



2022 年度 融通基金管理有限公司 环境信息披露报告

融通基金管理有限公司

2023 年 6 月

关于本报告

报告期间：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

报告周期：年度报告

报告范围：本报告的披露范围为融通基金管理有限公司总部及分支机构环境信息相关数据。

编制依据：本报告根据中华人民共和国金融行业标准《金融机构环境信息披露指南》（JR/T 0227-2021）、《深圳市金融机构环境信息披露指引》的披露要求进行编制，并参考《气候相关财务信息披露工作组（TCFD）建议报告》、《金融机构碳核算技术指南（试行）》相关披露要求及建议进行披露。

数据说明：本报告中的数据为 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日期间内的数据，数据主要来源于公司内部文件和相关统计资料。所涉及货币金额均以人民币计量。

指代说明：为便于阅读，本报告“融通基金管理有限公司”简称“融通基金”、“公司”、“本公司”。

目录 CONTENTS

第一部分 基本信息.....	1
1.1 公司基本信息.....	2
1.2 公司发展历程.....	3
1.3 公司业务资格.....	3
1.4 公司资产管理规模.....	4
第二部分 战略目标.....	5
2.1 环境、绿色金融相关目标.....	5
2.2 环境、绿色金融相关发展战略.....	6
第三部分.....	7
环境及绿色金融相关治理结构.....	7
3.1 董事会层面.....	7
3.2 高级管理层层面.....	7
3.3 专业部门层面.....	7
第四部分.....	9
环境及绿色金融相关政策制度.....	9
4.1 逐步建立健全内部政策.....	9
4.2 认真落实外部政策.....	10
第五部分.....	11
环境风险管理.....	11
5.1 环境风险识别、评估和应对的全流程管理.....	11
5.2 识别的环境风险和机遇.....	11
第六部分.....	13
经营活动的环境影响.....	13
6.1 经营活动的环境影响.....	13
6.2 环保措施及环境效益.....	15
第七部分.....	16
投融资活动的环境影响.....	16
7.1 整体投融资情况.....	17
7.2 绿色投融资活动情况.....	18

7.3 绿色投融资活动环境效益	19
7.4 整体投融资活动碳排放	19
第八部分	21
绿色金融培训、公益活动及奖项	21
第九部分	22
数据梳理、校验及保护	22
第十部分	24
未来展望	24
附录 1:《深圳市金融机构环境信息披露指引》索引目录	25
附录 2: 金融机构环境信息披露指南内容索引	27
附录 3: TCFD 指标索引	29
附录 4: 经营活动的环境影响计算方法	30
附录 5: 投融资活动环境影响的量化测算	32

第一部分 基本信息

融通基金管理有限公司，2001 年 5 月 22 日成立于深圳，注册资本 1.25 亿元人民币。融通基金是国内第二批、全国第十三家成立的基金公司。

作为大中型合资基金公司，融通基金股东分别为诚通证券股份有限公司（持股 60%）和日兴资产管理有限公司（持股 40%）。公司的实际控制人中国诚通控股集团有限公司（持有诚通证券 98.24% 股份）是国务院国资委监管的中央企业，是国资委首批建设规范董事会试点企业、首家国有资产经营公司试点企业和中央企业国有资本运营公司试点单位，实力雄厚。

公司业务覆盖全国，在北京、上海、成都设有分支机构，并控股融通国际资产管理有限公司。



公司坚持以持有人利益为中心、以人才为本源、以投资业绩为基础、以高效执行为方略，形成公司的核心竞争力，公司致力于为投资者提供专业、稳健的多资产管理服务，建设成为具有国有资本运营特色的一流资产管理公司。

1.1 公司基本信息

公司中文名称：融通基金管理有限公司

公司英文名称：RONGTONG FUND MANAGEMENT CO., LTD.

