

安信基金管理有限责任公司 环境信息披露报告

报告年度： 2022 年度

编写单位： 安信基金管理有限责任公司

编制日期： 2023 年 6 月 30 日

目 录

报告编制说明	3
一、基本信息	4
二、战略目标	5
三、环境及绿色金融相关治理结构	6
四、环境及绿色金融相关政策制度	6
五、环境风险管理	7
六、经营活动的环境影响	11
七、投融资活动的环境影响	14
八、绿色金融培训及公益活动	18
九、绿色金融创新案例及成果奖项	20
十、数据梳理、校验及保护	22
附录一：经营活动的环境影响计算方法	25
附录二：基金投融资活动的碳足迹碳排放计算方法	27

报告编制说明

（一）报告时间范围

2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日。

（二）报告编制范围

本报告覆盖深圳总部及北京、上海分公司。

（三）指代说明

为便于表达，本报告中“安信基金”“我司”“我们”“本公司”均代指“安信基金管理有限责任公司”。

（四）报告编制依据

本报告根据《深圳经济特区绿色金融条例》、《深圳市金融机构环境信息披露指引》的要求编制。

（五）报告数据说明

本报告中的数据以 2022 年为主，部分包括以前年度数据，主要来自内部相关数据收集系统和统计报表。除特别说明，本报告所涉币种均为人民币。

（六）报告发布形式

本报告以电子版形式发布。

一、基本信息

（一）组织基本信息

机构名称：安信基金管理有限责任公司

英文名称：ESSENCEFUND MANAGEMENT CO. , LTD.

注册资本：人民币 5.0625 亿元

注册地址：广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界
商务中心 36 层

所属行业：公募基金行业

单位性质：有限责任公司

法定代表人：刘入领

统一社会信用代码：9144030058674847XF

全球法人识别编码：300300E2005244000069

经营范围：公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户
资产管理

（二）联系方式

总部所在地：广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世
界商务中心 36 层

官方网址：www.essencefund.com

邮政编码：518000

公司传真：0755-82799292

联系电话：0755-82509999

联系邮箱：axjj@essencefund.com

二、战略目标

（一）环境、绿色金融相关目标

为响应国家 2030 年“碳达峰”与 2060 年“碳中和”的战略目标，公司积极践行可持续发展理念，履行社会责任，紧紧抓住绿色低碳的时代发展趋势，推进可持续发展理念与公司经营深度融合。公司始终坚持长期投资、价值投资、责任投资，在投资决策和流程中除了关注标的业绩和财务指标外，也关注环境、社会责任和公司治理等投资因素，积极发挥资本市场优化资源配置、服务实体经济的功能，支持和促进生态文明建设。同时，公司注重自身的可持续发展，自创立之初就确定了“投研立司、持有人利益至上、合规事件零容忍”等指导原则，围绕“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化建设核心价值观，通过强化内部管理，加强风险与合规管理，推动各项业务高质量可持续发展。

近年来，公司投资业绩持续稳健，资产规模快速增长，市场排名显著提升，风险控制效果显著。目前，公司已布局医药健康、科技硬件、新能源、数字经济等新兴行业主题基金，正在积极研究 ESG、专精特新等符合国家战略发展方向、具备长期投资价值的主题基金。旗下安信消费医药主题股票型基金于 2018 年-2020 年连续三年获得由上海证券报颁发的“金基金”责任投资（ESG）基金奖，安信新回报灵活配置混合型证券投资基金于 2021 年获得“金基金”责任投资（ESG）基金奖。这是业界对我司积极践行责任投资理念的充分肯定。

（二）环境、绿色金融相关发展战略

作为一家肩负社会责任和使命感的金融机构，安信基金始终将

自身发展同国家前途紧密结合在一起，将“双碳”目标植入公司发展理念，未来公司将继续把握国家生态文明建设中的金融机遇，积极履行绿色金融责任担当，主动培育绿色金融投研体系，输出践行绿色金融的优质产品，助力中国资本市场的发展和经济结构转型。

三、环境及绿色金融相关治理结构

（一）董事会层面

公司目前尚未设置环境、绿色金融委员会。

（二）高级管理层

公司日常的绿色投资工作主要由投资决策委员会承担。

（三）专业部门层面

公司设有投资决策委员会制度，其中基金投资决策委员会是公司进行基金资产投资管理的最高投资决策机构，特定资产投资决策委员会是公司进行特定资产投资管理的最高投资决策机构。投资决策委员会定期召开会议，在投资过程中将环境气候和社会贡献作为重要的参考工具，建立了环境负面清单，规避或减少投资于环境违规企业，积极践行低碳减排投资活动，力争在帮助投资者实现长期回报的同时，助力实现社会可持续发展目标。

