



景顺长城  
Invesco Great Wall



景顺长城基金管理有限公司

# 2022年度环境信息披露报告

## 报告编制说明

- **报告期间:**本环境信息披露报告(以下简称“本报告”)时间范围为2022年1月1日至2022年12月31日,适当追溯及展望,以增强报告内容完整性。部分因披露需要超出此范围的内容已在文中注明。
- **报告周期:**本报告以年度为周期进行。
- **报告范围:**本报告以“景顺长城基金管理有限公司”为主体,若无特殊说明,披露范围与公司2022年度合并财务报表范围一致。
- **编制原则:**本报告遵循真实、及时、一致和连贯原则。
- **编制依据:**本报告依据《深圳经济特区绿色金融条例》和《深圳市金融机构环境信息披露指引》,并参考《金融机构环境信息披露指南》(JR/T 0227-2021)和《气候相关财务信息披露工作组(TCFD)建议报告》等相关要求进行披露。
- **数据说明:**本报告所有数据均源自景顺长城基金管理有限公司正式文件、内部统计和公开渠道。如无特别说明,本报告涉及金额均以人民币作为计量币种。
- **指代说明:**为便于阅读,本报告“景顺长城基金管理有限公司”简称“景顺长城”“本公司”或“公司”。
- **发布形式:**本报告采用简体中文撰写,以PDF电子文档形式向公众发布,可于公司官方网站阅读、下载。



# 第一章 公司基本信息

景顺长城基金管理有限公司(以下简称“本公司”“公司”“景顺长城”)成立于2003年6月12日,是经中国证监会证监基金字[2003]76号文批准设立的国内首家中美合资的基金管理公司。景顺长城由景顺与长城证券联合开滦集团和实德集团共同发起设立,其中景顺和长城证券各持有49%的公司股份。公司注册资本1.3亿元人民币,总部设在深圳,在北京、上海、广州设有分公司,并设立全资子公司——景顺长城资产管理(深圳)有限公司。

公司自成立以来始终专注于提升投资能力和打造投研平台,致力于成为股票投资领先的多资产管理专家,力争为持有人创造长期持续稳定的回报。目前公司具备良好的股票投资、固定收益、量化投资、国际投资、资产配置/养老等方面综合投资能力,建立了覆盖高中低风险等级、较为完善的产品线。截至2022年12月31日,景顺长城的公募基金管理规模超5,200亿元。

未来,公司将在打造核心投研能力和助力持有人资产保值增值的基础上,持续深耕投资者教育和服务,提升投资者获得感。同时,公司将推动社会资源有效分配,支持实体经济,特别是在科技、安全、民生等二十大重点发展领域,助力高质量发展。





## 景顺长城基本信息

### 机构名称

景顺长城基金管理有限公司

### 机构性质

有限责任公司(中外合资)

### 所属行业

金融业

### 统一社会信用代码

91440300717869125N

### 全球法人识别编码 (Legal Entity Identifier, LEI)

3003007F2CGOLPDQT925

### 法定代表人

李进

### 填报负责人

陈嘉妃

### 总部所在地

深圳

### 经营位置

公司总部设在深圳,在北京、上海、广州设有分公司,在深圳设有子公司

### 主要产品和服务

公司致力于为客户提供专业的综合投资解决方案,产品线布局完善,涵盖高中低各风险等级,包括主动股票、固收、量化、被动投资、FOF等各种产品类型

### 服务的客户类型

公司为个人及机构投资者提供服务,其中机构投资者以银行及银行理财子、保险、信托、券商等为主



## 第二章 战略目标



## 一、环境相关目标

### (一) 目标设置情况

面对碳达峰及碳中和战略下的机遇和挑战，景顺长城作为专业的资产管理人，坚决支持“双碳”战略，坚持绿色、协调、可持续发展理念，积极发挥投资端功能，服务实体经济绿色转型和高质量发展。

景顺长城**绿色金融总体战略目标**是坚决落实国家“30·60”碳达峰碳中和战略，从战略高度推进绿色金融，积极践行绿色发展理念，在**绿色经营层面**和**责任投资层面**积极践行绿色转型和高质量发展。

#### 绿色经营相关目标

公司的绿色经营相关目标是通过倡议绿色办公、绿色出行等节能降耗措施，积极提高全体员工的节能意识，引导并带动全体员工营造减少资源浪费、节能降耗的良好氛围。

#### 责任投资相关目标

公司的责任投资相关目标是致力于积极履行绿色/ESG投资责任，更好地发挥投资端功能作用。绿色投资是责任投资的重要组成部分，指的是以促进企业环境绩效、发展绿色产业和减少环境风险为目标，采用系统性绿色投资策略，对能够产生环境效益、降低环境成本与风险的企业或项目进行投资的行为。

### (二) 目标实践情况

公司从经营层面和责任投资层面有序推进落实相关目标。

#### 绿色经营方面

公司持续倡导绿色办公。在2022年，公司发布《绿色办公、低碳生活倡议书》，宣导低碳办公、绿色通勤、节约水电、垃圾分类等绿色理念，积极提高全体员工的节能意识，引导并带动全体员工营造减少资源浪费、节能降耗的良好氛围，持续落实和推进节能降耗。

#### 责任投资方面

公司积极践行责任投资，在绿色金融产品、绿色投资能力、投后管理和行业倡议方面落实相关目标。

#### 创新主题产品

公司重点布局绿色和ESG相关主题产品，推出了包括景顺长城低碳科技主题混合、景顺长城环保优势股票、景顺长城新能源产业股票、景顺长城国证新能源车电池ETF和景顺ESG量化股票等基金产品，探索在各类投资策略中融入ESG因素，丰富创新绿色产品选择。在2022年，公司基于内部的量化研究，发行了基金产品——景顺长城ESG量化股票，力争在ESG投资的基础上，为投资人创造长期回报。

### 责任投资方面(接上页)

公司在研究和投资过程中逐步纳入绿色金融相关考量,加强ESG内部评价体系的建设,提升在研究和投资中整合环境相关因素的能力。同时,公司聚焦“双碳”研究,关注绿色金融效益,加强与高校、相关行业及公司开展绿色金融、ESG主题的交流与研究,持续推动自身和生态圈中绿色投资能力建设。

提升绿色  
投资能力

### 积极投后管理

公司通过行使积极所有权,监督并参与上市企业的环境和气候风险管理,助力上市企业提升环境责任意识,积极推动责任投资和绿色转型。在与被投资企业沟通方面,公司监督和检视上市公司和信用主体环境相关绩效、进展、挑战、计划,在日常沟通中加入ESG议题与考量因素,鼓励加强信息披露,帮助发现ESG问题、降低潜在风险,并持续跟踪其ESG绩效。同时,公司通过专业判断,积极、有效、审慎行使表决权,通过负责任投票积极行使股东权利。

公司广泛参与行业活动,并积极加入ESG和绿色金融相关倡议组织。公司已成为中国基金业协会绿色与可持续投资委员会联席主席单位,通过切实行动和积极倡议推动资产管理行业履行绿色投资责任。

参与行业倡议

## 二、环境相关中长期发展战略及行动计划

景顺长城的**绿色金融中长期发展总体战略**是坚决落实国家“30·60”碳达峰碳中和战略,从战略高度推进绿色金融,积极践行绿色发展理念,在**绿色经营和责任投资层面**积极践行绿色转型和高质量发展。公司拟通过以下行动计划,落实绿色金融发展战略。

### 绿色运营 行动计划

公司坚决贯彻落实碳达峰、碳中和的重大战略决策,积极响应《深圳经济特区绿色金融条例》和《深圳市金融机构环境信息披露指引》中实施节能减排、资源节约等环保措施的要求,深度扎实推进节约能效行动方案。公司从绿色办公和绿色出行等角度出发,将积极探索绿色运营行动。公司将按相关法规要求逐年进行运营碳排放测算。

### 绿色投资 行动计划

在国家“双碳”战略指导下,公司将绿色金融发展理念融入长期发展战略,深入挖掘自身业务特点和特长,全面规划绿色金融发展路径。公司发挥自身业务优势,逐步加强ESG投研体系建设,打磨绿色研究、投资、评估能力,在业务领域积极推进绿色投资发展。

### 积极所有权 行动计划

公司将持续对所投资的企业行使积极所有权,深入了解企业相关情况并协助企业提升绿色表现,在与被投资企业的沟通和积极所有权行动中继续积累和丰富经验。在绿色金融转型进程中,公司与投资者保持沟通以进一步了解投资者在环境治理方面的要求并将相关要求纳入投后管理流程中,行使积极所有权,从而提高上市企业环境信息披露及可持续发展管理水平和推动绿色发展理念在投资价值链上的传递。





### 第三章 环境及绿色金融相关治理结构

ESG



景顺长城的环境和绿色金融相关治理结构依托责任投资架构,形成了“董事会层面-高级管理层-专业部门层面”的治理结构,三者分别对公司环境和绿色金融相关事项听取汇报、统筹落实、日常推进。