公司法定代表人：张威

公司总经理：张帆

公司经营范围：公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理及中国证监会许可的其他业务。

公司性质：国有控股企业

公司所处行业：金融业

公司统一社会信用代码：9144030072857172XH

公司注册资本：人民币 12500 万元

公司注册地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层

公司办公地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14、15 层

公司办公地址邮政编码：518053

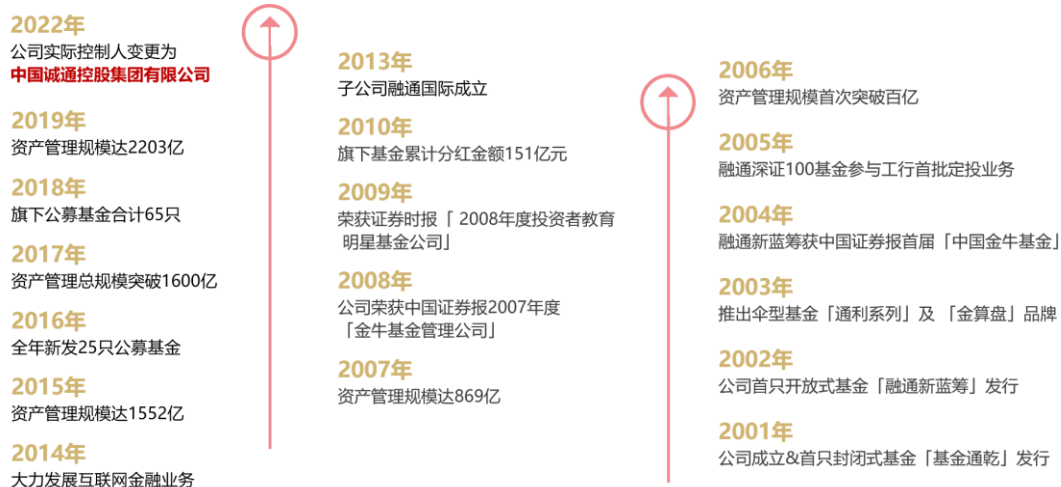
公司网站：www.rtfund.com

电话：0755—26948666

传真：0755—26935005

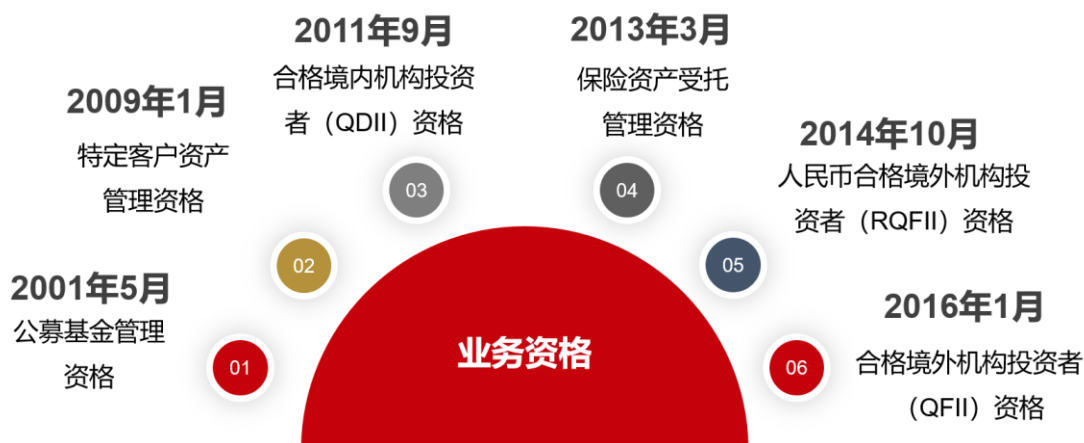
电子信箱：file @rtfund.com

1.2 公司发展历程



1.3 公司业务资格

公司拥有公募基金管理资格、特定客户（专户）资产管理资格、境内合格机构管理人资格（QDII）、保险资产受托管理资格、人民币合格境外机构投资者（RQFII）资格、合格境外机构投资者（QFII）资格。



1.4 公司资产管理规模

公司产品线完备，涵盖主动权益类基金、被动投资类基金、债券基金、货币基金、混合基金、QDII 基金等。截至 2022 年 12 月 31 日，资产管理规模达 2325 亿元，其中，公募基金管理资产规模 1222 亿元。

第二部分

战略目标

2.1 环境、绿色金融相关目标

2.1.1 目标设置情况

贯彻落实绿色金融发展要求，不断提高投资管理专业能力，开发聚焦于战略性新兴产业和绿色行业的基金产品，降低投资组合碳排放强度，不断推进绿色低碳运营建设，积极履行社会责任，为社会的可持续发展助力。

2.1.2 目标完成情况

依据《证券投资基金法》、《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》等相关法律法规和行业自律规则，公司不断推进绿色金融建设工作。2022 年，中国证监会依法结束对公司控股股东新时代证券的接管，公司实际控制人变更为中国诚通控股集团有限公司，下一步，公司将结合国资央企的监管要求，持续推进绿色金融建设工作进度。

2.1.3 下一年度目标

研究制定公司绿色金融制度，完善公司绿色金融工作机制建设，深化对战略新兴产业和绿色行业的投资研究，积极践行节能减排的倡导义务，宣贯环保理念，日常办公运营中，大力推行节能、节水、绿色出行、减少纸张及塑料制品的使用等做法，提升绿色运营水平，积极组织参与或发起组织绿色发展等相关公益活动，加强与各组织间绿色金融相关的沟通交流，不断强化绿色金融建设能力，助力经济绿色可持续发展。

2.2 环境、绿色金融相关发展战略

融通基金积极践行服务实体经济、服务国资央企高质量发展、服务国有资本运营战略的使命，致力于为投资者提供专业、稳健的多资产管理服务，努力建设成为具有国有资本运营特色的一流资产管理公司，打造服务国有资本运营战略和居民财富管理“双轮驱动”的发展模式。

公司坚持长期导向、合规经营、守正创新的经营理念，将可持续发展作为公司的长期目标，在公司的发展过程中积极履行企业的 ESG 责任，不断提升 ESG 投资能力，不断推进绿色办公、绿色运营的低碳发展，为社会承担更全面的企业公民责任。

第三部分

环境及绿色金融相关治理结构

3.1 董事会层面

公司持续完善绿色金融治理架构，在董事会、公司经营层和日常工作推进机制中融入绿色金融战略。公司董事会由 9 名董事组成，下设三个专门委员会：风险控制与审计委员会、提名与资格审查委员会、薪酬与考核委员会，董事会通过听取管理层的工作报告，持续推进和督促绿色金融工作规划的落地。

3.2 高级管理层层面

公司重视环境、绿色金融工作，由公司总经理负责环境、绿色金融工作的决策。公司层面，成立了业务协同发展委员会，协调投资研究部门、信息技术部门、行政人力部门、财务管理部门等部门，落实董事会和总经理关于公司环境、绿色金融的工作要求。公司高级管理人员定期召开会议，研究讨论公司环境、绿色金融工作的开展情况。

3.3 专业部门层面

公司积极响应绿色发展理念，战略发展部作为公司绿色金融工作的牵头工作部门，设有 1 名绿色金融专职员工。战略发展部根据相关规定和公司经营层的工作要求，开展绿色金融相关工作，组织绿色金融业务和制度的培训学习，研究绿色金融业务的发展和创新。