四、环境及绿色金融相关政策制度

（一）遵循的相关政策法规情况

本公司严格遵守环境相关国家战略及法律法规，切实落实行业监管指导及信息披露要求，积极响应国内外组织的相关倡议，在报告期内未受到生态环境、绿色金融相关行政处罚、司法判决等。

2015年，中共中央、国务院发布《生态文明体制改革总体方案》，首次提出建立绿色金融体系，2016年中国人民银行等七部委联合印发《关于构建绿色金融体系的指导意见》，将绿色金融体系上升至国家战略，绿色金融这一顶层战略的发展思路逐步明确。本公司响应国家“双碳”目标和“十四五”规划，严格遵守《中华人民共和国节约能源法》、《中华人民共和国环境保护法》等环境相关法律法规，做好了积极承担金融机构环境与社会责任的准备。

随着绿色金融发展政策的日益完善，有关企业环境信息披露的政策及指导也不断出台和完善。本公司作为基金业协会资产管理类会员机构，根据基金业协会发布的《绿色投资指引（试行）》及相关通知，按照要求开展绿色投资情况自评估，填报相关问卷材料。作为金融机构，本公司遵循《深圳经济特区绿色金融条例》以及2021年中国人民银行发布的《金融机构环境信息披露指南》、2022年深圳金融局等联合印发的《深圳市金融机构环境信息披露指引》要求，按照其中环境信息披露的统一内容指引组织编写公司年度环境信息披露报告，以贯彻落实金融机构环境信息披露工作。

（二）加入相关倡议组织情况

我司已于2021年加入深圳市绿色金融协会，并参加了深圳市绿色金融协会第一届会员大会第一次会议，参与审议了深圳市绿色金融协会章程等协会文件，积极响应协会各项工作倡议。

五、环境风险管理

（一）环境风险及机遇管理机制

金融机构与气候变化的关系不仅体现为金融是助力应对气候变化的工具，同时气候变化也会通过极端天气、政策变化等方式将风

险传导至金融机构。公司将气候变化纳入风险管理体系，以进一步理解并更有效地管理业务开展和运营过程中的环境风险，把握环境风险所带来的机遇。

在业务层面，加入气候因素的影响分析，在进行投资决策时践行可持续社会责任投资，关注具备环境属性的资产，以及在专业机构环境评级中获得较高得分的投资标的，优选各个行业质地优秀、环境表现突出、具备长期价值增长潜力的投资标的，引导社会资金流向绿色低碳、环境保护的企业，服务于建立健全绿色低碳循环发展经济体系。

在日常运营方面，公司倡导低碳环保的运营和工作方式，努力减少资源能源消耗及废弃物排放，深入挖掘节能减排潜力，以自身实践配合国家及行业绿色发展战略。公司不断加强员工环境理念以及环境投资培训，不断完善公司环境管理体系，推动经济和社会的可持续发展。

在进行具体的投资研究分析时，公司融入环境相关尽职调查，优先支持国家政策鼓励的产业，加强对高耗能行业相关企业风险评估的关注程度，对高环境风险领域的项目，将在尽职调查中重点关注其环境风险并加强风险管理。在投资决策环节，公司将环境因素纳入考虑范围，全面评估投资标的的可持续发展能力和社会责任的履行情况。在投资策略构建过程中充分考虑企业环境维度的风险和机遇，研究上市公司环境属性并关注在专业机构环境评级中获得较高得分的上市公司；考虑各类信用主体的环境因素，应用于业务管理中，对于社会及环境有重大负面影响的投资标的，需进行谨慎评估后再做投资决策。在产品组合管理中，纳入环境风险评价，关注

投资组合的环境风险敞口。

针对环境相关风险暴露，公司将持续跟踪重点关注企业在生产经营过程中对外部环境带来的影响及环境风险评分，推动并参与绿色金融创新，重点关注并投资于清洁能源产业，引导产业结构、能源结构向绿色低碳转型。鼓励员工养成绿色低碳的生活方式，强化极端气候灾害风险防范措施，开展应急救援能力培训。

