

渤海汇金证券资产管理有限公司 环境信息披露报告



报告年度： 2023 年度

编写单位： 渤海汇金证券资产管理有限公司

编制日期： 2024 年 6 月 27 日

目录

| | |
|--------------------------------|----|
| 关于本报告..... | 1 |
| 1、关于我们..... | 1 |
| 1.1 基本信息 | 1 |
| 1.2 公司概况 | 1 |
| 1.3 报告期内公司获奖情况..... | 2 |
| 2、战略目标..... | 5 |
| 3、环境及绿色相关治理结构..... | 6 |
| 3.1 董事会层面 | 6 |
| 3.2 高级管理层面..... | 6 |
| 3.3 专业部门层面..... | 7 |
| 4、环境及绿色金融相关政策制度..... | 8 |
| 4.1 外部政策 | 8 |
| 4.2 内部政策 | 9 |
| 5、环境风险管理..... | 10 |
| 5.1 识别的环境风险和机遇..... | 10 |
| 5.2 气候/环境风险及机遇管理机制..... | 11 |
| 6、经营活动的环境影响..... | 13 |
| 6.1 经营活动资源消耗..... | 13 |
| 6.2 经营活动温室气体排放..... | 14 |
| 6.3 环保措施 | 15 |
| 7、投融资活动的环境影响..... | 16 |
| 7.1 整体投融资情况..... | 16 |
| 7.2 整体投融资活动碳排放..... | 17 |
| 7.3 绿色投融资活动情况..... | 18 |
| 7.4 绿色投融资活动环境效益..... | 19 |
| 8、绿色金融培训及公益活动..... | 21 |
| 8.1 培训活动 | 21 |
| 8.2 公益活动 | 21 |
| 9、绿色金融创新案例及成果奖项..... | 22 |
| 9.1 绿色金融创新实践案例..... | 22 |
| 9.2 绿色金融研究及成果奖项..... | 23 |
| 10、数据梳理、校验及保护..... | 24 |
| 10.1 数据梳理、校验及保护..... | 24 |
| 10.2 数据安全应急预案..... | 25 |
| 10.3 数据安全规划..... | 25 |
| 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 TCFD 指标索引 | 26 |

关于本报告

本报告是渤海汇金证券资产管理有限公司（本报告中也简称“渤海汇金”或“公司”或“本公司”或“我们”）单独发布的环境信息披露报告。本报告阐述了本公司 2023 年度在应对气候变化、环境表现、绿色金融等方面的主要实践和成果，以回应各利益相关方的期望与关注，并促进本公司持续提升绿色低碳发展能力。

报告范围

本报告为年度报告。时间范围涵盖 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日，部分信息涉及以往年度。除另有注明外，本报告以渤海汇金为主体部分，部分内容涵盖渤海证券股份有限公司（本报告中也简称“渤海证券”）。

编写依据

本报告参考中国人民银行《金融机构环境信息披露指南》、《气候相关财务信息披露工作组（TCFD）建议报告》、《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》进行编制。

数据说明

本报告所涉及数据为内部统计数据、报送监管数据等，部分数据如与年度报告有差异，以年度报告数据为准。若无特殊说明，本报告所使用的货币单位均为人民币。

报告发布形式

本报告以网络形式发布，所涉及的内容及数据未经授权不得转载。

地址：深圳市前海深港合作区南山街道桂湾五路 128 号深港基金小镇对冲基金

中心 506

联系电话：400-651-1717

邮编：518054

邮箱：bhhjzg123@163.com

1、关于我们

1.1 基本信息

表1 基本信息表

| 组织基本信息 | | | |
|----------|---|-------|--------------------------|
| 机构名称 | 渤海汇金证券资产管理有限公司 | 单位性质 | 国有企业 |
| 法定代表人 | 齐朝晖 | 填报负责人 | 刘佳 |
| 全球法人识别编码 | 300300E1012644000042 | 联系人 | 刘佳 |
| 统一社会信用代码 | 91440300MA5DCW0F32 | 所属行业 | 金融业>资本市场服务>资本投资服务（J6760） |
| 总部所在地 | 深圳市前海深港合作区南山街道桂湾五路 128 号基金小镇对冲基金中心 506 | | |
| 经营位置 | 天津市南开区宾水西道 8 号 北京市西城区西直门外大街甲 143 号凯旋大厦 A 座 2 层 中国（上海）自由贸易试验区银城路 116、128 号 9 层 902 室 | | |
| 主要产品和服务 | 证券资产管理；公开募集证券投资基金管理。 | | |
| 服务的客户类型 | 公司主要业务包括证券资产管理业务和公开募集证券投资基金管理业务，其中证券资产管理业务包括集合资产管理业务、单一资产管理业务和资产证券化业务。公司通过深度洞察客户需求，准确把握市场形势，在管理稳健的同时不乏创新，形成了丰富的资产管理产品线。集合资产管理业务和单一资产管理业务向合格投资者推广销售，公募基金业务向社会公众推广销售，资产证券化业务向专业机构投资者推广销售。 | | |