公司通过完善人员职能分工和业务创新，促进绿色金融理念的落地，不断推进相关制度的建设工作。

权益投资部、固定收益部：负责规划 ESG 基金的投资组合策略和实施方案，并负责日常投资管理工作。

研究部：负责调动内外部研究资源，组织对 ESG 政策、市场动态进行分析研究，为各投资组合提供投资决策依据。

法律合规部、稽核审计部：负责检查公司内控制度的执行情况，促使其有效执行；审查公司、基金和其他受托资产的信息披露文件，确保其合规性；负责公司法律事务、合规管理、内部稽核工作。

风险管理部：根据公司风险管理策略、风险偏好，实施风险预警及限额指标的拟定，开展风险识别、风险评估及压力测试工作。

市场拓展部：负责绿色金融产品的营销策划推广及开展各类环保宣传活动。

产品开发部：负责在产品开发方面落实公司 ESG 管理要求，聚焦于战略性新兴产业和绿色产业投资机会的基金产品

登记清算部：负责公司所管理的绿色主题基金的注册登记、资产估值、交易清算和会计核算及披露工作。

信息技术部：负责公司相关统计数据收集、校验，确保相关基础数据的及时性与准确性；加强环境数据管理的信息化建设，采用技术手段保证数据安全性和数据主体权益。

人力资源部：负责在人力资源管理方面落实 ESG 管理要求，将 ESG 的理念落实到人才招聘、选拔、培训发展的具体工作过程中。

办公室：负责制定和落实公司低碳绿色运营措施。

财务管理部：负责公司自有资产投资于绿色金融产品的资产情况及变动情况。

第四部分

环境及绿色金融相关政策制度

4.1 逐步建立健全内部政策

2022 年，公司实际控制人变更为中国诚通控股集团有限公司，公司认真落实中国诚通集团对公司提出的关于国资管理的要求，对公司的制度进行修改完善，逐步建立健全各项内部政策。

公司制定了《融通基金管理有限公司办公管理办法》，提出“公司严格贯彻落实《深圳经济特区绿色金融条例》，统筹推进公司的节能降耗管理工作。”从办公场所管理、办公安全管理、节能降耗管理等方面加强公司办公环境的管理。其中，在“节能降耗管理”的章节，公司明确提出了节能降耗的目标，在内部逐步推进无纸化办公，倡导员工树立节能环保意识，制定了节水、节电、无纸化办公的具体措施。

同时，公司通过修订完善《融通基金管理有限公司物资采购管理办法》、《融通基金管理有限公司财务费用管理办法》、《融通基金管理有限公司考勤管理办法》、《融通基金管理有限公司公务用车暂行管理办法》等制度，加强用车管理、降低非必要差旅行为、加大绿色供应商的采购倾斜等工作。

公司立足于资产管理行业的业务模式和实际情况，在投资交易、基金运营、市场营销等业务领域，逐步贯彻落实绿色金融理念，制定和完善了《融通基金管理有限公司投资管理制度》、《融通基金管理有限公司公平交易制度》、《融通基金管理有限公司投资者适当性管理制度》，尊重和保护基金持有人的合法权益，推动基金产品的创新。

公司目前正在研究制定《融通基金管理有限公司绿色金融制度》，进一步加强绿色金融发展工作，完善工作的实施、考核、评价等环节。

4.2 认真落实外部政策

公司认真贯彻党的二十大精神，领悟习近平总书记关于金融工作的重要论述，落实党中央、国务院关于金融工作的重大部署，学习党的二十大提出的“贯彻新发展理念，构建新发展格局”工作部署，及时了解国家关于绿色金融发展的最新政策和工作要求。

2021 年深圳正式实施《深圳经济特区绿色金融条例》，印发出台《深圳市金融机构环境信息披露指引》，明确发展绿色金融，支持绿色、低碳、循环经济发展，规范深圳市金融机构环境信息披露工作，提高环境信息披露质量。公司落实深圳市绿色金融法律法规明确的有关工作任务，开展绿色投资、价值投资和长期投资，推动绿色投资产品创新、开展环境信息披露等相关工作。公司将不断加强对绿色金融发展理念、政策、规定的学习，持续提升绿色金融工作开展的质量。

公司作为深圳市绿色金融协会的成员单位，积极参加深圳市绿色金融协会组织的会议，支持深圳市绿色金融协会的工作，参与相关数据统计工作。

报告期内公司不存在因生态环境、绿色金融相关的违法违规行为而受到行政处罚、司法判决等情况。

第五部分

环境风险管理

5.1 环境风险识别、评估和应对的全流程管理

公司关注环境、绿色金融的风险和机遇，制定了环境风险识别、评估和应对的全流程管理，持续加强对绿色金融领域的研究和跟踪分析。结合公司投资管理的实际，更加关注对高耗能行业、资源密集型行业的关注，将 ESG 责任投资理念运用到公募基金的投资管理当中，将上市公司履行 ESG 责任的情况作为投资管理的参考指标之一。公司注意到“双碳”战略对公司运营成本的潜在影响，努力提质增效，运用信息技术提升公司运营效率，降低能耗。