（二）环境风险与机遇分析

在分析环境风险与机遇时，我们参考气候相关财务信息披露工作组（TCFD）披露框架，在公司层面积极识别、评估和管理气候变化实体风险与转型风险及机遇对运营及业务的影响，就已识别的主要环境相关风险和机遇的潜在财务影响展开评估，并制定风险管理和策略性规划以积极应对气候变化。具体如下：

环境相关风险分析				
风险类型	具体描述	影响时期	潜在影响	应对措施
急性气候风险	公司、客户及投资标的的实体运营单位可能面临因台风、飓风或洪水等极端气候灾害导致财产损失或运营中断。	短期	固定资产贬值、投资组合价值下降、营业收入减少、信用风险上升	制定突发事件应急处理预案，开展应急救援能力培训，对自身、企业客户的极端事件进行监控并及时预警，以应对突发性极端气候事件带来的影响。
慢性气候风险	海平面上升、持续性高温等长期气候模式转变可能对特定行业，如房地产、交通、能源、林业、农业和旅游业等影响较大，导致该特定行业成本上升和服务中断等，致使违约概率增加，可能会影响部分投资标的的市场估值。	中期、长期	运营成本增加、投资组合价值下降	管控业务活动中的气候风险，完善对实体风险敏感型企业的风险识别，强化环境风险尽职调查、投资决策及后续管理。

政策及法律风险	环保及气候相关政策的不断出台与监管政策收紧会影响到公司、客户及投资标的的经营，传统行业例如钢铁、石化、火电企业等，可能会面临着生产成本上升、财务状况恶化的风险。公司、客户及投资标的可能因无法满足政策和监管要求面临违约、处罚、诉讼等事件，并造成损失。	中期、长期	投资组合价值下降、信用风险上升、营业收入减少	
市场风险	低碳转型政策可能导致市场偏好转向，将资金流入低碳领域、流出高排放领域。因市场供需结构的改变，公司客户及投资标的可能会面临产品价格降低、原材料价格上升、产品不能满足市场需求等经营风险，如“两高一剩”行业及传统高排放行业客户、标的无法实现低碳转型，将导致企业资本和收入双重损失，同时影响投资者和债权方的利益。	短期、中期、长期	固定资产贬值、投资组合价值下降、信用风险上升	重点关注企业在生产经营过程中对外部环境带来的影响，在尽职调查中重点关注高环境风险领域项目的环境风险，进行投资决策时，将环境因素纳入考虑范围，全面评估投资标的的可持续发展能力。积极开发和引入符合绿色或 ESG 理念的金融产品和服务，鼓励绿色金融产品与服务创新，丰富绿色金融产品体系。
声誉风险	随着社会对气候变化、绿色低碳的关注逐渐增加，公司如未满足利益相关方期待，可能会导致公司声誉受到影响，从而影响公司的收益和发展。	短期、中期、长期	营业收入减少、品牌价值降低、投资者信心降低	

环境相关机遇分析				
机遇	具体描述	影响时期	潜在机遇	应对措施
市场机遇	随着国家政策对绿色金融的引导，持续稳步推进绿色金融产品创新，为绿色产业客户提供金融服务，提高竞争力，为公司带来新的发展机遇。	短期、中期、长期	营业收入增加、业务多元化水平提高	积极开发符合 ESG 理念和市场需求的金融产品和服务。
资源效率	在日常运营中使用节能技术、推广无纸化办公，提高视频会议系统覆盖率，提高资源循环利用能力等方式推动节能减排，有利于降低运营成本。	短期、中期、长期	固定资产价值提升、运营成本降低	关注节能减排、回收利用，在建筑物、办公设备和交通运输等方面提高能效，加强员工环保相关培训，贯彻低碳办公理念。

六、经营活动的环境影响

安信基金积极贯彻国家低碳经济政策，坚持可持续发展的公司治理理念，并贯彻于运营管理的各个方面，在日常工作中持续关注节能降排，努力减小运营层面对环境带来的影响。

（一）经营活动产生的直接与间接资源消耗

我司的直接资源消耗均主要来自公车的燃油消耗，间接资源消耗主要来自办公用电、用水及纸张消耗。

安信基金经营活动产生的直接与间接资源消耗		
指标名称	单位	2022 年
直接能源消耗		
机动车燃油消耗	升	4844.35
间接能源消耗		
用电总量	千瓦时	858748.87

人均用电量	千瓦时	3533.95
总耗水量	吨	2495.41
商业用水	吨	2428.62
饮用水	吨	66.79
人均耗水量	吨	10.27
办公室消耗纸张	吨	2.70
人均纸张消耗	吨	0.01