1.2 公司概况

渤海汇金证券资产管理有限公司成立于 2016 年 5 月，负责公司证券资产管理和公开募集证券投资基金管理业务，为渤海证券全资子公司。渤海证券自 2010 年开始从事券商集合、单一、专项等资产管理业务，2014 年荣获公募证券投资基金业务资格，成为第 6 家获批公募资格牌照的券商，2016 年正式获批设立券商资产管理公司，公司拥有深厚的传统证券公司底蕴。目前，渤海汇金注册资本 11 亿元，下设有天津、北京、上海分公司。

渤海汇金自成立以来持续深化改革、开拓创新，坚持把金融服务实体经济作为根本宗旨，不断为公司高质量发展赋能。近年来，公募业务迈入崭新阶段，基金规模和业绩屡创新高，汇添益 3 个月定开债基首获“五年期金牛

奖”。集合资管计划屡获丰收，主动管理规模占比持续提升，部分集合计划产品数次荣获“金牛奖”。资产证券化领域地位逐步加强，在践行绿色发展理念、弘扬红色教育、支持革命老区经济发展等方面成立多只项目。公司部分单项项目的设立，彰显渤海汇金不断创新金融产品、提升客户服务水平，为实体经济注入活力，在金融强国的改革发展大局中贡献力量。

1.3 报告期内公司获奖情况

表2 2023年度获奖情况

| 重大奖项名称 | 获奖图片 |
|-----------------------------|--|
| 2023 年度品牌形象券商资管 |  |
| 第八届 CNABS “金桂奖”之“最具创新突破产品奖” |  |

金牛奖：五年期短期纯债型金牛资管计划



金牛奖：五年期中长期纯债型金牛资管计划



中国人民银行天津市分行 2023 年天津市
反洗钱征文二等奖

| 中国人民银行天津市分行文件 | | | |
|---|---------------------------|---------------------|-------------|
| 津银发〔2023〕144号 | | | |
| 中国人民银行天津市分行关于 2023 年 天津市反洗钱征文评选结果的通报 | | | |
| 二等奖 (35) | 浅谈保险业大额现金交易的反洗钱实践与建议 | 友邦人寿保险有限公司天津分公司 | 马欣 |
| | 基于风险为本理念探析财险实务中反洗钱工作难点与建议 | 渤海财产保险股份有限公司 | 朱其绪 |
| | 浅谈寿险公司高风险客户管理存在的问题与对策建议 | 中国人寿保险股份有限公司天津市分公司 | 蒋达智、李雪妮、张丽萍 |
| | 反洗钱工作之客户可疑交易甄别案例解析 | 一德期货有限公司 | 赛海晶 |
| | 反洗钱国际经验比较研究 | 渤海证券股份有限公司汇金子公司 | 李英雅 |
| | 浅析跨境赌博洗钱风险特征及相关防范建议 | 上海汇付支付有限公司天津分公司 | 潘捷、曹圣夕、韩玮佳 |
| | 支付机构反洗钱履职面临的挑战与问题 | 联动优势电子商务有限公司天津分公司 | 范佳丽 |
| | 空壳公司洗钱风险分析及对策建议 | 现代金融控股(成都)有限公司天津分公司 | 李亚婷 |

2、战略目标

为应对全球气候变化的严峻局势，促进碳减排实现碳中和已经成为全球共识，去年以来，全球越来越多的国家提出碳中和目标。我国对外宣布，将二氧化碳排放力争于 2030 年前达到峰值，努力争取 2060 年前实现碳中和。实现“碳达峰、碳中和”的目标，事关经济社会发展全局和长期战略，而在实现碳中和的过程中，也将带来新的经济增长点，相关行业领域孕育着巨大的投资机会。

绿色金融是我国经济发展中的重要一环，为推动经济向高质量发展提供重要支撑。在环境、绿色金融相关发展目标及战略方面，渤海汇金在认真研究国内外宏观经济环境、证券市场运行情况和广大投资者投资需求的基础上，积极深耕绿色金融领域，深入挖掘绿色资产，助力实体经济。渤海汇金公司积极推动绿色金融产品的创新与研发，提高绿色金融市场的参与度与竞争力，提升绿色金融服务水平，满足客户对绿色投资的需求，提高客户满意度。