环境风险识别：参考 TCFD 框架，公司系统的分析面临的环境风险和机遇，结合公司资产管理行业业务模式和实际情况，定义和描述环境风险和机遇。

环境风险评估：针对识别的风险和机遇，分析评估对公司资产管理业务、运营成本、风险控制产生的实际和潜在影响。

环境风险应对：公司通过健全内部政策体系，完善应对预案和应对机制，保障公司妥善应对和管理环境风险及机遇，维持基金运营业务稳定，保护基金份额持有人合法权益。

5.2 识别的环境风险和机遇

1. 公司转型发展的风险

风险描述：国家提出并推进实施“双碳”战略，更加注重低碳绿色发展模式，“双碳”政策体系和绿色金融相关规定不断完善，公司作为金融机构，接

受绿色金融法规的监管和约束。

风险影响：公司可能面临运营成本上升的风险。

应对措施：严格贯彻落实国家“双碳”战略和监管要求，通过提质增效和数字化运营实现低碳绿色运营。

2. 气候变化的风险

风险描述：随着全球气候变暖、海平面上升、极端气候多发等气候风险增多，可能会造成与公司相关的经济损失和人员伤亡。

风险影响：对公司基金运营业务的稳定运行和员工通勤造成潜在风险。

应对措施：制定应急管理预案，加强对天气的关注，增强气候变化物理风险的应对能力，在业务开展和日常公司管理过程中，纳入气候变化影响因素。

3. 投资管理的风险

风险描述：“双碳”战略的实施可能会对上市公司的运营成本、行业格局造成深远影响，对交通运输、汽车消费、光伏风电等行业产生更显著的作用，传统行业、高耗能行业、资源密集型行业的上市公司受环保政策、“双碳”政策的影响，导致运营成本和管理成本的提高，经营业绩波动可能加大。

风险影响：上市公司投资标的盈利水平波动性增大，上市公司的环保风险增多，提高了基金的投资管理风险。

应对措施：深入研究经济发展趋势和产业结构升级，加大对战略性新兴产业和绿色行业的关注和投资，全面落实 ESG 责任投资理念，关注上市公司 ESG 实践情况。

第六部分

经营活动的环境影响

6.1 经营活动的环境影响

融通基金根据中国人民银行发布的《金融机构环境信息披露指南》，以及深圳市《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》等相关规定要求，统计公司运营层面的碳排放情况，测算经营活动的直接和间接温室气体排放和资源消耗情况。公司积极落实绿色运营理念，逐步建立健全对能源消耗等情况的统计工作机制。

1. 能源消耗情况

报告期内，公司自有交通运输工具消耗汽油 6777 升，人均汽油消耗量 27.11 升/人。

公司营业办公消耗电力 826367.18 千瓦，人均消耗电力总量 3305.47 千瓦时/人。公司耗电量较大的原因主要是公司资产管理业务高度系统化，公司数据中心消耗电力较多。

公司办公差旅碳排放（范围 3）为 258.03 吨二氧化碳当量。其中，雇员因差旅出行乘坐的交通工具消耗的能源，折合消耗标准煤 32.39 吨，人均折合消耗标准煤 0.13 吨/人。雇员因差旅出行乘坐的交通工具消耗的能源主要统计雇员差旅乘飞机出行与雇员差旅乘高铁出行两种主要情形。

2. 资源消耗情况

报告期内，办公用水消耗量 1560 吨，人均用水消耗量 6.24 吨/人；办公用纸消耗量 16.06 吨，人均 0.064 吨，公司暂未统计回收用纸情况；营业办公场所的一般废弃物排放为 19.58 吨，人均 0.078 吨/人，电子废弃物排放量为 1.2 吨，人均 0.005 吨/人。

3. 温室气体排放

2022 年，公司直接温室气体（范围 1）为 14.37 吨二氧化碳当量，人均

0.057 吨二氧化碳当量/人；间接温室气体（范围 2）排放量为 1015.2 吨二氧化碳当量，人均 4.06 吨二氧化碳当量/人；温室气体排放总量（范围 1 和范围 2）为 1029.57 吨二氧化碳当量，人均 4.118 吨二氧化碳当量/人。

表 1：经营活动环境影响定量指标情况

指标名称	披露细项		单位	总量	人均
能源消耗	营业办公所消耗的化石能源	煤炭	吨	/	/
		柴油	升	/	/
		汽油	升	/	/
		天然气	立方米	/	/
	自有交通工具所消耗的燃油	柴油	升	/	/
		汽油	升	6777	27.108
	自有采暖（制冷）设备所消耗的燃料（如有）	煤炭	吨	/	/
		柴油	升	/	/
		汽油	升	/	/
		天然气	立方米	/	/
	营业办公所消耗的电力	—	千瓦时	826367.18	3305.468
	购买的采暖（制冷）服务所消耗的燃料（如有） ¹	—	吨标煤	316.42	1.266
	雇员因工作需要出差所乘坐的交通工具所消耗的能源	—	吨标煤	32.39	0.130
水消耗	营业办公所消耗的水	总量	吨	1560	6.240
纸张消耗	营业办公所消耗的纸张	—	吨	16.06	0.064
	营业办公消耗的回收纸用量及比例（可选项）	总量	吨	/	/
		比例	%	/	/
废弃物	一般废弃物（可选项）	—	吨	19.58	0.078
	电子废弃物（可选项）	—	吨	1.20	0.005
温室气体排放	范围一（仅包含 CO ₂ ）	营业办公所消耗的化石能源产生的碳排放	—	吨	/
		自有交通工具燃油消耗产生的碳排放	—	吨	14.37
		自有采暖（制冷）设备燃料消耗产生的碳排放（如有）	—	吨	/
	范围二	营业办公所消耗的电力产	—	吨	372.86
					1.491