注：用电包括我司南湾机房耗用量；用水因办公营业场所所在的写字楼不以租户单独设置水表，水费已包括在物业费中，故此处商业用水量以大厦租户公摊用水量估计。

（二）经营活动产生的直接与间接温室气体排放

2022年，我司直接温室气体排放（范围一）11.58吨二氧化碳当量，由外购电力引起的间接温室气体排放（范围二）387.46吨二氧化碳当量，由差旅产生的间接温室气体排放（范围三）112.13吨二氧化碳当量。

安信基金经营活动产生的直接与间接温室气体排放		
指标	单位	2022年
直接温室气体排放（范围一）	吨二氧化碳当量	11.58
自有车辆汽油排放		11.58
能源间接温室气体排放总量（范围二）		387.46
外购电力温室气体排放		387.55
其他经营活动间接温室气体排放（范围三）		112.13
差旅产生的间接温室气体排放		76.61
差旅住宿产生的间接温室气体排放		35.52
温室气体排放总量		511.17
人均温室气体排放		2.10

（三）经营活动的废弃物产生及处理情况

公司产生的废弃物主要是废弃纸张、废弃家具、厨余垃圾及其他生活垃圾等一般废弃物及废弃电子产品、废电池，废日光灯管，废墨盒等有害废物。处置废弃物时，公司按照《深圳市生活垃圾分类管理条例》进行分类，可回收物会交由回收站回收，有回收计划的电子产品废弃物会联系原厂商回收，其他废弃物分类后由所在物业单位统一收集后清运处理。

（四）环保措施及环境效益

公司的环保措施涵盖各个方面，包括能源使用、碳排放减少、可持续采购和员工教育等。

在节能减排方面，一是将环保理念融合进投资者教育工作中，取消向基金份额持有人寄送纸质对账单，提供绿色环保的电子对账单定制服务，基金份额持有人可通过多种方式查询或订阅各类业务账单。二是在工作流程方面，最大程度“线上化”减少纸质文件产生，如取消传统的纸质传真接收通道，将直销业务从线下纸质办公形式优化为线上无纸化办理形式；上线场外投资交易系统，减少基金会计纸质单据；上线费用报销系统，实现电子报销等。三是在内部积极推进节能降耗举措，节假日放假前要求员工关闭办公设备电源，平时倡导双面打印及黑白打印等，在一定程度上减少资源滥用。

在可持续采购方面，公司一是在进行办公物品采购时优先选择符合可持续标准和认证的产品，密切关注供应链的环境影响，鼓励供应商提供环保产品和服务。二是在新办公室基建过程中严格执行绿色环保标准，注重采用节水型洁具、高效节能灯具、高性能遮阳帘等以减少资源浪费；选用天然无机、低碳环保材料，建筑废弃物

参与城市再生循环体系以减少环境污染；采用集成预制材料，装配式施工以减少碳足迹碳排放。三是在采购信息资产时，遵循“公平、公正、竞争、效益、效率和诚实信用”的原则，制定供应商评价与退出机制，推动供应商提供持续、稳定、优质的服务，有效控制供应商风险。

在员工教育方面，公司积极开展环境保护的活动，组织员工进行集体植树；鼓励员工办公自带水杯，原则上不对内部人员提供瓶装水或一次性纸杯；倡导员工选择公共交通工具，绿色低碳出行，从力所能及之处出发，身体力行地参与到节约资源保护环境当中。

七、投融资活动的环境影响

（一）整体投融资情况

截至报告期末，公司旗下产品的整体规模为 1,324.50 亿元，股票投资的前三个行业是制造业、采矿业及房地产业，占比分别是 43.81%、13.43%、14.13%，总占比为 67.3，较 2021 年下降约 4.7%。

序号	国民经济行业分类	2022 年规模 (万元)	各行业 占比 (%)	2021 年规模 (万元)	各行业占 比 (%)
1	制造业	1,674,022.37	43.81%	1,212,063.36	42.35%
2	采矿业	513,296.73	13.43%	404,120.41	14.12%
3	房地产业	384,278.98	10.06%	404,311.47	14.13%
4	金融业	297,695.36	7.79%	180,526.43	6.31%
5	恒生综合行业指数-资讯科技业	187,009.42	4.89%	82,419.13	2.88%
6	恒生综合行业指数-地产建筑业	147,823.01	3.87%	106,247.41	3.71%
7	建筑业	112,969.65	2.96%	91,206.03	3.19%
8	批发和零售业	103,163.82	2.70%	56,239.28	1.97%
9	科学研究和技术服务业	93,120.19	2.44%	15,757.64	0.55%