未来，渤海汇金将聚焦绿色租赁 ABS、绿色类 REITs 等绿色 ABS 产品，与绿色金融参与机构紧密合作，充分发挥自身在绿色租赁政策机制、绿色租赁金融产品创新、绿色租赁 ABS 产品发行等领域的专业基础，积极落实绿色低碳发展行动，深入探索和实践零碳港区、绿色运力、绿色资产证券化等领域，推动绿色金融创新场景做深做实，服务绿色低碳产业高质量发展。

3、环境及绿色相关治理结构

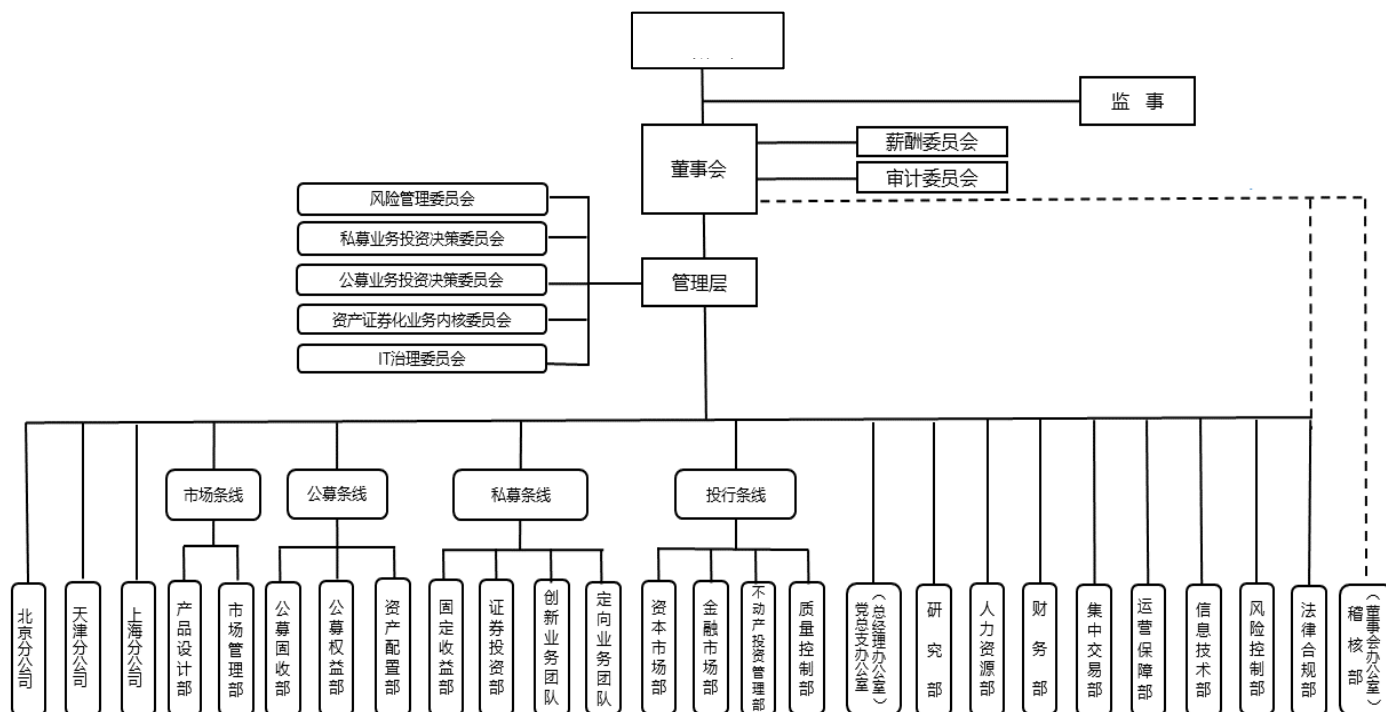


图 1 渤海汇金组织架构

公司严格按照《公司法》等相关法律法规与监管机构有关规范性文件的要求，建立了规范的公司治理结构，明确决策、执行、监督等方面的职责权限，形成了科学分工、各司其责，有效制衡的公司治理结构。

此外，渤海汇金计划积极将 ESG 理念融入投资决策和运营管理过程中，持续通过制度体系建设、流程环节优化等方式，有效地助力经济社会绿色低碳转型。渤海汇金绿色金融管理架构由董事会层面、高级管理层和专业部门层面组成。

3.1 董事会层面

董事会不仅高度重视绿色金融领域相关工作，承担绿色金融主体责任，而且积极发挥作用，推动公司积极贯彻落实国家碳达峰碳中和重大战略部署，不断明确公司宏观绿色发展战略，强化绿色金融规划的落地。

3.2 高级管理层

高级管理层在董事会的指导下，负责落实董事会的各项决议，不断建立和完善机制和流程，明确职责和权限并开展考评，确保公司在环境保护、社会责任和公司治理等方面，不断推动公司绿色金融业务发展。

