

英大基金 积极布局 ESG 投资策略产品

英大基金在绿色金融和 ESG 投资浪潮中，提前布局绿色金融研究项目，投入多名行业、策略、量化研究骨干，对绿色金融产品、ESG 投资策略进行研究。

英大首支 ESG 策略型指数基金——英大中证 ESG120 策略指数基金，于 2021 年 6 月 24 日获得证监会产品批文，是全行业中第 3 只获批的跟踪中证 ESG120 策略指数的基金，2021 年 12 月 20 日开始发售。

中证 ESG120 策略指数从沪深 300 指数样本中剔除 ESG 分数较低的上市公司股票，依据估值、股息、质量与市场因子分数计算综合得分，选取综合得分较高的 120 只股票作为指数样本股，该指数具有估值低、股息率高、盈利能力强、波动低等优势。自基日 2017 年 6 月 30 至 2021 年 12 月 31 日，中证 ESG120 策略指数年化收益达 7.20%，优于其他主流宽基指数；同时，指数最大回撤小于其他主流宽基指数（数据来源于 Wind）。

此外，英大基金权益 ESG 投资团队基于深入研究和广泛测评，向中证指数公司定制开发了中证 500ESG 优选策略指数。该指数基于中证 500，从成分股中筛选 ESG 综合表现良好、质量成长性优异的个股作为投资标的，取其可持续发展性、风险规避属性和高质量高成长性，为投资人提供优中选优的宽基投资工具。当前指数方案已通过沪深交易所和证监会的审核，指数预计将于 2022 年 1 月正式发布。

中证 ESG120 策略指数与中证 500ESG 优选策略指数形成风格互补的投资工具，丰富了投资人绿色投资的布局维度，为投资者把握碳达峰、碳中和主题、捕捉 ESG 投资机会提供了普惠性、创新性金融产品；同时，也将引导资本市场资金流向绿色行业和领域，服务产业和能源低碳转型。

风险提示：本材料仅限宣传推介使用，不构成任何法律文件。除本特别提示外，本材料其他内容不具有法律约束力，不应被视为亦不构成向任何人士发出的要约或者要约邀请。市场有风险，投资需谨慎。投资人在进行投资前应仔细阅读基金合同、招募说明书、基金产品资料概要等文件。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，但不保证一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成基金业绩表现的保证。基金管理人与股东之间实行业务隔离制度，股东并不直接参与基金财产的投资运作。E

中证 120 指数与其他指数对比



数据来源：wind