7.57
C	制造业	133,284,565.07	28.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	48,769,108.97	10.25
E	建筑业	11,369.83	0.00
F	批发和零售业	310,658.79	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,315,935.20	3.64
J	金融业	35,975,183.00	7.56
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	32,809.24	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	20,382.77	0.00

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	271,753,113.87	57.10

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	4,427,381.22	0.93
原材料	-	-
工业	-	-
非日常生活消费品	-	-
日常消费品	-	-
医疗保健	-	-
金融	15,500,249.92	3.26
信息技术	12,814,542.36	2.69
通讯业务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	32,742,173.50	6.88

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	002353	杰瑞股份	911,064	29,053,830.96	6.10
2	601799	星宇股份	148,300	22,541,600.00	4.74
3	000543	皖能电力	3,571,000	21,675,970.00	4.55
4	688556	高测股份	448,474	20,598,410.82	4.33
5	300408	三环集团	626,500	19,421,500.00	4.08
6	600256	广汇能源	2,490,400	19,026,656.00	4.00
7	600027	华电国际	3,420,500	17,615,575.00	3.70
8	600985	淮北矿业	1,219,100	17,006,445.00	3.57
9	600919	江苏银行	2,070,300	14,864,754.00	3.12
10	03968	招商银行	473,000	14,193,074.97	2.98

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,289.99	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,289.99	0.00

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	127086	恒邦转债	10	1,289.99	0.00

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值 (元)	公允价值变 动(元)	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计(元)					-
股指期货投资本期收益(元)					63,401.58
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-113,640.00

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

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，江苏银行股份有限公司、招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局或其派出机构（含原中国银行保险监督管理委员会）、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	188,904.58
2	应收证券清算款	6,941,835.33
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	19.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,130,759.75

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ESG责任投资混 合A	广发ESG责任投资混 合C
报告期期初基金份额总额	512,946,732.72	119,313,565.83
报告期期间基金总申购份额	781,230.02	50,799.02
减：报告期期间基金总赎回份额	48,365,664.93	40,781,279.97
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	465,362,297.81	78,583,084.88

§ 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 影响投资者决策的其他重要信息

为更好地满足广大投资者的投资理财需求，降低投资者的理财成本，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，本基金管理人决定自 2023 年 7 月 10 日起，调低本基金的管理费率及托管费率并对基金合同有关条款进行修订。详情可见本基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《广发基金管理有限公司关于调低旗下部分基金管理费率及托管费率并修订基金合同等法律文件的公告》。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- （一）中国证监会注册广发 ESG 责任投资混合型证券投资基金募集的文件
- （二）《广发 ESG 责任投资混合型证券投资基金基金合同》
- （三）《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- （四）《广发 ESG 责任投资混合型证券投资基金托管协议》
- （五）法律意见书

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。

广发基金管理有限公司
二〇二三年十月二十五日