## 董事会

公司高级管理层定期向董事会汇报绿色金融和环境相关风险机遇管理的相关工作进展和规划。

## 高级管理层

公司设立ESG业务委员会,全面负责统筹和落实公司包括绿色金融在内的各项ESG业务的具体开展。ESG业务委员会由公司总经理担任委员会主席,委员会委员包括总经理、副总经理、督察长、总经理办公室及风险管理部总经理、产品开发部总经理以及其他相关部门负责人或相关人员等。

ESG业务委员会的环境和绿色金融相关职责包括但不限于:

### ESG 业务委员会

- 制定公司环境相关风险管理和绿色金融相关战略和目标;
- 全面负责统筹协调公司环境相关风险管理和绿色金融业务的具体开展;
- 定期审核公司环境相关风险管理和绿色金融业务进度及相关目标完成情况,并持续跟踪相关监管要求以确保公司已采取有效措施以符合监管规定。

## 专业部门层面

公司股票投资部、固定收益部、量化及指数投资部、产品开发部、风险管理部、法律监察稽核部、财务行政部、市场服务部、信息技术部、人力资源部和总经理办公室等部门是环境相关风险管理和绿色金融工作的执行部门,在ESG业务委员会的授权下开展工作。其中投资相关部门主要负责开展环境风险和绿色金融投资研究,通过投票和沟通等方式推动被投企业的环境相关风险管理,并设有专职ESG研究员开展相关工作。

核心协作部门和主要职责包括:

### 股票投资部、 固定收益部、 量化及指数 投资部等 投资部门

- 负责公司责任投资能力建设,推动责任投资与投研体系的深度融合;
- 制定ESG投资政策、框架及流程,负责ESG内部评价体系及数据库的建设、维护和优化;
- 积极行使股东所有权,通过ESG沟通及负责任投票等方式推动被投企业的ESG发展;
- 跟踪国内外ESG政策及行业发展动态,就ESG及可持续发展相关课题展开深入研究;
- 组织参与内外部绿色及可持续发展相关交流培训活动,推动国内ESG生态圈发展。

### 风险管理部

- 协助投资部有关ESG内部评价体系的算法及系统搭建;
- 依照合同和法规要求制定产品层面的主题库规则,通过主题库的设立对ESG相关主题基金投资情况进行监督;
- 识别、评估和监控重大ESG风险。

### 财务行政部

- 宣传低碳办公、绿色通勤、节约水电、垃圾分类等绿色理念,提升员工节能意识;
- 负责实施经营层面节能减排、资源节约等环保措施;
- 联合公司工会组织环保和绿色金融相关的工会活动。



## 第四章 环境及绿色金融相关政策制度



## 一、外部政策

### (一) 外部环境、气候及绿色金融相关政策法规

2016年,中国人民银行等七部委联合发布了《关于构建绿色金融体系的指导意见》,首次确立了绿色金融体系建设的顶层架构,并给出了绿色金融的“官方”定义:绿色金融是指为支持环境改善、应对气候变化和资源节约高效利用的经济活动,即对环保、节能、清洁能源、绿色交通、绿色建筑等领域的项目投融资、项目运营、风险管理等所提供的金融服务。2021年“十四五”规划和2035年远景目标纲要明确指出,大力发展绿色金融。近年来,绿色金融在多个政策文件中被提及。

公司秉持合规经营、绿色发展的理念,紧跟国家绿色金融相关政策步伐,主动承担企业社会责任,经营过程中严格遵循国家和经营所在地有关法律、法规等要求。**公司报告期内未受到生态环境、绿色金融相关的行政处罚及司法判决。**

以下列示公司经营过程中遵循的部分绿色金融相关政策。

表 1: 景顺长城经营过程中遵循的部分绿色金融相关政策

政策范围	时间	政策名称	主要相关内容
国家	2022.5.14	国家能源局《关于促进新时代新能源高质量发展实施方案的通知》	丰富绿色金融产品服务。加大绿色债券、绿色信贷对新能源项目的支持力度。
	2022.4.26	证监会《关于加快推进公募基金行业高质量发展的意见》	提出支持差异化发展、强化长效激励约束机制、积极推动创新产品发展、提高中长期资金占比、着力提高投资者获得感、加快构建行业新发展格局等。
	2022.2.8	中国人民银行等四部委《金融标准化“十四五”发展规划》	标准化支撑金融产品和服务创新。加快完善绿色金融标准体系,有效推进普惠金融标准建设,加强产业链供应链金融标准保障。
	2021.10.26	国务院《2030年前碳达峰行动方案》	大力发展绿色贷款、绿色股权、绿色债券、绿色保险、绿色基金等金融工具,设立碳减排支持工具,引导金融机构为绿色低碳项目提供长期限、低成本资金。
	2021.10.24	国务院《关于完整准确全面贯彻新发展理念做好碳达峰碳中和工作的意见》	积极发展绿色金融。鼓励社会资本设立绿色低碳产业投资基金。建立健全绿色金融标准体系。
	2021.7.22	中国人民银行《金融机构环境信息披露指南》	明确金融机构在环境信息披露过程中遵循的原则、披露的形式、内容要素以及各要素的原则要求。
	2020.3.3	中共中央办公厅、国务院办公厅《关于构建现代环境治理体系的指导意见》	完善金融扶持。加快建立省级土壤污染防治基金。统一国内绿色债券标准。
	2018.11.10	中国证券投资基金业协会《绿色投资指引(试行)》	从绿色投资的界定、绿色投资范围、绿色投资基本原则、开展绿色投资的方法、基金管理人绿色投资表现评估和绿色投资监管等多个方面对绿色投资做出了规范



政策范围	时间	政策名称	主要相关内容
国家	2016.8.31	中国人民银行等七部门《关于构建绿色金融体系的指导意见》	推动证券市场支持绿色投资；设立绿色发展基金；完善环境权益交易市场、丰富融资工具等。
地方	2022.9.30	深圳市地方金融监督管理局等四部门《深圳市金融机构环境信息披露指引》	从战略目标、治理结构、政策制度、环境风险管理、经营活动环境影响、投融资活动环境影响、能力建设、创新研究、数据质量管理等九个维度明确了金融机构环境信息披露的工作要求。
	2021.3.1	深圳市人民代表大会《深圳经济特区绿色金融条例》	明确金融机构应承担节约资源、保护生态环境、促进绿色金融发展的社会责任。

## (二) 加入相关倡议组织

公司坚信公司个体的发展离不开行业的土壤，并愿与同行业企业共同推进行业高质量发展与转型升级。为此，公司通过加入行业倡议和组织，持续开展行业对话，集聚资源，分析行业现状，关注行业热点，深入产业环节，探讨前沿趋势，与专业人士和从业者思想碰撞、分享新知。截至2022年期末，公司已加入的倡议和组织包括：

### 香蜜湖女性董事倡议

2020年11月，在第二届中国（深圳）董事会多样性论坛——董事会“她力量”活动，公司与国内基金同行共同发起“香蜜湖女性董事倡议”。该倡议激励上市公司将提高女性董事比例和优化董事会决策效能作为优化治理水平、推动实现性别平等和妇女赋权的重要举措。

### 基金业协会绿色与可持续投资委员会

2021年11月，中国证券投资基金业协会“绿色与可持续投资委员会”正式成立，景顺长城是该委员会成员之一且总经理康乐担任委员会联席主席一职。景顺长城携手行业自律监管部门和同业伙伴共同加快中国基金行业服务经济高质量发展的步伐。

## 二、内部政策

### (一) 现行有效的相关政策制度文件

公司持续开展绿色金融研究和实践，分别在**投资层面**和**运营层面**积极制定相应的制度政策支持绿色金融管理和公司绿色运营。



An aerial photograph of a winding river in a desert landscape at sunset. The sun is low on the horizon, casting a golden glow over the scene. The river flows through a dry, brownish terrain, creating a complex, meandering pattern. The water reflects the bright light of the sun, creating a shimmering effect. The overall atmosphere is serene and majestic.