¹ 购买的采暖（制冷）服务所消耗的燃料消耗量由购买的采暖（制冷）服务所消耗的电力消耗量进行折算。

	(仅包含 CO ₂)	生的碳排放				
		购买的采暖（制冷）服务燃料消耗产生的碳排放（如有）	-	吨	642.34	2.569
	范围三 (仅包含 CO ₂)	雇员差旅乘坐交通工具产生的碳排放	-	吨	92.04	0.368
		雇员差旅住宿产生的碳排放	-	吨	165.99	0.664
		营业办公水消耗产生的碳排放（可选项）	-	吨	3.373	0.013
		营业办公纸张消耗产生的碳排放（可选项）	-	吨	56.21	0.225
		废弃物（废水）处置产生的碳排放（可选项）	-	吨	0.51	0.002
	温室气体排放总量	二氧化碳排放总量及强度	-	吨	1347.69	5.389
		除二氧化碳外的其他温室气体排放总量及强度（可选项）	注明温室气体类别	吨 CO ₂ e	/	/
碳排放抵消	购买或投资开发的在披露责任主体核算边界以外的碳抵消项目	项目信息		项目名称及类别		
		减排量		吨 CO ₂ e	/	/

注：1. 报告期，各类能源消耗等统计范围包括公司总部及分支机构。

2. 报告期末，公司员工人数为 250 人。

6.2 环保措施及环境效益

公司大力推进数字化转型，提升基金管理业务的数字化、系统化、自动化水平，通过加大信息系统建设投入，促进无纸化办公，优化和改进官网、官微、自有 APP 的功能，提升投资者用户体验。公司在日常内部管理中，以实际行动落实节能降耗、垃圾分类、绿色出行、资源回收、循环利用等环保措施，促进员工环保意识提升，实现公司的绿色运营。

第七部分

投融资活动的环境影响

公司坚持价值投资、长期投资和社会责任投资的理念，努力构建专业化、团队化、平台化、一体化的大投研体系，建立宏观、中观、微观多层次的研究方法，增强权益投研板块、基金投研板块、固定收益投研板块、境外投研板块、另类投研板块的专业能力。加大新能源、新材料、医疗、互联网、半导体、高端制造等战略新兴产业的研究力度，动态优化金融资源配置，支持创新企业融资，让持有人分享上市公司成长红利，通过资本市场配置功能更好的服务实体经济。此外，公司积极参与创新企业的 IPO 网下申购、定向增发等融资项目。公司旗下融通产业趋势臻选股票基金、融通新能源灵活配置混合基金、融通新能源汽车主题精选基金、融通人工智能指数基金、融通中证云计算与大数据主题指数基金等一系列基金聚焦于创新企业和战略性新兴产业的投资。

融通基金充分运营自身专业的投资研究能力，践行服务国资央企改革和国有资本运营战略的使命，支持中国诚通与中证指数公司联合开发了诚通央企 ESG 指数。诚通央企 ESG 指数是市场上首只将“央企”和“ESG”两大主题结合的指数。“ESG”投资理念与“三新一高”发展要求和 ESG（环境、社会和治理）的本质内涵高度契合，在政策与市场环境不断完善的推动下，国内 ESG 投资具有广阔的发展前景。作为市场 ESG 理念践行的示范者，央企在 ESG 实践中始终走在最前列。诚通央企 ESG 指数从国务院国资委下属央企上市公司中选取中证 ESG 评价最高的 50 只上市公司证券作为指数样本，以反映注重环境保护、积极回馈社会、公司治理优良、践行高质量发展理念的央企上市公司证券整体表现。样本股中既包含了具有创新成长潜力的小市值公司，也囊括了举足轻重的行业龙头企业，同时作为锚定上市央企的指数，指数在行业配置广泛的基础上，适当超配国家大力推进发展的关键行业（电力设备及新能源、电子、通信等行业）。

7.1 整体投融资情况

投融资总量方面，截至报告期末，本公司各项投融资总额²21,950,525.33 万元。

整体投融资情况方面，按照国民经济行业分类中一级行业统计。截至报告期末，本公司投融资规模占比前十大行业分别为金融业、建筑业、制造业、租赁和商务服务业、交通运输、仓储和邮政业、批发和零售业、房地产业、电力、热力、燃气及水生产和供应业、采矿业和科学研究和技术服务业，占比分别为 45.71%、17.78%、10.79%、4.74%、3.50%、3.20%、2.72%、2.53%、0.97%、0.95%，前十大行业累计占比 92.90%。