10	恒生综合行业指数-必需性消费	78,748.07	2.06%	63,307.43	2.21%
11	交通运输、仓储和邮政业	47,902.22	1.25%	13,650.54	0.48%
12	信息传输、软件和信息技术服务业	36,322.41	0.95%	119,638.70	4.18%
13	恒生综合行业指数-医疗保健业	32,635.82	0.85%	1,846.97	0.06%
14	电力、热力、燃气及水生产和供应业	29,496.42	0.77%	44,091.67	1.54%
15	租赁和商务服务业	29,102.09	0.76%	8,309.76	0.29%
16	农、林、牧、渔业	22,779.77	0.60%	18,472.50	0.65%
17	恒生综合行业-工业	17,085.05	0.45%	4,543.59	0.16%
18	卫生和社会工作	5,480.69	0.14%	340.16	0.01%
19	水利、环境和公共设施管理业	3,533.72	0.09%	2,069.56	0.07%
20	恒生综合行业指数-非必需性消费	2,680.64	0.07%	27,043.60	0.94%
21	文化、体育和娱乐业	1,885.69	0.05%	2,290.59	0.08%
22	住宿和餐饮业	298.32	0.01%	750.68	0.03%
23	恒生综合行业指数-金融业	64.15	0.00%	0.09	0.00%
24	教育	36.25	0.00%	0.00	0.00%
25	恒生综合行业-能源业	31.56	0.00%	0.00	0.00%
26	其他	13.44	0.00%	659.68	0.02%
27	恒生综合行业-原材料业	0.00	0.00%	1,884.80	0.07%
28	恒生综合行业指数-公用事业	0.00	0.00%	230.16	0.01%
29	恒生综合行业指数-综合企业	0.00	0.00%	6.82	0.00%
	总计	3,821,475.84	100.00%	2,862,028.48	100.00%

注：根据 GB/T4754-2017《国民经济行业分类》进行分类，其中港股没有国民经济行业分类的选取恒生综合行业分类，两种分类都缺失数据的记为“其他”

（二）绿色投融资活动情况

1、绿色资产管理产品

截至 2022 年末，公司共有公募基金 83 只，其中绿色资产管理产品 3 只，规模约达 541,882.41 万元，较上一年增长了 278.30%。

绿色资产管理产品以基金超过 80%以上的净资产主要投资于清洁能源、能效提升、污染防治、医疗卫生、教育服务、健康养老等

行业的统计口径划分，分别是安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信医药健康主题股票型发起式证券投资基金及安信新能源主题股票型发起式证券投资基金。这三只产品均主要投资于绿色行业和对社会有积极影响的行业，投资的标的覆盖清洁能源、智慧能源、垃圾发电、新能源汽车、医疗卫生、医疗服务、养老服务、教育服务、健康食品等领域。

指标	余额/业务规模 (万元)	同比变动 (%)	同类业务 占比 (%)	违约率 (%)
绿色资产管理产品	541882.41	278.30%	4.38%	/

2、自有及管理资产投资于绿色金融工具及绿色项目情况

截止 2022 年末，公司旗下产品投资 ESG 债券金额为 1,316,29.898 万元，较年初增长 141,43.22 万元，占公司整体债券投资比例 0.91%。

序号	ESG 产业	2022 年规模 (万元)	各产业占比 (%)	2021 年规模 (万元)	各产业占比 (%)
1	节能环保	14750.81	11.14%	20001.6	17.02%
2	清洁能源	40546.36	24.54%	13496.29	11.49%
3	绿色交通	15125.89	11.41%	25891.34	22.04%
4	疫情防控	24190.62	18.25%	6926.055	5.90%
5	乡村振兴	4399.34	3.32%	23034.87	19.61%
6	可持续发展	4022.01	3.03%	0	0.00%
7	固危废处理	23090.84	17.42%	14050.925	11.96%
8	绿色建筑	14441.4	10.89%	38.04781	0.03%
9	绿色金融债券	0	0.00%	14047.54	11.96%

（三）绿色投融资活动环境效益

截至报告期末，公司旗下产品投资了 27 只绿色债券，债券金额为 1,316,29.898 万元，占公司整体债券投资比例 0.91%。支持的行业覆盖节能环保、清洁能源、绿色建筑、固危废处理、绿色交通、水资源利用与保护、疫情防控等绿色行业、社会建设行业、以及可持续发展等。