## 第五章 环境风险管理



## 一、环境风险及机遇管理机制

### (一) 环境风险的识别、评估和监控流程

为切实保护基金份额持有人的合法权益,公司依据《中华人民共和国证券法》和《中华人民共和国证券投资基金法》等法律法规制定《景顺长城基金管理有限公司风险管理制度》。《景顺长城基金管理有限公司风险管理制度》对公司层面的风险管理目标、理念、架构和整体流程(识别、评估和监控)等做出纲领性的规定。

为加强主题基金投资风格的管理,公司根据相关法律法规在公司投资研究管理制度和股票库管理制度基础上制定《景顺长城基金管理有限公司主题基金主题库管理制度》,该制度也适用于绿色/ESG主题基金。公司会根据《景顺长城基金管理有限公司主题基金主题库管理制度》对绿色/ESG主题基金在**投前、投中和投后**三个环节中针对相关风险(包括但不限于环境风险)进行识别、评估和监控。

#### 投前环节

基金经理、法律监察稽核部和风险管理部按照法律法规和产品合同等规定共同设定主题基金主题库的界定标准(界定标准的参考因素包括但不限于在环境、社会或者公司治理方面有显著影响的定性或定量指标),并依据该主题库的界定标准,及时将具有投资价值的ESG/绿色投资标的纳入绿色/ESG主题基金的主题库。

#### 投中环节

基金经理严格按照法律法规、基金合同和主题库规则针对相关主题基金进行投资运作。法律监察稽核部严格按照合同的主题库比例限制在投资交易系统设置,主题基金投资于主题库上市企业标的的权重不低于产品合同规定的下限。

#### 投后环节

风险管理部定期对基金的主题投资情况进行数据分析,并在投资组合回顾中与基金经理对发现的问题进行讨论。

### (二) 业务风险管理流程对环境风险和机遇的体现

为贯彻落实国家关于推动绿色发展、建立健全绿色低碳循环发展的经济体系、有序推进碳达峰碳中和、完善绿色金融体系建设的决策部署,公司积极践行绿色/ESG理念并将对环境风险和机遇的分析纳入业务风险管理流程中。

#### 投研分析和投资决策

在投研分析和投资决策中,投研人员积极开展包括环境风险和机遇在内的ESG研究,加强ESG内部评价体系的建设。投研人员根据产品合同、法规要求和《景顺长城基金管理有限公司责任投资政策》对相关产品纳入ESG因素及构建投资组合。



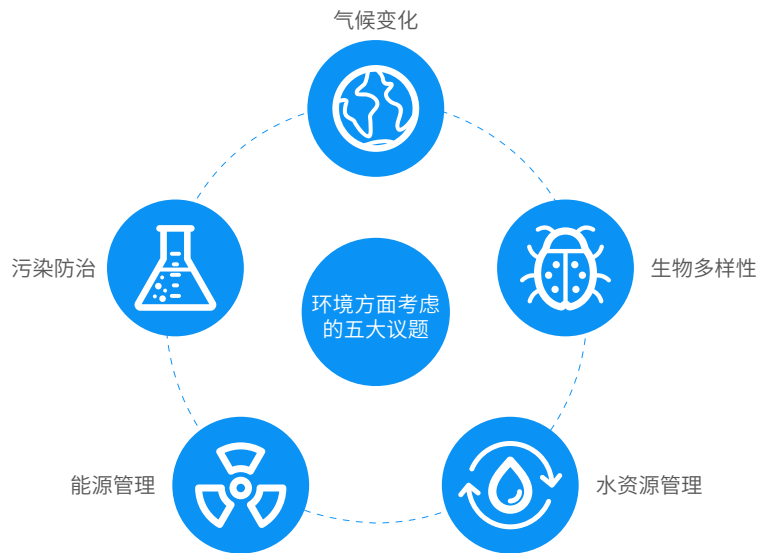
ESG研究案例:动态提升ESG整合能力,深度研究绿色驱动因素

景顺长城将环境风险和机遇整合贯穿到投研流程中,以自建的ESG内部评价体系为关键支点,将环境因素与基本面分析有机结合,在ESG投资管理过程中充分突出自身投研优势。

景顺长城ESG内部评价体系充分融入行业研究团队意见,以使其成为反映景顺长城投资理念和投研特色的ESG工具。同时,内部评价体系中加入对争议事件的考量,帮助动态监控环境相关风险。景顺长城ESG内部评价体系在环境方面重点考虑五大议题:气候变化、污染防治、能源管理、水资源管理、生物多样性。在此基础上,研究团队结合环境相关主题基金的投资策略和客户需求,对相关的环境指标进行考察,例如污染物排放、温室气体排放、绿色收入、可再生能源使用等。

在投资研究过程中,景顺长城深入分析环境因素对行业和企业价值驱动因素的影响,识别环境相关风险,挖掘绿色投资机遇。以船舶行业为例,景顺长城在环境方面紧密跟踪国际海事组织(IMO)对船舶营运碳强度指标的计算和管理要求。参照IMO指导性文件的要求,在2023年1月1日之前,5,000总吨及以上的船舶需要修改其船舶能效管理计划,记录其船舶营运碳强度指标。景顺长城敏锐捕捉这一政策要求,深入研究航运公司在平衡船舶运营和环境保护的过程中,因环境监管要求提升而可能产生的运营成本、资本开支、财务表现变化,以及能效等级要求趋严后对造船行业带来的潜在机遇。

景顺长城将持续结合ESG生态圈发展、监管政策变化、内部投研观点,不断优化ESG内部评级体系,使包括环境在内的ESG相关因素深度融入投研分析过程,发挥专业机构投资者优势,积极管理环境相关风险,主动捕捉绿色投资机遇。



## 投后管理

在投后管理中，一方面，公司在舆论监测方面定期通过邮件提供持仓负面新闻监控，其中包括环境违规处罚的信息；另一方面，公司通过行使积极所有权，监督并参与被投资企业的环境、社会和治理管理，助力被投资企业提升社会责任意识，积极推动责任投资。公司通过积极就ESG议题进行沟通，鼓励被投资企业加强ESG信息披露，帮助被投资企业发现ESG问题、降低潜在风险，并通过持续跟踪其ESG绩效，推动被投资企业可持续发展实践。

## 案例

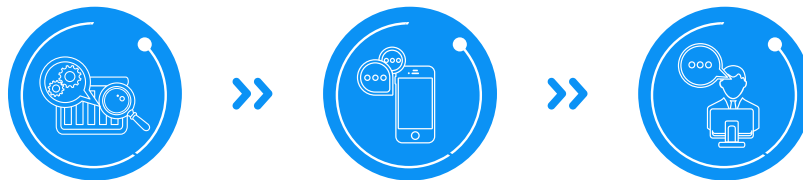
### 积极所有权案例之一：积极行使投票权，坚定表达“景顺长城态度”

景顺长城将积极所有权视为监督和参与被投资企业可持续发展的重要抓手，通过调研、沟通、投票、跟进行动等方式形成积极所有权行动闭环，检视和监督被投公司对可持续发展相关潜在风险的管理。

景顺长城的某被投企业在2022年举行临时股东大会，需要就其限制性股票激励计划和实施考核管理办法等议案进行投票。景顺长城深入分析后认为该股权激励对象过度集中于高管，对中层和研发人员激励不足，尤其考虑到该企业的研发人员占比较高，相关激励对象安排无法充分达到促进企业研发能力提升和经营业绩的激励目标。而就行权条件而言，其业绩考核目标过低，行权条件的设置不合理，将使激励效果大打折扣。

景顺长城投研团队针对相关议案展开充分研究，通过多种方式多次与被投资企业沟通，表达景顺长城对该激励方案激励对象、业绩考核目标、激励效果的担忧，最终对该次股东大会与股权激励相关的全部议案投出反对票，积极维护中小股东利益。

景顺长城认为，负责任投票是机构投资者履行受托责任、保护客户长期利益、向被投资企业表达投资者诉求的一种重要方式，景顺长城将在沟通和参与的基础上，审慎负责地利用投票践行积极所有权，明确表达对企业议案和ESG核心议题的“景顺长城态度”。



### 积极所有权案例之二：推动物流企业优化碳管理和碳披露，多维完善可持续管治结构

景顺长城将ESG融入落实到投资管理全流程，全面推动自身和被投企业的可持续发展。景顺长城不仅加强ESG内部评价体系的建设和在投后管理过程中践行积极所有权策略。在与被投资企业进行ESG沟通时，景顺长城分析被投企业的ESG评级表现、目标设置、行动计划、实践情况，以全面捕捉被投企业的ESG相关风险和机遇。在沟通完成后，景顺长城在“ESG参与报告”中记录关注问题、相关回复、改进建议，并针对企业的ESG关注问题进行持续跟进，为后续积极所有权行动提供重要锚点。

以物流行业某企业为例，景顺长城通过ESG参与(ESG Engagement)和企业可持续发展报告等公开信息了解和分析企业面临的ESG风险与机遇、每一项重要议题的管理体系和目标规划、管理措施和绩效，将**碳目标管理及披露和公司治理**作为重要ESG议题在ESG参与过程中向对方提出改进建议。

在**碳目标管理及披露方面**，景顺长城针对该企业收购另一业务形态存在差异的物流企业的情况，建议该企业对两个主体分别进行碳核算和碳目标管理。景顺长城认为此举有利于企业保持碳数据的披露口径一致可比，方便企业和投资人跟踪碳目标达成进展。在其随后发布的2022年度可持续发展报告中，该企业采纳了相关建议，对两个主体碳排放进行单独核算并对不同业务模式的碳效率进行针对性管理和披露。在此基础上，该企业在当年实现了碳效率提升和单票碳足迹降低。

在**公司治理方面**，景顺长城表达了对董事会多样性和独立性以及可持续发展管理架构的重点关注。该企业董事会换届后新增2名女性董事，女性董事占比由0%提升至28.6%；审计委员会、薪酬与考核委员会全部由独立董事组成；并新增1名风险管理背景董事。此外，该企业在战略委员会新增可持续发展监管职责，将ESG专业管理工作提升至公司治理层，形成四级可持续发展管理架构，并由具有风险管理背景的董事牵头，以加强公司ESG治理工作的监督与管理。

景顺长城将以“ESG参与报告”为抓手，持续跟踪和督促改善被投企业的ESG管理，提升投资组合的综合抗风险能力，以金融力量携手多方共同促进高质量发展和社会经济低碳转型。