3.3 专业部门层面

公司各条线、部门负责具体执行 ESG 目标落实与绿色金融业务实施，不断明确在绿色金融项目筛选、风险评估、投资决策和后期管理等方面的具体任务。此外，各部门还加强内部协作，形成合力，共同推动公司绿色金融产品和服务的创新与优化。

4、环境及绿色金融相关政策制度

4.1 外部政策

在国家层面，为了构建绿色金融体系，推动绿色金融的健康发展，中国人民银行、财政部、环境保护部等七部委于 2016 年 8 月联合印发了《关于构建绿色金融体系的指导意见》。该意见系统阐述了绿色信贷、绿色债券、绿色保险、绿色基金、碳金融市场工具等关键领域的政策方向，确立了绿色金融发展的顶层设计和基本框架，为绿色金融的规范化、健康发展提供了坚实的制度保障。

为进一步推动绿色产业发展，2019 年 3 月 6 日，国家发展和改革委员会、中国人民银行等七部委联合发布了《绿色产业指导目录（2019 年版）》及其解释说明文件。该文件明确了绿色产业的发展重点，界定了绿色产业和项目的标准与范围，为绿色债券激励等政策的制定和实施提供了坚实基础，有效促进了我国绿色债券市场的规范化、健康发展。

2020 年 9 月 22 日，国家主席习近平在联合国大会一般性辩论中，向全世界庄严宣布，中国将力争于 2030 年前实现“碳达峰”，在 2060 年前实现“碳中和”。绿色金融更上一层，在支持低碳减排、绿色发展发挥着越来越大的作用。

2023 年 10 月 30 日至 31 日，习近平总书记在中央金融工作会议上发表重要讲话。会议首次提出“加快建设金融强国”的战略目标，并特别强调要“做好科技金融、绿色金融、普惠金融、养老金融、数字金融五篇大文章”，为金融高质量发展指明了方向。这一重要讲话为绿色金融的进一步发展注入了强大动力，为构建绿色金融体系提供了更加明确的指导。

在区域层面，深圳市坚决贯彻落实国家绿色金融顶层设计的决策部署，持续完善绿色金融政策体系，以推动绿色转型发展的步伐不断加快。2018 年 12 月，深圳市政府正式印发《深圳市人民政府关于构建绿色金融体系的实施意见》，旨在进一步深化供给侧结构性改革，构建绿色金融体系，创新绿色金融服务，为深圳市经济社会发展注入新的动力。

2020 年 10 月，《深圳经济特区绿色金融条例》经深圳市第六届人民代表大会常务委员会审议通过，以法律的形式为深圳市绿色金融发展提供坚强保障。该条例明确提出，符合条件的金融机构必须强制性披露环境信息，为构建绿色金融可持续商业化发展生态系统提供必要的信息支撑。同时，条例还强调金融机构要

制定符合自身发展战略的绿色投资管理制度，确保绿色金融活动的规范化、制度化。

为进一步推动绿色发展理念的落地生根，2021年3月，深圳市市场监督管理局发布了《绿色企业评价规范》等四个标准，初步构建了绿色标准体系，为全市绿色发展提供了有力指导。同年1月，深圳市政府印发《深圳市生态环境保护“十四五”规划》，明确提出推进产业绿色化和绿色产业化的目标任务，构建市场导向的绿色技术创新体系，进一步完善绿色金融政策体系，为深圳市生态环境保护工作提供有力支撑。

为规范金融机构环境信息披露工作，提高信息披露质量，2022年9月，深圳市地方金融监管局发布《深圳市金融机构环境信息披露指引》，对金融机构环境信息披露工作提出明确要求，确保信息披露的准确性、完整性和及时性。这一举措的实施，将进一步推动深圳市绿色金融的健康发展，为深圳市绿色转型提供坚实保障。

4.2 内部政策

渤海汇金不断完善内部环境相关政策制度，加大对绿色经济、低碳经济、循环经济的支持，并开展积极的行动落实相关目标。通过全面的战略规划、严谨的投资管理，渤海汇金将ESG理念纳入日常经营决策中，促进绿色投资业务稳步前进。此外，公司积极引导员工开展绿色办公，通过自觉节水、节电等节约行为，实现污染零排放。同时，公司还将积极与各利益相关方携手合作，互利共赢，合力推动绿色可持续金融的发展。

5、环境风险管理

5.1 识别的环境风险和机遇

环境和气候风险可以按其来源分为两大类：转型风险和物理风险。转型风险的来源主要包括政策、技术、观念等为应对气候变化和环境挑战的人为因素而发生的转变。物理风险的来源包括各种与气候相关的自然灾害和事件。依据气候相关财务信息披露工作组(TCFD)对气候变化和环境风险所导致的金融风险分类，公司面临的环境和气候风险主要包括自身经营活动面临的风险和投融资活动面临的风险。通过环境和气候风险识别可以分析环境因素引发的金融风险及创造的潜在投资机会，从而规避经济损失和金融风险，并获取潜在收益。