所持 27 只绿色债券中有 4 只已测算并披露了环境效益的情况，其他暂未披露，已披露的项目具体信息如下：

序号	债券简称	支持的项目类型	债券所支持项目的环境效益				
			节约标准煤 (吨/年)	二氧化碳减排量 (吨/年)	二氧化硫减排量 (吨/年)	氮氧化物减排量 (吨/年)	烟尘颗粒物减排量 (吨/年)
1	GC 三峡 02	水电站建设项目	30,361,600.00	58,596,200.00	18,584.62	19,379.69	3,773.55
2	22 山东核电 SCP004(碳中和债)	碳中和绿色项目	5,610,200.00	/	22,944.00	3,293.60	588.80
3	21 山东核电 SCP009(碳中和债)	绿色项目和乡村振兴领域	5,436,400.00	/	22,852.80	3,191.57	570.56
4	21 苏高新 GN001	绿色建筑项目建设运营	237.16	633.22	6.22	5.34	2.59

（四）整体投融资活动碳排放

根据公募基金 Wind ESG 评级 2022 年报期结果，我司 83 只公募基金中有 3 只基金被评为 AAA 级，5 只被评为 AA 级，10 只被评为 A 级，10 只被评为 BBB 级，4 只被评为 BB 级，合计 32 只，其他未有

评级。根据碳排放数据库（Wind GHG emission data）和基金持仓数据，评级产品投资的 A 股、港股上市公司、重要发债主体的碳足迹数据和碳排放总额如下：

指标名称	单位	2022 年
基金碳排放总量	吨二氧化碳当量	3,862,913.83
纳入碳核算的基金规模比例	%	40.93
纳入碳核算的基金规模	百万元	50,609.71
基金碳足迹	吨二氧化碳当量/百万元	6,514.66

八、绿色金融培训及公益活动

（一）绿色金融交流会

为宣导绿色金融与可持续发展理念，我司举办线下交流会，与渠道客户进行深度交流与互动。

2022 年 10 月，由安信基金成长投资部总经理陈鹏，就清洁能源产业发展机遇进行分享与互动交流。现场参会人数约 30 人，以沙龙形式开展，交流充分，互动活跃。

2022 年 11 月，由安信基金从事新能源领域投资研究的基金经理陈思，就清洁能源发展前景与未来投资机会进行分享，现场参会人数约 50 人，分享内容得到了渠道客户的深刻认同与积极反响。

通过线下交流活动，引导公众与一线财富管理工作者关注清洁能源产业与绿色金融意义，鼓励公众借助基金配置支持绿色产业发展，助力经济社会的绿色转型。

（二）助老防骗公益行

我司联合浙江蚂蚁公益基金会于2022年11月25日-12月24日在成都学习强国街区广场开展【2022年度蓝马甲防骗展公益行动】，举办“防上当案例馆”，现场宣传理财防骗技能。



图：2022年度蓝马甲防骗展公益行动

安信基金通过本次“2022年度蓝马甲防骗展公益行动”，更形象、具体地为投资者科普生活场景中容易遇到的投资理财诈骗陷阱，提高了投资者的防范风险意识和技巧，起到了积极的投资者教育作用，并荣获“2022年度蓝马甲防骗展公益合作伙伴”称号。

九、绿色金融创新案例及成果奖项

（一）绿色金融创新实践案例

【案例一】推出新能源主题基金

当前，“碳达峰·碳中和”已成为国家战略，能源安全化、清洁化转型势在必行，发展新能源产业将成为我国“十四五”时期的重要能源战略。公司于2022年7月26日推出新能源主题基金—安信新能源主题股票型发起式证券投资基金，公司运用自有资金认购1000万元，该产品主要投资于新能源主题的上市公司股票，有利于投资者充分享受新能源全产业链高速增长带来的红利，持续为实体经济的发展输入动力。

【案例二】支持联合国可持续发展目标

联合国可持续发展目标共有17个，包括：消除贫困与饥饿、健康福祉、优质教育、清洁能源工业创新等方面，旨在从2015年到2030年间以综合方式彻底解决社会、经济和环境三个维度的发展问题，转向可持续发展道路。我司积极支持联合国可持续发展目标，目前旗下产品在健康与福祉、清洁能源、产业创新等方面均有投资。