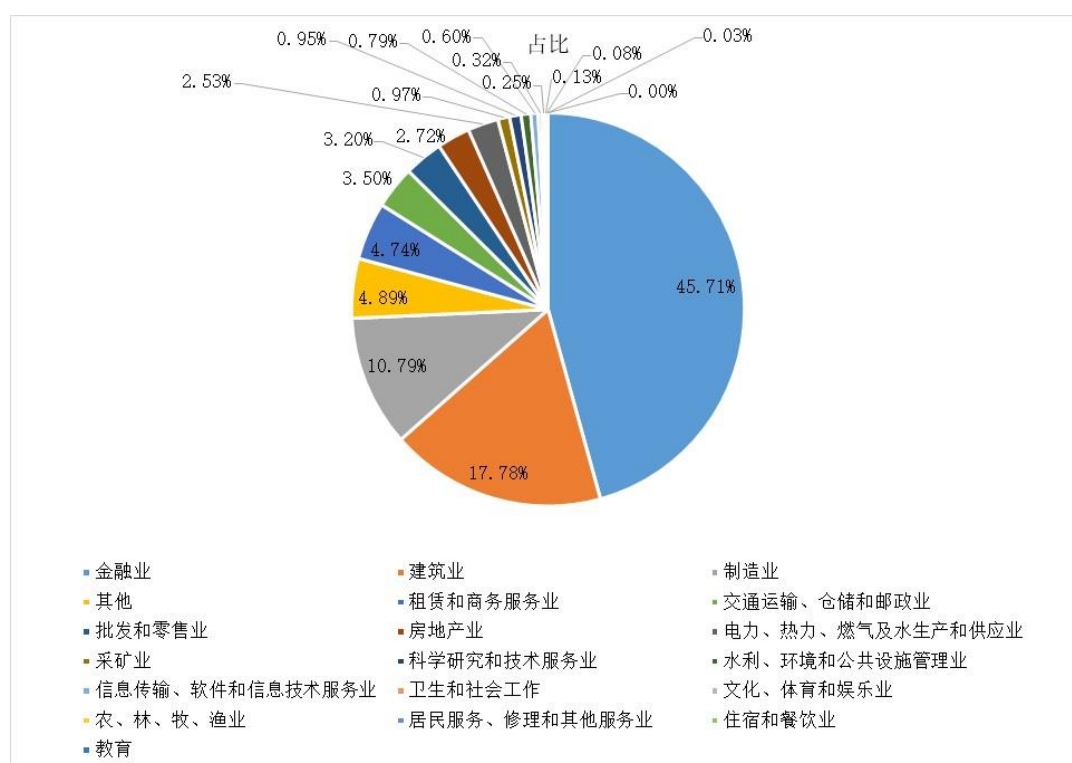


图 1：投融资规模行业占比（截至 2022 年末）

² 统计口径为公司资管产品投资于股票、债券、存款等投资标的的规模，不含投资于基金、期货、远期、逆回购等投资标的的规模。

7.2 绿色投融资活动情况

7.2.1 绿色资产管理产品情况

表 2：绿色资产管理产品情况

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	141,366.93	-51.89	2.49	0

绿色资产管理产品，是指根据《绿色产业指导目录（2019 年版）》对投资产业的分类，投资标的所处行业主要包括节能环保产业、清洁生产产业、清洁能源产业、生态环境产业、基础设施绿色升级产业、绿色服务产业，且投资上述产业相关证券的规模占基金非现金资产规模不低于 50%的产品。注：本公司旗下符合该定义的基金产品为“融通新能源灵活配置混合型证券投资基金”、“融通新能源汽车主题精选灵活配置混合型证券投资基金”。

7.2.2 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

截至报告期末，本公司自有及管理资产投资于绿色企业（股权及证券）、绿色债券、绿色资产证券化、绿色产业基金等绿色资产共计 405,072.11 万元，占有投融资活动对应资产 1.85%。

其中，本公司投资于绿色企业（股权及证券）资产市值规模共计 190,272.98 万元，占有绿色投资 46.97%。

表 3：绿色投资统计

指标	单位	2022 年	同类业务占比 (%)	违约率 (%)
绿色企业（股权及证券）	万元	190,272.98	46.97	0
绿色债券	万元	214,799.13	53.03	0

绿色资产证券化	万元	0	0	0
绿色产业基金	万元	0	0	0
其他绿色资产	万元	0	0	0
小计	万元	405,072.11	100.00	0

绿色企业主体认定，基于 WIND ESG 评分体系，定义绿色企业主体需满足的条件为：Wind ESG 评级中环境维度得分 ≥ 8 分。

7.3 绿色投融资活动环境效益

本公司投资资产中，基于资产管理产品直接投资项目企业依据《企业环境信息依法披露管理办法》及《金融机构环境信息披露指南》等文件，按国家及相关部门要求，及时披露环境信息。

7.4 整体投融资活动碳排放

公司通过公开渠道查询被投上市公司彭博预测碳排放量数据，从而计算公司投资组合整体碳排放量。

具体的：假设上市公司彭博预测碳排放量（口径 1）为 M 吨；公司截止该年度底持有该上市公司股票市值为 E 万元；截止该年度底该上市公司股票总市值为 H 万元；则该笔投资所产生碳排放量 $W=M*E/H$ ；所有投资碳排放总量=每笔投资碳排放量之和。

7.4.1 投融资活动碳排放量

公司披露报告期末投融资活动碳排放量为 285,076.23 吨二氧化碳当量，对应投资金额为 3,202,412.14 万元，纳入碳核算投融资业务按金额比例计算为 14.59%，投融资活动碳排放强度为 8.90 吨二氧化碳当量/百万元。

表 4：投融资碳排放总量及强度

指标名称	单位	2022 年
投融资活动碳排放量	吨二氧化碳当量	285,076.23
纳入碳核算的投融资业务比例	%	14.59
纳入碳核算的投融资金额	百万元	32,024.12
投融资活动碳排放强度	吨二氧化碳当量/百万元	8.90

7.4.2 投融资活动碳排放强度

截至报告期末，公司投融资活动碳排放强度（碳足迹）为 8.90 吨二氧化碳当量/百万。

7.4.3 投融资活动碳核算计划

公司将研究制定投融资业务碳排放量控制计划。

第八部分

绿色金融培训、公益活动及奖项

公司暂无绿色金融培训、公益活动及奖项可披露的情况，公司后续将进一步做好相关工作。

第九部分

数据梳理、校验及保护

融通基金在投资者个人信息数据收集方面，严格按照《中华人民共和国个人信息保护法》、《证券期货业网络和信息安全管理暂行办法》等法律法规的要求，仅收集与业务相关的个人信息数据，不超范围收集和使用个人信息。在公司业务经营数据方面，通过合法合规方式，采购、收集相关咨询数据及业务数据，保障数据的真实有效和完整；在数据的收集、存储、使用、加工、传输、提供、删除等过程中，合规安全执行，防止个人信息及业务数据的丢失。