渤海汇金在应对这些风险时，充分参考了气候相关财务信息披露工作组(TCFD)的指导原则，深入分析了气候/环境相关因子对业务的具体影响。同时，结合公司业务特征和业务辐射范围对环境相关风险和机遇进行识别，同时根据相关政策指引和外部市场需求提出应对措施。

基于上述对气候/环境风险分析，本公司对于所涉及的风险主要采取了以下措施予以应对：

表 3 渤海汇金风险/机遇影响分析及应对

| 风险/机遇因子 | 风险/机遇影响分析 | 潜在影响 | 本公司应对措施 |
|---------|-----------|---|---|
| 转型风险 | 政策和法律 | 增加成本或者丧失市场潜在的机会；与监管趋势相悖的金融产品或服务需求将降低或将被贬值。 | 关注经营过程中对外部环境带来的影响，积极配合开发和引入符合绿色或 ESG 理念的金融产品和服务，丰富绿色金融产品体系。 |
| | 市场变化 | 针对碳密集产业将会面临更高的成本，而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。 | 投资组合价值波动、信用风险上升。 |
| | 股东及投资者 | 强化环境和气候风险管理难度加强。 | 绿色金融高质量发展，对盈利能力提出更高要求。 |
| | 客户 | 绿色金融产品需求逐渐 | 客户对绿色金 |

| | | | | |
|------|---------------|---|--|---|
| | | 变多。 | 融服务满意度有提高空间。 | 融创新，提升客户绿色金融体验。 |
| | 员工 | 绿色金融政策了解和认知度有待加强。 | 提升员工绿色金融素养需要公司提供支持。 | 完善绿色金融知识培训体系，加强与第三方专业机构合作。 |
| | 公众与媒体 | 社会高度关注绿色低碳产业发展情况。 | 公众与媒体不了解公司绿色金融发展进程。 | 强化绿色经营理念和绿色金融产品实施与宣传。 |
| 物理风险 | 台风、洪水等极端天气事件 | 引发运营风险、信用风险。 | 灾害发生时极端天气事件可能影响业务连续性；极端气候下的停电、网络中断对公司业务的影响和经济损失。 | 利用数字科技，完善网络基础设施建设，建立备份档案；及时关注当地气候变化，组织人员参与防汛工作；做好灾备工作，出台极端气候事件应急预案。 |
| | 平均气温上升、降雨量变化等 | 引发运营风险、市场风险。 | 气候风险对公司业务带来的资产负债的不利影响。 | 协调资本配置，完善以气候变化为核心的投资战略与风险防控体系。 |
| 机遇 | 市场机遇 | 随着绿色金融受到国家支持力度持续加大，提前布局绿色产业领域，能够为公司打造新业务。 | 对相关产品和服务的需求增加，提高市场竞争力，增加营业收入，产品布局领域拓宽，业务多元化水平提高。 | 关注市场动态，持续学习绿色金融相关知识，提高对投资标的的风险管理能力。 |

5.2 气候/环境风险及机遇管理机制

毫无疑问，环境、气候相关风险将会对经济的发展前景和发展模式造成巨大影响，作为服务和促进经济发展的金融机构也必然面临挑战。如果金融资产在高污染和高碳行业过度集中，将导致较大的潜在风险，尤其在一些气候风险较为严重的地区，相关气候风险敞口值得特别关注。

面对环境、气候相关风险对金融机构带来相应的挑战，渤海汇金将持续理解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。密切关注各业务环节可能受到的环境风险影响，结合业务实际推动环境风险控制理念，促进环境风险管理水平持续提升。针对环境相关的风险暴露，关注新兴产业和绿色行业，

为公司绿色金融产品开发提供支持，如绿色债券、绿色基金等，支持环境友好型项目，积极参与绿色金融政策的执行。

6、经营活动的环境影响

本公司根据《深圳市金融机构环境信息披露模板及指标说明》对 2023 年报告期内自身经营活动所产生的环境影响进行定量测算，并分三个方面进行披露，包括经营活动资源消耗、经营活动温室气体排放以及环保措施。