### (三) 针对环境相关风险暴露的应对预案

公司持续监测被投企业的环境风险，定期通过邮件提供包括环境违规处罚等负面新闻在内的持仓舆情监测信息。公司也会根据环境风险的重大程度，适时采取调研、与重仓企业沟通和移出主题库等措施。在选择风险应对措施时，公司全面考虑风险应对的效率和效果，做好重大风险的管控前置。

## 二、环境风险和机遇的识别、影响及应对措施

公司依据气候相关财务信息披露工作组 (TCFD) 的定义, 将环境风险主要分为与低碳经济相关的转型风险和与气候实际变化相关的物理风险。公司结合金融行业特点和公司投资业务范围, 对短期 (1-3年)、中期 (3-7年)、长期 (7年以上) 风险进行识别, 分析其对公司的潜在影响并持续监测。

公司已识别下述转型风险和物理风险, 并通过分析风险相关因子、影响时间范围和潜在影响, 结合自身业务和运营实际, 制定应对措施。

表 2: 已识别的环境相关风险及应对措施

环境风险类型	相关因子	风险描述	影响时间范围	潜在影响	应对措施及效果
转型风险	政策法规	“30·60”双碳目标; 生态环境保护、污染防治、能源节约、循环经济、绿色债券等绿色金融相关政策法规	长期	未能及时满足合规要求的违规风险, 及因此造成的业务风险、声誉风险等	持续关注国家和地方环境相关政策, 并保持对国际趋势的敏感度, 在资产组合中考虑面临的政策风险, 及时观察、分析、研究、应对
	技术进步	全行业的数字化转型, 各行业新兴的信息技术, 包括金融业务的信息系统和能效提升技术	短期	未能及时跟进信息化、数字化新技术和业务形态转型; 未能识别各行业新型低碳节能技术导致丧失市场机会	加快数字化转型和信息系统平台化建设。打造以客户为中心的数字化产品和服务, 提升客户体验; 加快推进内部电子化、信息化建设, 提升协同效率和竞争力
	市场变化	低碳理念的传播和双碳目标影响投资标的	中期、长期	减损投资标的价值, 未能及时识别和跟踪投资标的的情况	密切关注碳达峰及碳中和战略对不同行业和投资标的的影响, 不断优化ESG内部评价体系并将相关议题纳入考量
物理风险	极端天气事件	极端高温事件更加频繁、更加严重; 集中降雨事件出现的周期缩短; 复合型极端事件发生概率和风险持续增加	短期	影响业务连续性, 影响基础设施运营, 对正常经营造成压力	完善两地三中心灾备应急体系建设, 制定突发事件应急预案, 定期开展应急演练, 加大金融科技投入和人员能力培训, 提升发现和处置突发事件的能力, 保障公司各项业务的连续性
	持续影响的气候变化事件	平均气温上升、海平面上升、海岸洪水、风暴潮和海岸侵蚀、干旱和热浪	长期	减损资产价值、影响特定行业供应链、运营和盈利能力	在适当的条件下, 选择可再生能源, 实现能源清洁化、低碳化; 在日常运营中, 通过采取节能措施和低碳理念宣导, 减少资源消耗



风险与机遇一体两面，公司在识别环境风险的同时，也认识到与环境相关的因素中蕴藏着发展机遇，例如经营和结构调整带来的效率提升，新产品、服务和市场的开发等。公司在机遇分析中考虑利益相关方因素，提出可加强公司业务连续性和稳定性的措施。

表 3: 已识别的环境相关机遇及应对措施

环境机遇类型	机遇描述	影响时间范围	潜在影响	应对措施及效果
政策和市场机遇	国家、国际对低碳产业、节能技术的支持	长期	低碳行业、绿色行业的快速发展，相关企业数量增加	识别低碳企业中的关键技术，深化对低碳和绿色企业、行业和技术了解，以支持投资
服务与产品机遇	满足个人投资者和大型资产所有者需求	中期	投资者对于方便快捷的信息系统依赖性增加、更注重低碳和绿色投资理念	坚持打造数字化、信息化系统，减少纸张使用和信息重复提交；推出符合投资者理念的资管产品
运营机遇	运营节能带来的运营成本降低	中期、长期	企业运营成本下降，绿色企业、自身运营碳中和企业更具有良好声誉和低碳适应力	在组织层面施行低碳节能倡议，落实节能措施
极端天气事件	能够应对极端天气事件的企业将更具有竞争力	短期	保持业务连续性和经营稳定性，吸引客户	加强办公场地设施维护，积极推动居家办公、远程办公系统支持和建设

## 第六章 经营活动的环境影响



## 一、经营活动能源消耗

2022年,公司经营活动消耗能源中,自有交通运输工具消耗的汽油3,018.30升,人均消耗11.02升。2022年,公司营业办公消耗电力126.17万千瓦时,人均消耗4,604.63千瓦时。2022年,公司雇员因差旅出行乘坐的交通工具消耗的能源为33.81吨标准煤,人均消耗0.12吨标准煤。

表4:景顺长城2022年经营活动能源总量消耗及人均消耗量

统计指标		消耗量		人均	
		单位	数据	单位	数据
能源消耗	自有交通运输工具所消耗的汽油	升	3,018.30	升/人	11.02
	营业办公所消耗的电力	千瓦时	1,261,668.00	千瓦时/人	4,604.63
	雇员因工作需要出差所乘坐的交通工具所消耗的能源	吨标准煤	33.81	吨标准煤/人	0.12

2022年,公司经营活动消耗资源中,营业办公耗水4,354.41吨,人均消耗15.89吨。2022年,公司营业办公用纸2.08吨,人均消耗0.0076吨。

表5:景顺长城2022年经营活动资源总消耗量及人均消耗量

统计指标		消耗量		人均	
		单位	数据	单位	数据
资源消耗	营业办公耗水	吨	4,354.41	吨/人	15.89
	营业办公用纸	吨	2.08	吨/人	0.0076
废弃物	非厨余垃圾	吨	2.08	吨/人	0.0076

注:废弃物仅包含废纸量

## 二、温室气体排放

2022年,公司经营活动温室气体排放总量为755.97吨二氧化碳当量,人均排放2.76吨二氧化碳当量。其中,2022年直接温室气体排放量(范围一)为6.40吨二氧化碳当量,人均排放0.02吨二氧化碳当量。2022年能源产生间接温室气体排放总量(范围二)为569.26吨二氧化碳当量,人均排放2.08吨二氧化碳当量。2022年其他经营活动产生间接温室气体排放总量(范围三)为180.31吨二氧化碳当量,人均排放0.66吨二氧化碳当量。

表6:景顺长城2022年经营活动温室气体排放总量及人均排放量

温室气体排放范围		2022年总排放量(吨二氧化碳当量)	2022年人均排放量(吨二氧化碳当量/人)
直接温室气体排放总量(范围一)		6.40	0.02
能源产生间接温室气体排放总量(范围二)		569.26	2.08
其他经营活动产生间接温室气体排放总量(范围三)	差旅出行	74.73	0.27
	差旅住宿	86.29	0.31
	办公用纸	7.28	0.03
	用水	11.28	0.04
小计		180.31	0.66
温室气体排放总量		755.97	2.76



### 三、经营活动环境影响的量化测算

#### (一) 测算指标的统计口径

在本报告中，公司自有交通工具所消耗的汽油、经营办公活动的用水量、用电量和用纸量、差旅出行、差旅住宿统计范围均为景顺长城深圳总部。因此，直接温室气体的排放量（范围一）、能源产生间接温室气体排放总量（范围二）和其他经营活动产生间接温室气体排放总量（范围三）统计范围也为景顺长城深圳总部。在人均碳排放量和人均自然资源消耗测度方面，本报告以深圳总部2022年末员工总数274人为测算基准。

#### (二) 经营活动环境影响的测算方法学

相关测算依据中国人民银行发布的《金融机构环境信息披露指南》、《金融机构碳核算技术指南》以及深圳市《深圳市金融机构环境信息披露模板及指标说明》要求，依据《工业企业温室气体排放核算和报告通则》，并基于各能源消费品种的二氧化碳排放系数对温室气体排放量进行测算。

#### 直接温室气体排放（范围一）

$$E_{\text{燃烧}} = \sum_{i=1}^n (AD_i \times EF_i)$$

式中：

$E_{\text{燃烧}}$ ——核算期内消耗的化石燃料燃烧产生的二氧化碳排放，单位为吨二氧化碳当量 (tCO<sub>2</sub>)；

$AD_i$ ——核算期内消耗的第*i*种燃料的活动水平数据，单位为吨 (t) 或立方米 (m<sup>3</sup>)；

$EF_i$ ——第*i*种燃料的二氧化碳排放因子，单位为吨二氧化碳当量每吨燃料 (tCO<sub>2</sub>/t) 或吨二氧化碳每立方米燃料 (tCO<sub>2</sub>/m<sup>3</sup>)；