可持续发展目标	具体内容	安信基金相关投资项目
良好健康与福祉	确保健康的生活方式，促进各年龄段人群的福祉	<ul style="list-style-type: none"> ● 安信禧悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF） ● 安信医药健康主题股票型发起式证券投资基金
经济适用的清洁能源	确保人人获得负担得起的、可靠和可持续的现代能源	<ul style="list-style-type: none"> ● 安信新能源主题股票型发起式证券投资基金
产业、创新和基础设施	对实现可持续发展至关重要	<ul style="list-style-type: none"> ● 安信中证一带一路主题指数型证券投资基金 ● 安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金（LOF） ● 安信创新先锋混合型发起式证券投资基金 ● 安信数字经济股票型证券投资基金
负责任消费和生产	确保可持续消费和生产模式	<ul style="list-style-type: none"> ● 安信消费医药主题股票型证券投资基金 ● 安信消费升级一年持有期混合型发起式证券投资基金

（二）绿色金融成果奖项

1、安信消费医药主题股票型证券投资基金通过投资于消费与医药行业中的优质上市公司，分享其发展和成长机会，力争获取超越业绩比较基准的中长期收益。该基金于2018年-2020年连续三年获得由上海证券报颁布的“金基金”责任投资（ESG）基金奖。

2、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金在投资决策和流程中充分考虑环境保护、社会责任和公司治理等可持续发展的投资因素，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。该基金于2021年获得由上海证券报颁布的“金基金”责任投资（ESG）基金奖。

以上两只基金取得的奖项，是业界对我司积极践行绿色投资理念的充分肯定。

（三）绿色金融研究

安信基金对标国际 ESG 投资趋势，顺应可持续发展潮流，在产品研发方面进行深入研究，完成《ESG 基金布局可行性报告》、《碳中和主题基金研究》、《新能源相关主题基金研究》等研究报告并进行内部分享培训，积极探讨和推进 ESG 主题公募基金的布局可行性，扎实推进 ESG 投资本土化发展。

十、数据梳理、校验及保护

（一）数据安全

安信基金严格遵守《中华人民共和国网络安全法》、《中华人民共和国数据安全法》、《中华人民共和国个人信息保护法》、《证券基金金融机构信息技术管理办法》、《证券期货业网络和信息安全管理办法》等法律法规的规定，切实履行保障数据安全的主体责任，全力为客户隐私安全和信息安全保驾护航。

1、完善组织架构

信息技术治理委员会是安信基金数据安全管理的最高决策机构，委员会主任由公司总经理担任，委员包括首席信息官、督察长及各业务条线分管领导。信息技术治理委员会负责审议数据安全相关制度和流程，决策公司数据安全相关的重大事项，听取公司数据安全治理重要汇报。

数据治理工作小组是安信基金数据安全工作的管理、协调及具

体实施机构，由信息技术部及公司各部门数据治理专员组成。其中，信息技术部，是公司数据安全管理部门，负责统筹公司数据安全管理工作，制定相关技术方案，执行数据安全管理工作；各部门及子公司，是数据安全工作的执行组织，负责具体落实和执行数据安全决策。

2、健全管理制度

安信基金不断建立健全公司数据安全治理体系，加强数据安全风险防范。现已制定《安信基金数据安全管理办法》，规定了数据全生命周期的安全管理要求；制定《安信基金数据分类分级管理细则》，根据数据资产的重要性、敏感性以及损害影响程度，将公司数据资产从高到低将数据划分为4个安全等级；制定《安信基金客户个人信息管理办法》，进一步细化客户个人信息的收集、查询、存储、保存、更新、使用等相关规定。

3、提升安全意识

安信基金定期进行全员信息安全意识培训，内容涵盖对国家或行业数据安全法律法规的解读宣贯、常见场景的安全风险汇编，并多次开展安全攻防演练培训等活动。

4、保护敏感数据

安信基金遵循数据分级管理，采取数据加密和脱敏等保护措施，完善网络隔离、严格控制数据权限，加强数据操作行为监测与审计，规范数据应用，依法执行数据备份，严格落实数据销毁流程；持续强化对公司门户网站及网上交易系统的漏洞检测及修复、APP个人

信息合规评估与整改、仿冒网站 APP 及社交媒体账号的监控与下架，保护个人财产安全。

（二）数据管理

安信基金以监管报送为切入点完善数据标准，明确数据稽核规则，提高数据质量，紧抓监管要求，保障数据的及时性、准确性与安全性。公司初步建立了数据治理制度及组织架构，计划配套建设以大数据为底座的统一数据管理平台，加强数据管理的信息化建设。