在信息发布方面，公司建立信息发布审核流程和专门的信息发布管理平台，确保数据、信息真实可信、完整准确、客观有效。公司建立标准的信息发布审核流程，为确保数据发布的质量，公司所有对外发布的业务数据，都将经过内部双重复核、多系统复核后才进行数据的提交，所有对外公开发布的信息，包括定期报告、信息披露、投资观点等，都将经过公司合规部门审核通过后，方可在信息发布管理平台进行发布和管理。

在数据质量方面，公司建立不同类型的数据中心，每日定时对数据进行抽取和清洗，对关键数据建立实时异常监控机制，同时针对重要业务数据，在对外发送前进行勾稽关系校验和人工审核，确保数据的准确性和完整性。对于反洗钱相关数据，建立定期的数据分析和数据完整性检查机制，通过数据梳理发现问题，及时提醒相关部门进行数据的补充完善，以提高数据的质量。

在数据安全方面，公司按照公司《信息技术部数据管理办法》将数据分成5级，在数据备份端简化成2级备份；在数据备份、介质管理、数据还原、数据清理等方面，均严格按照数据提取需求流程进行申请、审批。数据备份方面，公司制定严谨的备份计划，对不同级别的数据保护设置不同的备份方式，包括离线备份和在线备份等；对备份的数据，定期进行数据备份策略检查和数据还原验证，确保备份的数据完整、有效；数据存储方面，公司选定不同的数据介质进行数据备份，同时针对相同介质会选择双份备份策略，以确保数据的

安全性。经检查，数据管理相关部门职责、制度规范、数据全生命周期管理、个人数据与重要数据保护等情况均符合相关要求。

在应急管理方面，公司为建立健全安全事件应急工作机制，规范应急管理工作流程，提高公司应急处置能力，预防和减少安全事件造成的损失和危害，公司制定了《信息技术应急管理办法》；应急管理组织包括危机处理领导小组和应急管理小组，工作内容包括预防预警、事件处理、对外信息披露、内部信息通报、特殊情况处理、后期处置等方面。根据《信息技术应急管理办法》规定，信息技术部定期组织关键岗位人员开展应急演练，频率每年不低于一次，实际演练每年不低于两次；应急演练形成文档并保留五年以上，对演练过程中发现的问题及时整改，针对演练文档也将根据演练结果进行不定期更新。

第十部分

未来展望

展望 2023 年，公司将坚持“长期导向、合规经营、守正创新”的经营理念，致力于为投资者提供专业、稳健的多资产管理服务，为基金份额持有人创造长期价值。公司将加快推进完善绿色金融制度，坚持 ESG 责任投资理念，推动绿色低碳运营发展，为服务贯彻新发展理念、构建新发展格局，促进中国经济转型做出贡献。

附录 1：《深圳市金融机构环境信息披露指引》索引目录

指标内容	披露内容索引
1. 基本信息	1
2. 战略目标	5
2.1 环境、绿色金融相关目标	5
2.2 环境、绿色金融相关发展战略	6
3. 环境及绿色金融相关治理结构	7
3.1 董事会层面	7
3.2 高级管理层层面	7
3.3 专业部门层面	7
4. 环境及绿色金融相关政策制度	9
4.1 内部政策	9
4.2 外部政策	10
5. 环境风险管理	11
5.1 环境风险及机遇管理机制	11
5.2 利益相关方关注的重大环境议题	11
5.3 识别的环境风险和机遇	11
5.4 环境风险量化分析	11
6. 经营活动的环境影响	13
6.1 经营活动能源消耗	13
6.2 经营活动资源消耗	13
6.3 温室气体排放	13
6.4 环保措施及环境效益	14
6.5 经营活动环境影响的量化测算	31

7. 投融资活动的环境影响	16
7.1 整体投融资情况	17
7.2 绿色投融资活动情况	18
7.3 绿色投融资活动环境效益	19
7.4 整体投融资活动碳排放	19
7.5 投融资影响的测算与表达	32
8. 绿色金融培训及公益活动	21
8.1 金融培训	21
8.2 公益活动	21
9. 绿色金融创新及研究成果	21
9.1 绿色金融创新实践案例	21
9.2 绿色金融成果奖项	21
9.3 绿色金融研究	21
10. 数据梳理、校验及保护	22
10.1 数据梳理、校验及保护	22
10.2 数据安全应急预案	22

附录 2：金融机构环境信息披露指南内容索引

指标内容	披露内容索引
1. 年度概况	5
2. 环境相关治理结构	7
2.1 董事会层面	7
2.2 高管层层面	7
2.3 专业部门层面	7
3. 环境相关政策制度	9
3.1 内部管理制度	9
3.2 外部政策	10
3.3 国际公约、国家及所在地区的环境政策	10
4. 环境相关产品与服务创新	5
4.1 绿色金融产品创新与服务开发情况	5
4.2 绿色产品创新效益	5
5. 环境风险管理流程	11
5.1 环境风险识别和评估流程	11
5.2 环境风险管理和控制流程	11
6. 环境因素对金融机构的影响	11
6.1 金融机构环境风险和机遇	11
6.2 环境风险量化分析	11
7. 金融机构投融资活动的环境影响	17
7.1 银行投融资所产生的环境影响	/
7.2 银行投融资环境影响的测算与表达	/
8. 金融机构经营活动环境影响	13
8.1 直接温室气体排放和资源消耗	13
8.2 间接温室气体排放和资源消耗	13

指标内容	披露内容索引
8.3 环保措施所产生的环境效益	15
8.4 经营活动环境影响的计算	31
9. 数据梳理、校验及保护	22
10. 绿色金融产品创新及研究成果	21
11. 其他环境相关信息	/