*i*——化石燃料类型代号；

#### 间接温室气体排放（范围二）

$$E_{\text{购入电}} = AD_{\text{购入电}} \times EF_{\text{电力}}$$

式中：

$E_{\text{购入电}}$ ——购入电力所产生的二氧化碳排放量，单位为吨二氧化碳当量 (tCO<sub>2</sub>)；

$AD_{\text{购入电}}$ ——核算期内购入的电量，单位为兆瓦时 (MWh)；

$EF_{\text{电力}}$ ——电力的二氧化碳排放因子，单位为吨二氧化碳当量每兆瓦时 (tCO<sub>2</sub>/MWh)。



## 其他温室气体排放(范围三)

$$E_{\text{其他}} = \sum_{i=1}^n (AD_i \times EF_i)$$

式中:

$E_{\text{其他}}$ ——核算期内范围三产生的二氧化碳排放,单位为吨二氧化碳当量(tCO<sub>2</sub>);

$AD_i$ ——核算期内消耗的第i种活动的活动水平,单位包括:人·千米、吨(t)、晚·房间等;

$EF_i$ ——第i种活动的二氧化碳排放因子,单位为吨二氧化碳当量每(人·千米)、吨二氧化碳当量每吨(tCO<sub>2</sub>/t)、吨二氧化碳当量每(晚·房间)等;

i——范围三核算活动代号;潜在计算对象,包括雇员差旅出行、雇员差旅住宿、办公用纸(回收用纸)、办公用水、废弃物处置等。

表7:温室气体排放计算所需排放因子及来源

序号	变量名称	输入单位	排放因子	排放因子单位	来源
1	煤炭	吨	2.03	(吨二氧化碳)/(吨)	中国产品全生命周期温室气体排放系数集(2022),采用无烟煤
2	标准煤	吨	2.8419	(吨二氧化碳)/(吨)	中国产品全生命周期温室气体排放系数集(2022)
3	汽油	升	0.002121	(吨二氧化碳)/(升)	中国产品全生命周期温室气体排放系数集(2022)
4	柴油	升	0.002601	(吨二氧化碳)/(升)	中国产品全生命周期温室气体排放系数集(2022)
5	燃气/天然气	立方米	0.002162	(吨二氧化碳)/(立方米)	中国产品全生命周期温室气体排放系数集(2022)
6	水(用水)	吨	0.00185	(吨二氧化碳)/(吨)	中国产品全生命周期温室气体排放系数集(2022)
7	水(废水)	吨	0.00074	(吨二氧化碳)/(吨)	中国产品全生命周期温室气体排放系数集(2022)
8	电力(广东地区)	千瓦时	0.000451	(吨二氧化碳)/(千瓦时)	附件2:深圳市金融机构环境信息披露模板及指标说明(征求意见稿)
9	电力(其他地区)	千瓦时	0.000581	(吨二氧化碳)/(千瓦时)	关于做好2022年企业温室气体排放报告管理相关重点工作的通知:《2.企业温室气体排放核算方法与报告指南发电设施(2022年修订版)》
10	纸张	吨	3.5	(吨二氧化碳)/(吨)	北京绿交所
11	员工乘坐飞机 差旅出行	人·千米	0.000088	(吨二氧化碳)/(人·千米)	中国产品全生命周期温室气体排放系数集(2022)
12	员工乘坐高铁 差旅出行	人·千米	0.000026	(吨二氧化碳)/(人·千米)	中国产品全生命周期温室气体排放系数集(2022)
13	员工差旅住宿	晚·房间	0.02529	(吨二氧化碳)/(晚·房间)	中国产品全生命周期温室气体排放系数集(2022)
14	废弃物处置-一般 垃圾-非厨余垃圾	吨	0.35319	(吨二氧化碳)/(吨)	中国产品全生命周期温室气体排放系数集(2022)
15	废弃物处置-一般 垃圾-厨余垃圾	吨	0.00444	(吨二氧化碳)/(吨)	中国产品全生命周期温室气体排放系数集(2022)

## 四、环保措施及效益

公司积极践行社会责任, 努力提升办公和运营中的环境表现, 开展绿色办公、低碳生活相关宣传和倡议活动, 在员工中营造节能环保氛围, 同时降低经营活动对环境的负担。

### 绿色出行

- 鼓励员工上下班多乘坐公共交通工具, 适当步行或骑行等, 节能减排、提高效率、有益健康。

### 绿色办公

- 公司积极推进无纸化、节纸化办公, 减少打印机墨粉和纸张等消耗; 必须进行打印、复印时, 鼓励员工选用双面黑白打印、复印模式, 且打印文档前需仔细校对, 减少打印频率, 实现节能减排;
- 建设数字化电子办公系统, 通过OA系统、电子邮件等多种网络通讯工具传递办公信息, 减少重复的工作流程, 提升办公效率的同时减少低效节点的能源消耗;
- 公司为投资者建立线上所投资产状况查询平台, 开展定制电子账单活动并设官网资讯订阅专栏, 以鼓励其减少纸质账单的使用并倡导电子账单的定制; 截至2022年底, 大部分客户已经自行查询相关信息或定制电子账单;
- 对非消耗类办公用品(如文件袋、燕尾夹、曲别针、公司环保袋等)循环使用, 实现资源循环利用, 低碳办公; 对消耗类办公用品(如废纸张等)进行定点回收处理;
- 办公用电是公司主要的能源消耗, 公司采取多种措施实现节能管理, 如办公期间, 空调温度设定在26度; 鼓励员工适度调暗显示屏, 下班后关闭电脑和显示器; 无人区域关闭照明及空调; 合理利用公司冰箱, 定期清理以减少能耗。



图1:绿色办公 节约纸张



图2:绿色办公 废纸回收



图3:绿色办公 垃圾分类

### 推出多渠道电子账单, 促进无纸化绿色办公

景顺长城在积极推广绿色办公方面做出了切实努力, 在官网为投资者提供微信账单、邮件和短信账单订阅服务。景顺长城官网开设“**电子账单订阅**”专栏, 专栏包含微信账单及邮件和短信账单订阅的详尽步骤、在线智能客服、专人办理相关服务的官方热线等。

以邮件和短信账单订阅为例, 投资者可登陆景顺长城网上交易系统, 根据自身需求勾选定制内容, 可定制的邮件包括持有月度对账单, 可定制的短信包括持有基金周末净值、短信账单(包括月末份额和资产市值)。除邮件和短信账单订阅的电子账单方式, 投资者也可订阅微信账单。景顺长城官网智能客服窗口也为投资者提供了一个快捷咨询答疑的平台, 若投资者在电子账单订阅中有任何疑问, 可第一时间通过智能客服窗口进行咨询。

截至2022年底, 大部分客户已经自行查询相关信息或定制电子账单。由纸质账单到电子账单的转变体现了景顺长城为推进无纸化办公而作出的积极努力, 也持续向投资者传递公司绿色低碳的办公理念。



图4: 景顺长城官网电子账单订阅专栏

### 绿色生活

- 提倡自觉节水, 在水用间隙提倡关闭水龙头, 避免水源空流;
- 除商务会议外, 提倡饮水机用水, 减少瓶装水饮用;
- 鼓励员工在公司就餐、饮水时需自备餐具或水杯, 尽量减少使用一次性用品/餐具/纸杯等;
- 进行垃圾分类, 废旧报纸、废弃咖啡胶囊等物件可统一放置于指定位置, 由专人回收及处理。

## 第七章 投融资活动的环境影响

## 一、整体投融资活动

### (一) 投融资概况及较上一报告期的变动情况

截至2022年末,景顺长城投资活动总额39,329,007.80万元<sup>1</sup>,同比2021年末减少750,179.78万元,减少1.87%。

依据证监会行业分类<sup>2</sup>,景顺长城2022年投资活动所在行业主要为金融业、制造业以及交通运输、仓储和邮政业,占比分别为39.17%、33.96%、3.27%。2021年投资活动所在前三大行业为制造业、金融业以及电力、热力、燃气及水生产和供应业,占比分别为41.84%、29.89%、4.06%。

表8:景顺长城2022年度投资行业分布概况

		金额(万元)	比例
投资活动总额		39,329,007.80	100%
投资活动前十大行业	金融业	15,405,959.78	39.17%
	制造业	13,354,856.55	33.96%
	交通运输、仓储和邮政业	1,286,003.74	3.27%
	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,240,373.85	3.15%
	采矿业	1,149,501.97	2.92%
	租赁和商务服务业	989,212.46	2.52%
	综合	835,481.07	2.12%
	建筑业	806,707.00	2.05%
	信息传输、软件和信息技术服务业	801,326.22	2.04%
	科学研究和技术服务业	708,661.77	1.80%

表9:景顺长城2021年度投资行业分布概况

		金额(万元)	比例
投资活动总额		40,079,187.58	100%
投资活动前十大行业	制造业	16,770,843.42	41.84%
	金融业	11,979,889.68	29.89%
	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,628,438.42	4.06%
	交通运输、仓储和邮政业	1,542,945.70	3.85%
	租赁和商务服务业	1,139,637.13	2.84%
	信息传输、软件和信息技术服务业	991,799.26	2.47%
	科学研究和技术服务业	982,022.34	2.45%
	其他:未分类债券(含国债等)	979,559.18	2.44%
	房地产业	870,276.30	2.17%
	综合	746,619.76	1.86%