（三）数据安全应急预案

安信基金参照《证券投资基金经营机构信息技术管理办法》、《证券期货业网络和信息安全管理办法》《证券期货业网络安全事件报告与调查处理办法》，制定了《安信基金信息系统应急管理办法》《安信基金网络与信息安全事故应急预案》，建立健全了公司各部门的应急协调处理机制，提高了信息系统突发事件应急处理能力。同时，公司针对数据安全事件制定了专门的应急预案，明确了应急流程和上报机制，进一步提高了数据安全事件的应急处理能力。

附录一：经营活动的环境影响计算方法

此次环境数据披露的主体包括公司总部及分公司，报告期为2022年1月1日至2022年12月31日。

根据《深圳市金融机构环境信息披露模板及指标说明》，结合我司的实际情况，范围一直接排放主要来源为自有车辆汽油消耗；范围二间接排放主要包括办公区各类用电设备的电力消耗；范围三其他排放主要为因员工差旅出行及差旅住宿所产生的能源消耗。

计算方法采用《广东省企业(单位)二氧化碳排放信息报告指南(2022年修订)》中的排放因子法。基础公式如下：

$$AE = AD \times EF$$

式中：

AE ——企业二氧化碳排放量，单位为吨二氧化碳；

AD ——二氧化碳排放活动数据，单位为吨或万立方米；

EF ——排放因子，单位为吨二氧化碳/吨或吨二氧化碳/万立方米。

范围一温室气体排放计算过程

- 1、数据来源渠道：根据自有车辆的汽油采购记录确定。
- 2、确定排放因子：采用《广东省企业(单位)二氧化碳排放信息报告指南(2022年修订)》中“汽油”的碳排放因子。
- 3、计算碳排放量：将自有车辆汽油消耗总量乘以二氧化碳排放

因子，得出自有车辆的二氧化碳排放量。

范围二温室气体排放计算过程

1、数据来源渠道：根据电表记录确定。

2、确定排放因子：深圳总部采用《广东省市县（区）级温室气体清单编制指南》中 2018 年广东省电网的平均排放因子，分公司采用《企业温室气体排放核算方法与报告指南》中的电力排放因子。

3、计算碳排放量：将外购电力消耗总量乘以二氧化碳排放因子，得出外购电力产生的二氧化碳排放量。

范围三温室气体排放计算过程

1、数据来源渠道：根据财务报销流程，提取全公司员工出差所乘坐的交通工具类型及产生的费用，住宿报销的总金额及住宿天数。

2、确定排放因子：采用“中国产品全生命周期温室气体排放系数库”中“国内航空客运（中型飞机）”、“中国高铁”、“客运铁路”、“汽油客车平均”、“酒店住宿平均”的碳排放因子。

3、计算碳排放量：1) 根据每类交通工具报销的总金额及民航、铁路、客运等规定的票价基准价，分别估算员工通过该类交通工具出行的总里程数。2) 将每类交通工具出行的总里程数分别乘以对应的碳排放因子，再将数据加总，得出员工因差旅产生的二氧化碳排放量；3) 将员工差旅住宿天数乘以酒店住宿因子，得出员工因差旅住宿产生的二氧化碳排放量。

附录二：基金投融资活动的碳足迹碳排放计算方法

单只基金碳足迹= $(\sum \text{投资标的规模} / \text{投资标的总市值} \times \text{投资标的温室气体排放总量 (范围一和范围二)}) / \text{该基金市值 (去除 Wind ESG 评级不覆盖的标的市值)}$ 。

单只基金碳排放总额= $\sum \text{投资标的规模} / \text{投资标的总市值} \times \text{投资标的温室气体排放总量 (范围一和范围二)}$ 。

免责声明

1、本文内容的部分信息来源于公开资料，本公司对该等信息的准确性、完整性或可靠性不作任何保证。本文所载的数据、资料及观点仅反映报告周期内信息，本公司有权在不发出通知的情形下对其进行调整。

2、本文内容所涉及的观点或信息仅供参考，不应作为投资者投资决策与基金交易的依据，相关观点在任何时候均不构成对投资者的投资建议或承诺。投资者在做出投资决策前应仔细阅读基金合同、招募说明书等法律文件，了解基金的风险收益特征，根据自身风险承受能力购买基金，并独立承担投资风险。

3、本文的版权为本公司所有。未经书面许可，任何机构和个人不得将此文或其任何部分以任何形式进行发表、署名、修改、复制、转载或传播。