6.1 经营活动资源消耗

公司 2023 年度经营活动资源消耗主要包括办公用电、办公用水、办公纸张消耗等，具体指标情况见表。

表 4 渤海汇金 2023 年度经营活动资源消耗统计表

| 指标名称 | 披露细项 | 单位 | 总量 | 人均 | |
|---------------------------------|----------------------------|-------|-----|------------|--------|
| 2023 年末员工总人数 | | 人 | 142 | - | |
| 能源消耗 | 营业办公消耗的化石能源 ¹ | 煤炭 | 吨 | 0 | 0 |
| | | 柴油 | 升 | 0 | 0 |
| | | 汽油 | 升 | 0 | 0 |
| | | 天然气 | 立方米 | 0 | 0 |
| | 自有交通运输工具消耗的燃油 ² | 柴油 | 升 | 0 | 0 |
| | | 汽油 | 升 | 445.38 | 3.14 |
| | 营业办公消耗的电力 | | 千瓦时 | 140,187.00 | 987.23 |
| 雇员因工作出差乘坐的交通工具消耗能源 ³ | | 吨标准煤 | 0 | 0 | |
| 水耗量 | 营业办公所消耗的水 | 总量 | 吨 | 1,439.00 | 10.13 |
| 纸张消耗 | 营业办公消耗的纸张 | | 吨 | 0.97 | 0.01 |
| 废弃物 ⁴ | 一般废弃物 | 非厨余垃圾 | 吨 | 0 | 0 |
| | | 厨余垃圾 | 吨 | 0 | 0 |
| | 电子废弃物 | | 吨 | 0 | 0 |

¹ 公司无营业办公的化石能源消耗。

² 公司使用汽油燃油车，故柴油消耗量为 0。

³ 公司员工差旅交通工具无法统计，为 0。

⁴ 公司倡导光盘行动与绿色办公，无废弃物处理统计。

6.2 经营活动温室气体排放

6.2.1 直接、能源间接温室气体排放（范围一与范围二）

表 5 渤海汇金 2023 年度范围一、范围二温室气体排放统计表

| 指标名称 | 披露细项 | 单位 | 数量 | 人均 |
|-----------------------------|------------------------------------|---------|--------------|---------------|
| 2023 年末员工总人数 | | 人 | 142 | - |
| 直接温室气体排放量（范围一） ⁵ | 营业办公消耗化石能源产生的二氧化碳排放 | 吨二氧化碳当量 | 0 | 0 |
| | 自有交通运输工具燃油消耗产生的二氧化碳排放 ⁶ | 吨二氧化碳当量 | 0.61 | 0.0043 |
| | 直接温室气体排放总量 | 吨二氧化碳当量 | 0.61 | 0.0043 |
| 能源间接温室气体排放量（范围二） | 营业办公消耗的电力产生的间接二氧化碳排放 ⁷ | 吨二氧化碳当量 | 78.06 | 0.55 |
| | 购买的采暖（制冷）服务消耗的燃料 | 吨标准煤 | 0 | 0 |
| | 能源间接温室气体排放总量 | 吨二氧化碳当量 | 78.06 | 0.55 |

6.2.2 其他经营活动简介温室气体排放（范围三）

表 6 渤海汇金 2023 年度范围三温室气体排放统计表

| 指标名称 | 填报指标 | 单位 | 数量 | 人均数量 | 碳排放（吨二氧化碳当量） | 人均碳排放（吨二氧化碳当量/人） |
|----------------|---------------------|-----|---------|-------|--------------|------------------|
| 2023 年末员工总人数 | | 人 | 142 | - | - | - |
| 其他经营活动间接温室气体排放 | 雇员差旅乘飞机出行 | 公里 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | 雇员差旅乘高铁出行 | 公里 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | 雇员差旅住宿 ⁸ | 晚·间 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | 办公用纸 ⁹ | 吨 | 0.97 | 0.01 | 0.90 | 0.01 |
| | 用水 ¹⁰ | 吨 | 1439.00 | 10.13 | 0.02 | 0.0001 |

⁵ 公司无营业办公消耗的化石能源，自有交通运输工具为燃油车。

⁶ 自有交通运输工具燃油（汽油）的排放因子来源为《中国产品全生命周期温室气体排放系数集（2022）》，取 3.04 吨二氧化碳当量/吨。

⁷ 根据生态环境部、国家统计局关于发布《2021 年电力二氧化碳排放因子》的公告，2021 年全国电网平均排放因子 0.5568 kgCO₂/kWh 作为电力排放因子。

⁸ 公司员工差旅交通工具无法统计，为 0。

⁹ 根据英国环境、食品和农村事务部于 2020 年发布的《关于企业报告温室气体排放因子指南》，纸张的二氧化碳排放因子为 0.0009194 吨 CO₂/kg。

¹⁰ 用水量的碳排放因子《中国产品全生命周期温室气体排放系数集（2022）》。

| 指标名称 | 填报指标 | 单位 | 数量 | 人均数量 | 碳排放 (吨二氧化碳当量) | 人均碳排放 (吨二氧化碳当量/人) |
|-------|------------------|---------|----|------|------------------|----------------------|
| (范围三) | 其他经营活动间接温室气体排放总量 | 吨二氧化碳当量 | - | | 0.92 | 0.01 |