<sup>1</sup>来自公开披露的2022年基金年报股票和债券数据

<sup>2</sup>公开披露的2022年基金年报的股票和债券持仓均参照该行业分类



## 二、绿色投融资活动情况

### (一) 绿色资产管理产品

景顺长城根据中国证券投资基金业协会《绿色投资指引(试行)》中“绿色投资范围应围绕环保、低碳、循环利用,包括并不限于提高能效、降低排放、清洁与可再生能源、环境保护及修复治理、循环经济等”相关界定,选取公募基金中与上述绿色投资领域相关的主题基金进行绿色资产管理产品统计。

景顺长城积极布局绿色资产管理产品,在2021年和2022年分别发行2只绿色资产管理产品,涵盖ESG和新能源等投资主题。

表10:景顺长城绿色资产管理产品统计

统计数据	2021年	2022年
新发行的绿色主题资产管理产品规模(万元)	1,128,488.42	18,570.68
期末运作的所有绿色主题资产管理产品规模(万元)	2,082,513.29	1,162,709.14
期末绿色主题资产管理产品占资产管理产品总规模的比例(%)	3.82	2.21

注:资产管理产品总规模指公司公募基金管理规模

### (二) 自有及管理资产投资于绿色金融工具及绿色企业(项目)情况

#### 绿色企业标准

本年度景顺长城界定绿色企业的标准为,依据被投资企业发布的年度财务报告中所记录的分行业细分收入情况,判断其中是否有“绿色”收入,对存在“绿色”收入的企业,界定为绿色企业。

目前市场上对于“绿色”尚未有统一标准的定义,因此景顺长城在选择和使用相关数据时,主要参考国家已经公开发布的《绿色产业指导目录》和《绿色债券支持项目目录(2021年版)》作为指南,以尽可能对“绿色”有符合我国市场特色的、相对客观的标准参考。

实际统计中,景顺长城根据企业披露的分行业收入颗粒度和数据计算结果,判断相关企业是否开展绿色业务,进而将有绿色业务的企业判定为绿色企业。

该界定与统计机制将随未来国内与国际上对于“绿色”活动判定标准的持续完善、相关标准或指引的出台而不断迭代更新,力求与国家低碳发展趋势和重点关注的低碳领域契合,更好地适应绿色发展新形势和新要求。

#### 绿色债券标准

本年度景顺长城绿色债券的判断标准为符合《绿色债券支持项目目录(2021年版)》中有关绿色债券定义的相关债券。

2022年末, 报告期末自有及管理的资产<sup>3</sup>投资绿色资产总值为3,826,157.40万元, 较去年末下降885,012.30万元, 下降18.79%。2022年公司投资绿色资产总值占对应投资活动总额<sup>4</sup>的7.28%。

从资产类别来看, 2022年公司投资于绿色企业和绿色债券的资产市值分别为3,749,325.38万元和76,832.02万元, 分别占绿色投资资产总值的97.99%和2.01%。2022年绿色投资资产结构相较上一年度, 绿色企业资产市值减少900,488.39万元, 占绿色投资资产总值比例下降0.71%;绿色债券资产市值增加15,476.09万元, 绿色债券的违约率为0%。

表11: 景顺长城自有及管理的资产投资于绿色企业的情况

资产类别	2021年		2022年		变动情况	
	期末资产 市值(万元)	占绿色投资资产 总值比例	期末资产 市值(万元)	占绿色投资资产 总值比例	期末资产 市值(万元)	占绿色投资资产 总值比例
绿色企业(股权及证券)	4,649,813.77	98.70%	3,749,325.38	97.99%	-900,488.39	-0.71%
绿色债券	61,355.93	1.30%	76,832.02	2.01%	15,476.09	0.71%
绿色投资资产总值	4,711,169.70	100%	3,826,157.40	100%	-885,012.30	—

### (三) 投资对象环境信息披露情况

我司的投资主体会根据国家及相关部门要求披露相关环境信息。以我司投资的上市公司为例, 上市公司需要根据《企业环境信息依法披露管理办法》、《上市公司治理准则》、《公开发行证券的公司信息披露内容与格式准则第2号——年度报告的内容与格式》和交易所等相关法规披露环境信息。

## 三、整体投融资活动碳排放

### (一) 投资组合碳排放测算方法学

景顺长城将国际方法与中国本土权威实践经验相结合。公司参照碳会计金融合作伙伴关系的《金融业适用的全球温室气体的核算及报告标准》(Global GHG Accounting & Reporting Standard of the Partnership for Carbon Accounting Financials, 简称《PCAF标准》) 当中介绍的计算方法学, 以投资组合的市值将碳排放量进行标准化。

依照这种方法, 公司挑选了一只绿色金融主题方面具有代表性的基金景顺长城国证新能源车电池ETF, 目前碳核算的范围仅包括该基金中自主披露碳排放数据的被投资企业持仓, 核算的持仓市值占基金规模的63.8%。

<sup>3</sup>来自公开披露的2022年基金年报股票和债券数据

<sup>4</sup>2022年公司的公募基金管理规模

在此基础上,公司对该基金截止2022年12月31日的碳足迹进行测算,并以每百万元投资额所产生的二氧化碳当量作为单位列示,具体计算公式如下:

$$\frac{\sum_i \frac{\text{投资现值}_i}{\text{被投资企业的企业价值}_i} \times \text{被投资企业的范围1及范围2温室气体排放量}}{\text{投资组合现值(百万元)}}$$

## (二) 投融资活动碳排放情况

表12: 景顺长城投资活动碳排放数据汇总

指标名称	单位	披露数据
投融资活动碳排放量	吨二氧化碳当量	2,690.97
纳入碳核算的投融资业务比例	—	0.10%
纳入碳核算的投融资金额	万元	51,830.70
投融资活动碳排放强度	吨二氧化碳当量/百万元	5.19

注:纳入碳核算的投融资业务比例=纳入碳核算的基金的2022年规模/2022年公司的公募基金管理规模;纳入碳核算的投融资金额指纳入碳核算的基金的2022年规模

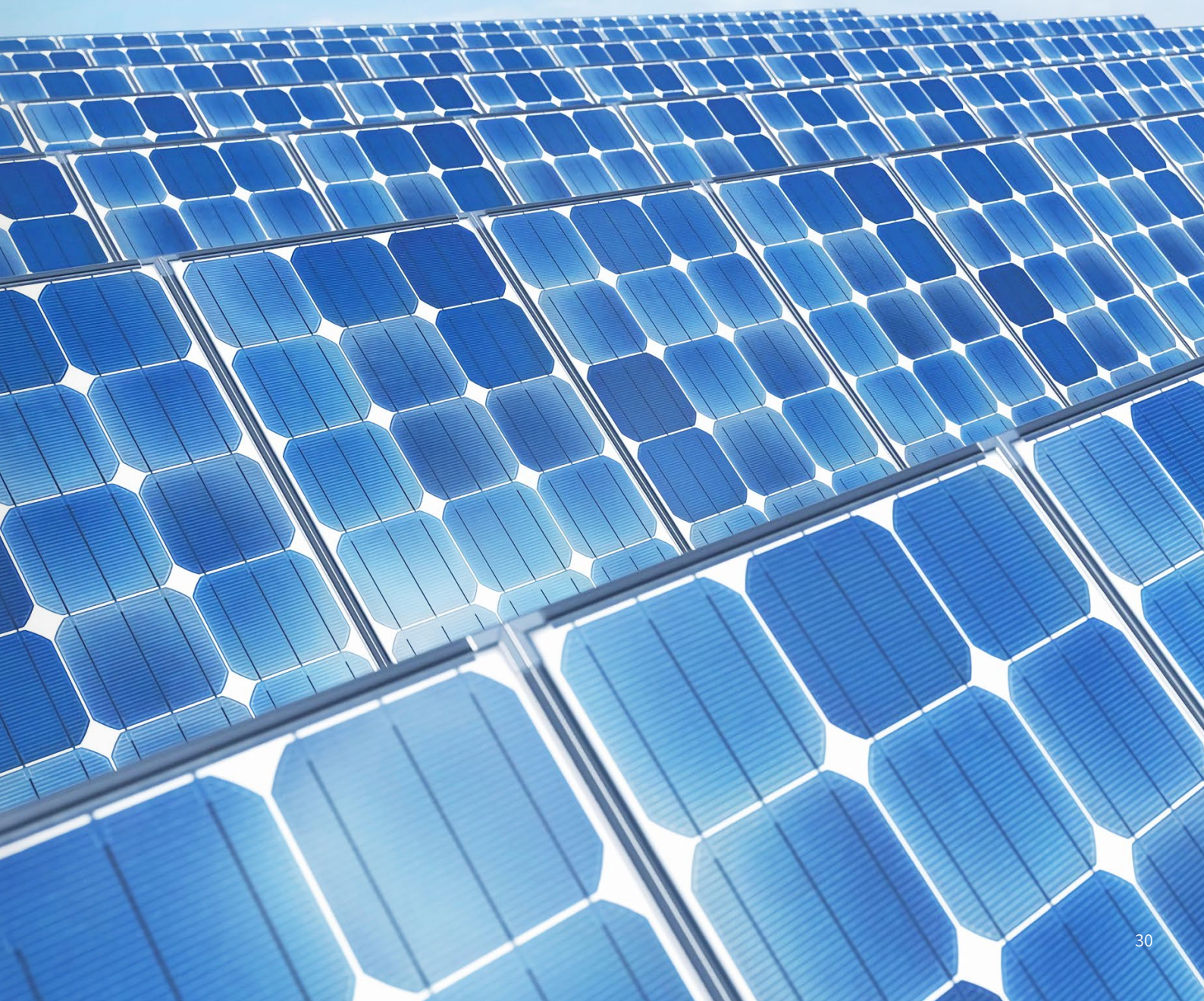
## (三) 投融资活动碳核算计划

公司计划按照《深圳市金融机构环境信息披露指引》要求开展投资组合碳足迹测算,并在ESG框架的气候变化议题中切实考虑碳排放指标。面对碳达峰及碳中和战略下的机遇和挑战,公司作为生态圈中专业的资产管理人,坚决支持双碳战略,坚持绿色、协调、可持续发展理念,积极发挥投资端功能,推动实体经济高质量发展。在责任投资政策实施的基础上,公司将在投研过程和积极所有权等方面纳入考量,积极发挥自身影响力推动绿色投资,引导各利益相关方共同构建绿色发展生态圈,支持我国实体经济的可持续发展,助力双碳目标的实现。