附录 3：TCFD 指标索引

指标内容	披露内容索引
1. 治理	7
1.1 描述董事会对气候相关风险和机遇的监督	7
1.2 描述管理层在评估和管理气候相关风险和机遇方面的作用	7
2. 策略	7
2.1 描述董事会对气候相关风险和机遇的监督	7
2.2 描述管理层在评估和管理气候相关风险和机遇方面的作用	7
2.3 描述董事会对气候相关风险和机遇的监督	7
3. 风险管理	11
3.1 描述组织识别和评估气候相关风险的流程	11
3.2 描述组织管理气候相关风险的流程	11
3.3 描述如何将识别、评估和管理气候相关风险的过程整合到组织的整体风险管理中	11
4. 目标	5
4.1 披露组织根据其战略和风险管理流程评估气候相关风险和机遇所使用的指标	11
4.2 披露范围 1、范围 2 和范围 3 温室气体（GHG）排放（如适用）以及相关风险	13
4.3 描述组织用于管理与气候相关的风险和机遇的目标，以及针对目标的绩效	5

附录 4：经营活动的环境影响计算方法

1. 范围 1、范围 2 排放计算方法

范围 1 和范围 2 的二氧化碳排放量使用下列公示进行计算

$$tCO_2 = \sum_i^n E_i \times x_i$$

tCO_2 : 项目二氧化碳排放量，单位为吨二氧化碳；

E_i : 项目能源品种消费量；

x_i : 项目能源品种的二氧化碳排放因子。

2. 范围 3 排放计算方法

公司从差旅管理系统提取员工的出差行程，因数据记录的限制，无法完全确定员工出差的交通工具和交通里程。根据差旅系统数据，报告期全年员工差旅乘坐飞机里程数为 1003398 公里。基于实际业务开展情况，公司评估统计需要定期使用高铁出行的差旅频率，评估报告期高铁出行里程数为 144000 公里。雇员差旅乘坐交通工具产生的碳排放=员工差旅乘坐高铁产生的碳排放+员工差旅乘坐飞机产生的碳排放。

3. 排放因子取值参考

序号	变量	单位	排放因子	排放因子单位	取值参考
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）
2	标准煤	吨	2.8419	吨二氧化碳/吨	
3	汽油	升	0.002121	吨二氧化碳/升	
4	水（用水）	吨	0.002162	吨二氧化碳/吨	
5	电力（广东地区）	千瓦时	0.4512	千克二氧化碳/千瓦时	深圳地区机构使用《广东省市县（区）级温室气体清单
6	电力（其他地区）	千瓦时	0.4512	千克二氧化碳/千瓦时	

					编制指南》 中 2018 年广 东省电网平 均排放因子 0.4512 kgCO ₂ /kWh 作 为电力排放 因子，其他 地区采用 《企业温室 气体排放核 算方法与报 告指南》中 规定的 0.4512 kgCO ₂ /kWh 作 为电力排放 因子。
7	纸张	吨	3.5	吨二氧化碳/吨	北京绿交所
8	飞机出行	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
9	高铁出行	人·千米	0.000026	吨二氧化碳/人·千米	
10	差旅住宿	晚·房	0.02529	吨二氧化碳/晚·房	
11	厨余垃圾	吨	0.00444	吨二氧化碳/吨	
12	非厨余垃圾	吨	0.35319	吨二氧化碳/吨	

附录 5：投融资活动环境影响的量化测算

公司依据《金融机构碳核算技术指南》作为环境风险投融资影响的总体指导文件，根据《指南》的要求，充分参考中国银行保险监督管理委员会《绿色信贷项目节能减排量测算指引》、《工业企业温室气体排放核算和报告通则》（GB/T 32150）、《节能量测量和验证技术通则》（GB/T 28750）、《节能量测量和验证实施指南》（GB/T 32045）、《基于项目的温室气体减排量评估技术规范 通用要求》（GB/T 33760）等标准规范要求，根据贷前审查、可研报告、能评报告、环评报告等相关材料，对公司投融资业务的碳排放进行了核算。

项目融资业务碳核算依据

变量说明	$E_{\text{项目业务}} = E_{\text{项目}} \times \left(\frac{V_{\text{投资}}}{V_{\text{总投资}}} \right)$
E 项目业务	报告期内，非项目融资业务对应的碳排放量，单位为吨二氧化碳当量（tCO ₂ e）；
E 项目	报告期内，项目的碳排放量，单位为吨二氧化碳当量（tCO ₂ e）；
V 投资	报告期内，金融机构对项目的月均投资额，单位为万元；
V 总投资	报告期内，项目的总投资额，单位为万元。
当 $V_{\text{投资}} > V_{\text{总投资}}$ 时， $\left(\frac{V_{\text{投资}}}{V_{\text{总投资}}} \right) = 1$ 。	

非项目融资业务核算依据

变量说明	$E_{\text{非项目业务}} = E_{\text{主体}} \times \left(\frac{V_{\text{融资}}}{V_{\text{收入}}} \right)$
E 非项目业务	报告期内，非项目融资业务对应的碳排放量，单位为吨二氧化碳当量（tCO ₂ e）；
E 主体	报告期内，非项目融资业务相关融资主体的碳排放量，单位为吨二氧化碳当量（tCO ₂ e）；
V 融资	报告期内，金融机构对融资主体的月均非项目融资额，单位为万元；
V 收入	报告期内，融资主体的主营业务收入，单位为万元。
当 $V_{\text{融资}} > V_{\text{收入}}$ 时， $\left(\frac{V_{\text{融资}}}{V_{\text{收入}}} \right) = 1$ 。	