6.3 环保措施

日常经营过程中，渤海汇金努力践行低碳环保、节约资源的理念。

在节约用电管理方面，办公区域根据实际情况按需开灯，光线充足且自然光照较好时不开灯，长时间离开办公室或下班后及时关灯，会议室准备期间少开灯，结束后人离灯熄；积极使用节能灯具，淘汰高耗能照明设备；按需使用空调。

在节约用水管理方面，公司员工按需取水饮水，严禁将未喝完的瓶装水随意扔弃；日常用水严禁将水量开到最大，用水后随手关闭水龙头；发现漏水情况及时报修，杜绝跑、冒、漏、滴和长水流现象。

在节约办公耗材方面，公司充分利用办公自动化系统，减少纸质文件、材料的使用。确需用纸的，坚持双面打印或单面重复利用，减少浪费。

在资源回收利用方面，公司鼓励重新利用单面打印过的纸张起草文件、做便签和内部备忘录；在办公室中设置废纸回收箱，将已经充分利用的纸张、废报纸、废书等放入回收箱中，收集后集中处理；提倡使用可替换内芯的笔、碳粉盒和充电电池及其它可循环使用的物品。

7、投融资活动的环境影响

7.1 整体投融资情况

截至 2023 年 12 月 31 日，渤海汇金受托资产管理业务规模 685.73 亿元。其中，集合资产管理业务受托规模 139.80 亿元，定向资产管理业务受托规模为 310.37 亿元，专项资产管理业务受托规模 40.18 亿元，公募基金受托规模 195.38 亿元。

截至 2023 年 12 月 31 日，渤海汇金年末受托的 15 支公募基金¹¹中，有 4 支权益基金，权益基金投资组合中投资于股票部分的公允价值为 113,856,557.95 元。根据国民经济行业分类，该部分投向 15 个行业，分别为农、林、牧、渔业，制造业，电力、热力、燃气及水生产和供应业，建筑业，批发和零售业，交通运输、仓储和邮政业，住宿和餐饮业，信息传输、软件和信息技术服务业，金融业，房地产业，租赁和商务服务业，科学研究和技术服务业，水利、环境和公共设施管理业，教育和综合类。其中，各行业投资金额（按公允价值计算）占比如下表所示。

表 7 渤海汇金 2023 年度权益基金投资于股票的公允价值占比

| 行业类型 | 投资金额占比 (%) |
|------------------|------------|
| 农、林、牧、渔业 | 0.12% |
| 制造业 | 84.23% |
| 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 0.72% |
| 建筑业 | 1.06% |
| 批发和零售业 | 0.36% |
| 交通运输、仓储和邮政业 | 0.15% |
| 住宿和餐饮业 | 1.06% |
| 信息传输、软件和信息技术服务业 | 8.75% |
| 金融业 | 0.13% |
| 房地产业 | 0.80% |
| 租赁和商务服务业 | 0.08% |
| 科学研究和技术服务业 | 0.26% |
| 水利、环境和公共设施管理业 | 1.81% |
| 教育 | 0.16% |
| 综合 | 0.31% |
| 合计 | 100% |

¹¹ 投资金额仅统计公募基金（不涉及 FOF）。

7.2 整体投融资活动碳排放

7.2.1 投融资活动碳排放量计算

本报告按照《工业企业温室气体排放核算和报告通则》（GB/T 32150）及相关企业温室气体排放核算和报告标准、企业温室气体排放核算方法与金融机构碳核算技术指南（试行）等要求，核算其报告期内的碳排放量。

$$E_{\text{项目业务}} = E_{\text{项目}} \times \left(\frac{V_{\text{投资}}}{V_{\text{总投资}}} \right)$$