## 第八章 绿色金融交流、培训及公益





## 一、公开交流

公司积极响应“双碳”目标,加强与相关监管、学术、行业主体开展ESG和绿色金融主题交流与研究合作,在ESG生态圈中活跃发声。2022年,公司参与多场绿色金融相关对话与研讨,在推动行业践行绿色责任投资和促进被投资人绿色转型进程中贡献自身观点。公司在支持实体经济低碳转型、ESG投资策略应用、ESG产品创新、ESG评价方法等方面积极输出观点和研究,致力于与生态圈中相关主体在关键突破点上合力突破建设ESG和绿色金融生态。

**清华五道口金融支持行业低碳转型论坛:**清华五道口金融支持行业低碳转型论坛邀请来自监管、学术和行业知名专家,共同探讨在碳中和目标下,煤炭开采、燃煤发电、钢铁等重点行业的碳减排现状,以及金融如何支持重点行业转型等问题。2022年12月,公司受邀参加该论坛,以“金融支持实体经济低碳转型”为主题进行深入探讨与分享,针对金融如何支持重点行业的低碳转型提出独特见解。论坛期间,公司、公司外方股东景顺与清华大学联合发布了《煤炭开采、燃煤发电、钢铁行业上市公司碳排放现状和转型分析》报告。

**中信证券2022年资本市场论坛:**中信证券资本市场论坛邀请上市公司和投资人共话全球与中国经济最新形势、产业发展最新动态、资本市场最新机遇。景顺长城受邀在“覆盖扩容投资优化,迈向ESG赋能新阶段”分论坛上就“创新指数产品,量化投资中的ESG应用探索”进行演讲,与来自其他基金和企业的专家共同探讨ESG在金融行业的应用方案。

**第十五届中国企业社会责任报告研讨会:**中国企业社会责任研讨会由可持续发展经济导刊、中国可持续发展工商理事会、金蜜蜂智库主办,瑞典驻华大使馆企业社会责任中心联合主办,就全球企业社会责任报告最新发展趋势、企业的责任沟通之道、CSR报告的价值探索等议题进行深度研讨。景顺长城受邀参与圆桌论坛“ESG评级与有意义的的数据”,与全球行业前沿专家和学者共同就ESG可持续发展议题进行研究与交流。

**第三届1024国际资管科技开发者大会(IITDC 2022):**国际资管科技开发者大会聚焦资管科技领域,景顺长城受邀在“资管科技基础设施与领域技术应用”论坛中发表“基本量量化在ESG方向的应用实证”主题演讲,将ESG主题引入大会议题中,并与来自其他基金公司和科技行业的专家展开探讨。

**媒体与公开传播:**公司广泛运用媒体等公开渠道与投资者就ESG投资展开对话。景顺长城副总经理黎海威多次通过证券时报、上海证券报等媒体,向投资者介绍ESG概念、普及ESG策略、解读公司ESG投资理念和量化领域的发展,被多家媒体转载。



图 5:清华五道口金融支持行业低碳转型论坛



图 6:第三届1024国际资管科技开发者大会(IITDC 2022)

## 二、能力建设

为提升员工的ESG和绿色金融认知与技能,公司多次开展内部培训帮助员工全局把握全球ESG前沿动态,深入了解ESG相关政策,洞察ESG相关风险与机遇以支持公司更好地满足监管要求和客户需求,洞察投资风险与机遇。

**金融Mini讲堂:**公司在内部培训讲堂——金融Mini讲堂中加入ESG主题,向公司内部员工介绍ESG发展历史及公司ESG能力建设,旨在提升员工的ESG素养和业务实操,推动ESG和绿色金融理念成为公司业务可持续发展的重要驱动力。

**ESG专题培训:**公司邀请专业机构为员工开展ESG专题培训,主题涵盖ESG相关政策、国际和国内市场发展、前沿介绍、ESG评级方法、ESG系统应用、ESG投资策略介绍,旨在全面推动公司ESG和绿色金融研究和应用能力。



图 7: 景顺长城内部ESG专题培训讲堂



图 8: 景顺长城与上海真爱梦想基金成立“梦想中心”

## 三、公益活动

作为一家有温度的资产管理公司,长期以来,景顺长城在帮助投资者实现财富梦想的同时,一直不忘履行企业社会责任,近年来陆续参与“免费午餐”、“真爱梦想儿童素养计划”、“杉树高中生助学计划”等公益项目。同时,景顺长城也积极参与腾讯公益发起的“99公益日”活动,并为“真爱梦想儿童素养计划”和“杉树高中生助学计划”提供1:10配捐激励。

2022年2月,景顺长城和真爱梦想公益基金会合作,为海南省保亭黎族苗族自治县六弓乡中心学校和宁夏回族自治区固原市西吉县将台堡镇第一小学捐赠**梦想教室**,支持其开展素养教育。景顺长城自2019年至今已为四所边远地区小学捐赠了梦想教室。景顺长城希望能够通过建立梦想教室来让孩子们享受更加公平的素质教育软件设施,为孩子们带来思想的突破、视野的拓展和理念的创新,构建看见未来、迎接未来的能力,希望梦想教室能陪伴每一个孩子的梦想起飞。

2022年5月，景顺长城与河北省当地政府部门联合成立“**景顺长城辛旺庄养老保障基金**”，该基金用于张家口市阳原县辛旺庄村特困户的养老保障。辛旺庄村地处阴山余脉脚下，曾是远近闻名的贫困村。景顺长城坚决深入贯彻落实国家重大决策部署，积极助力脱贫攻坚成果的巩固、农村养老难题的破解和乡村振兴战略的实施。

2022年8月，景顺长城联合外方股东景顺共同出资，参与杉树公益基金的“**杉树高中生助学计划**”，成立“景顺长城杉树班”，为40名贫困高中生提供三年的生活资助，帮助有梦想的学子推开大学的门窗。景顺长城希望通过投入教育公益资源，助力更多孩子们通过知识改变命运，让爱心在希望中绽放，让希望在教育中成长。

2022年9月，景顺长城参与腾讯公益发起的“**99公益日**”活动，并为“真爱梦想儿童素养计划”和“杉树高中生助学计划”提供1:10配捐激励。“99公益日”是由中央网信办网络社会工作局和民政部社会组织管理局指导，腾讯公益慈善基金会发起的一年一度国内最大的全民互联网公益活动。景顺长城希望能利用该平台的全国影响力并利用配捐激励的形式来让更多人关注并参与公益活动。



图 9：“杉树高中生助学计划”和“真爱梦想儿童素养计划”



## 第九章 绿色金融创新案例及成果奖项



## 一、绿色金融创新实践案例

公司积极开展包括评估环境风险和机遇在内的ESG研究，其中公司也将包括排污因子在内的环境相关评价指标纳入考量。排污企业需要排污许可证才可以正常运营。公司在已建立ESG理念和制度先导的基础上，及时捕捉到监管动向，整合生态环境部公示企业的排污许可证信息和实际排放情况，开发排污因子指标，帮助公司衡量上市企业在排污方面的绩效及可能面临的监管压力，在投研中纳入更多环境因素的考量。

公司通过下述步骤实现排污因子指标的构建和使用。



## 二、绿色金融成果奖项

景顺长城响应国家战略和行业趋势，积极投入绿色金融和ESG领域的专业建设，在2022年荣获2022“绿水金山奖”金融业评选——“绿色金融先锋奖”和2022年度财经网金融业评选“绿色金融奖——年度ESG企业”。相关荣誉表彰了景顺长城在绿色金融和ESG投资领域的优秀实践能力与卓越创新精神，凸显了景顺长城作为一家优秀金融机构的社会责任与担当。



图10：景顺长城荣获2022“绿水金山奖”金融业评选——“绿色金融先锋奖”

### 2022“绿水金山奖”金融业评选——绿色金融先锋奖：

财联社与生态环境部环境规划院于2022年12月22日在北京联合举办的中国ESG金融峰会上，推出2022“绿水金山奖”金融业评选，表彰2022年对绿色金融界作出突出贡献及创新的金融机构，感谢机构为绿色生态的构建以及生态文明的发展做出了有负责任的选择、有影响力的工作。景顺长城因在绿色金融领域的积极探索和实践，获得“绿色金融先锋奖”，体现了金融行业对景顺长城在绿色金融方面创新成果的认可，展示了景顺长城作为金融机构所承担的社会责任与担当。

### 2022年度财经网金融业评选——绿色金融奖——年度ESG企业：

2022年度财经网金融业评选表彰了在社会责任感、产品服务、品牌文化、绿色金融、公益企业方面拥有卓越表现的企业。景顺长城积极将ESG纳入投资决策，在绿色投资方面具有突出实践能力，为ESG投资体系的建设与完善作出贡献，获得“绿色金融奖——年度ESG企业”之荣誉。



### 三、绿色金融研究

2022年,景顺长城积极参与低碳主题研究,以期金融支持实体经济低碳转型提供有针对性的投资方法论支持。在针对煤炭等重点行业的行业研究中,景顺长城深入了解该行业ESG相关现状,识别该行业ESG相关实践以及未来发展趋势。相关研究成果在投资层面将帮助公司合理评价重点行业以及该行业公司的ESG表现,确定该行业特定的ESG相关风险与机遇,从而减少相关投资风险,洞察行业投资机遇。同时,此类研究也为重点行业以及公司的低碳转型提供建议,助力提升该行业的整体环境表现。

#### 《煤炭开采、燃煤发电、钢铁行业上市公司碳排放现状和转型分析》研究报告

自2021年10月开始,清华大学国家金融研究院绿色金融研究中心(CGFR)与景顺集团及景顺长城围绕“双碳”目标下重点行业上市公司的转型压力和绿色收入研究”开展合作研究。2022年,相关研究报告《煤炭开采、燃煤发电、钢铁行业上市公司碳排放现状和转型分析》正式发布。该报告结合三个行业内具有代表性的上市公司进行案例研究,整理并分析企业和行业的碳排放现状,识别企业的可持续活动,基于最新趋势评估企业信息披露现状。该报告对企业针对碳达峰碳中和目标的转型路径进行分析,探索企业低碳转型的未来趋势,并从企业和金融机构的角度,提出相关建议。



图11:《煤炭开采、燃煤发电、钢铁行业上市公司碳排放现状和转型分析》研究报告

#### “煤炭电力行业上市公司碳排放计算及转型分析”课题研讨会

“煤炭电力行业上市公司碳排放计算及转型分析”课题研讨会于2022年8月由清华大学国家金融研究院绿色金融研究中心(CGFR)举办。研讨会由来自上市公司、金融机构、交易所、学术机构等10余位专家学者围绕煤炭和电力行业主题、结合自身专业背景及所属行业发表洞察观点。讨论的议题包括上市公司ESG信息披露的现状、企业气候信息披露的挑战和未来趋势、企业应对“双碳”目标的技术转型路径和金融支持高碳排放行业转型可能发挥的作用等问题。

景顺长城代表受邀参会,在会上介绍了国际市场对我国参与的G20可持续金融工作组及其起草的G20转型金融框架的关注,并表示该框架为各国未来的转型金融提供了有效的路径支持。

# 第十章 数据梳理、校验及保护





景顺长城高度重视数据质量，在已有的数据梳理、校验及保护机制上，保障绿色业务相关数据安全和质量。

## 一、数据梳理、校验及保护

公司建立了较为完备的数据梳理、校验及保护机制，通过体系化、规范化的制度文件规范数据保护，包括《景顺长城基金管理有限公司信息技术数据管理规范》《景顺长城基金管理有限公司个人信息管理规范》《景顺长城基金管理有限公司信息技术网络安全事件处理规范》《景顺长城基金管理有限公司信息系统事件管理指引》《景顺长城基金管理有限公司信息技术网络安全应急处置预案》等，内容涵盖信息相关部门的组织与职责、数据收集、数据校验、数据分类、数据分级、数据保护、信息系统运行管理及监督机制等数据管理相关制度规范。公司依据前述制度开展数据质量管理和保护工作，建立了数据管理系统与流程，提升数据质量，保证数据及时性和准确性。

公司通过信息系统开展数据管理，其中包括环境数据管理。公司已获得管理体系认证证书，证明公司信息安全管理符合ISO/IEC 27001:2003标准，证书对下列产品或服务范围有效“信息安全管理体系涵盖包括市场、投资、运营在内的基金管理业务信息系统的运行、支持和维护”。

## 二、数据安全应急预案

公司制定《景顺长城基金管理有限公司信息技术网络安全应急处置预案》，此预案规范公司信息系统突发事件应急响应和灾难处置流程，及时、准确、动态地对系统故障进行监控与处理，有效预防及最大限度地消除信息系统故障事件的危害和影响，提高重要信息系统突发事件的处置能力。

《景顺长城基金管理有限公司信息技术数据管理规范》《景顺长城基金管理有限公司个人信息管理规范》《景顺长城基金管理有限公司信息技术网络安全事件处理规范》《景顺长城基金管理有限公司信息系统事件管理指引》等制度对安全事故处置进行补充性规定，强调通过定期开展应急预案的知识培训、安全演练，在全公司树立信息安全意识和预防措施，并将处理环节延伸到信息系统应急处置后的整改等环节，在全公司实现对数据安全的全周期管理。

为将应急预案从纸面文字转化为切实可行的行动方案，公司注重对内部的数据安全培训和演练。2022年，公司在全公司范围内开展“身边的幽灵：漫谈信息安全意识”的主题培训活动，从身边可见的个人信息泄露、密码安全、免费Wifi、二维码等与信息安全的要素讲起，逐步深入到工作中的信息安全案例讲解和国家信息安全实践分析，带领员工由浅入深了解与信息数据安全相关的漏洞、U盘安全、钓鱼事件、勒索病毒、社会工程学、黑客攻击、APT攻击等事件。培训还向全体员工介绍《网络安全法》相关规定，提出信息安全防范指南。2022年，公司信息技术部还牵头在全公司开展钓鱼邮件测试，并形成“防范钓鱼邮件，做到‘五不要’”的总结报告，旨在提升全体员工数据安全防范意识。2022年开展了两次灾备切换演练，模拟了四十多个场景下公司灾难恢复能力，通过开展实战化的演练，不断完善应急处置能力和应急预案，提升公司应急处置水平。

## 附录:景顺长城环境信息披露指标索引表

一级指标	二级指标	三级指标	页码
基本信息			01-02
战略目标	环境、绿色金融相关目标		04-05
	环境、绿色金融相关发展战略		05
治理结构	董事会层面		07
	高级管理层		07
	专业部门层面		07
政策制度	内部政策	现行的环境、绿色金融相关政策制度	11
		报告期内实施的新政策	11
	外部政策	遵循的外部环境、气候及绿色金融相关政策法规情况	09-10
		加入国内外相关倡议组织的情况	10
环境风险管理	环境风险及机遇管理机制	环境风险的识别、评估和监控流程	13
		业务风险管理流程中对环境风险和机遇的体现	13-16
		针对环境相关风险暴露的应对预案	16
	识别的环境风险和机遇	识别的短期、中期、长期环境相关风险和机遇	17-18
		环境相关风险和机遇对战略、业务和财务规划的影响	17-18
		应对环境影响采取的措施和效果	17-18
经营活动的环境影响	经营活动能源消耗	自有交通工具(移动源)消耗的燃油	20
		营业办公消耗的电力总量及人均用电量	20
		雇员因差旅出行乘坐的交通工具消耗的能源	20
	营业办公耗水	耗水总量	20
		人均耗水量	20
	纸张消耗	营业、办公纸张消耗总量	20
	废弃物排放	营业、办公场所的废弃物产生及处置情况	20
		直接温室气体排放总量(范围一)	20
		能源间接温室气体排放总量(范围二)	20
		其他经营活动间接温室气体排放(范围三): 雇员差旅出行及差旅住宿产生的间接二氧化碳排放	20
	经营活动二氧化碳排放总量	20	



(续表)

一级指标	二级指标	三级指标	页码
经营活动的环境影响	温室气体排放	人均经营活动二氧化碳排放	20
	环保措施及环境效益	环保措施	23-24
投融资活动的环境影响	整体投融资情况	投融资概况及较上一报告期的变动情况	26
		绿色资产管理产品	27
	绿色投融资活动情况	自有及管理资产投资于绿色金融工具及绿色企业(项目)情况	27-28
		投融资活动碳排放量	28-29
	整体投融资活动碳排放	投融资活动碳排放强度	28-29
	投融资活动碳核算计划	29	
能力建设	宣传教育		31-33
创新及研究	绿色金融创新实践案例		35
	绿色金融成果奖项		36
	绿色金融研究		37
数据质量管理	数据梳理、校验及保护		39
	数据安全应急预案		39



景顺长城  
Invesco Great Wall

景顺长城基金管理有限公司

深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第一座21层

400-8888-606

[www.igwfm.com](http://www.igwfm.com) | [investor@igwfm.com](mailto:investor@igwfm.com)