式中：

$E_{\text{项目业务}}$ ：报告期内，项目融资业务对应的碳排放量；单位为吨二氧化碳当量（tCO₂e）；

$E_{\text{项目}}$ ：报告期内，项目的碳排放量，单位为吨二氧化碳当量（tCO₂e）；

$V_{\text{投资}}$ ：报告期内，金融机构对项目的月均投资额，单位为万元；

$V_{\text{总投资}}$ ：报告期内，项目的总投资额，单位为万元。

7.2.2 投融资活动碳排放

2023 年，渤海汇金权益基金中投资于股票部分碳排放量为 7,803.47 吨。其中，各行业碳排放量如下图所示。

表 8 渤海汇金 2023 年权益基金中投资于股票部分碳排放量¹²

¹² 碳排放核算方法主要依据《金融机构碳核算技术指南（试行）》和其规范性引用文件。

| 行业类型 | 碳排放量（吨） |
|------------------|-----------------|
| 农、林、牧、渔业 | 3.19 |
| 制造业 | 7,271.21 |
| 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 358.02 |
| 建筑业 | 13.75 |
| 批发和零售业 | 1.65 |
| 交通运输、仓储和邮政业 | 27.81 |
| 住宿和餐饮业 | 9.94 |
| 信息传输、软件和信息技术服务业 | 85.60 |
| 金融业 | 0.60 |
| 房地产业 | 4.90 |
| 租赁和商务服务业 | 1.00 |
| 科学研究和技术服务业 | 2.77 |
| 水利、环境和公共设施管理业 | 19.11 |
| 教育 | 0.90 |
| 综合 | 3.02 |
| 合计 | 7,803.47 |

7.3 绿色投融资活动情况

7.3.1 绿色资产管理产品

绿色资产管理产品是指资产管理产品名称中包含绿色、低碳、环保、节能、清洁能源、新能源、新能源汽车、ESG、碳中和、可持续、气候等具有绿色、低碳主题表述名词的产品。

渤海汇金管理的 15 支公募基金中涉及 1 支绿色主题基金——“渤海汇金低碳经济一年持有期混合型发起式证券投资基金”，该基金重点投资于符合全球碳中和发展目标，受益于全球碳减排浪潮的行业和领域，包括新能源发电、储能、电动汽车、垃圾处理、智能电网系统、节能环保、大气污染治理、氢能源开发利用等行业，以及产业链上下游的相关公司。重点投资的行业有电力设备、有色金属、机械设备、基础化工、公用事业、环保、电子和计算机等行业。

截至 2023 年底，该绿色主题基金规模为 1969.5 万元，占渤海汇金资产管理产品总规模的比例为 0.1%，较上一报告期末增长 100%。

7.3.2 投资绿色金融工具及绿色企业（项目）情况

基于《深圳证券交易所公司债券创新品种业务指引第 1 号——绿色公司债券》（深证上〔2020〕1173 号），结合使用场景，定义绿色企业主体为：同时满足以下 3 个条件：

条件 1，某项业务符合国家发改委《绿色产业指导目录（2019）》；

条件 2，且该业务符合情形之一：①占营收比超过 50%；②占营业收入比未超过 50%，但该业务对应营收和利润对应占比在所有业务中排第一，且相应占比均超过 30%；

条件 3，该企业符合所有情形：近三年无较大、重大和特大级别的环境和生态突发事件发生和生产安全事故，且一般级别的环境和生态突发事件发生和生产安全事故不超过 1 次；近三年警告、罚款种类的环保、安全生产、节约能源行政处罚次数分别不超过 5 次且已按要求改正违法行为，且无其他种类的环保、安全生产、节约能源行政处罚；上一年度未被纳入环保、安监、经信、水利等与资源环境相关监管部门失信黑名单；非落后产能淘汰企业和重点要求整治企业。

综上所述，渤海汇金不涉及投资绿色金融工具和绿色企业相关内容。

7.3.3 其他绿色投融资服务

渤海汇金-国君-济南城市建设集团绿色资产支持专项计划（碳中和）于 2023 年 9 月 7 日取得无异议函，助力济南城市建设集团有限公司通过类 REITs 产品实现优质资产存量盘活，融资规模达 18.50 亿元，发行期限为 18 年。本项目底层资产为济南城建集团的标志性建筑物，单体超高层商务综合体——济南城市建设大厦，荣获绿色建筑领域国际国内多个权威认证，作为山东省首单“绿色”+“碳中和”双重标识的资产证券化产品，将进一步推动济南城建集团高质量发展。

7.4 绿色投融资活动环境效益

绿色资产管理产品的环境效益是指绿色资产管理产品所投资的项目或企业能够产生的节能减排、环境保护、资源循环利用等方面的效果。渤海汇金资产管理产品中“渤海汇金-国君-济南城市建设集团绿色资产支持专项计划（碳中和）”底层资产为济南城建集团的标志性建筑物，单体超高层商务综合体——济南城市建设大厦，荣获绿色建筑领域国际国内多个权威认证，每年可实现节约标煤 5,665.03 吨，减排二氧化碳 16,615.55 吨，减排二氧化硫 1.90 吨，减排氮氧化物 2.86 吨，减排烟尘 0.41 吨。

此外，投资绿色建筑领域类项目可以带来多方面的环境效益：

绿色建筑是一种在建设期间不破坏环境基本生态平衡条件，在运营期间所消耗的物质和能源明显少于传统建筑的一种新型建筑，又可称为可持续发展建筑、生态建筑、回归大自然建筑、节能环保建筑等。

绿色建筑的环境效益集中体现在节能方面。相比普通建筑，更高效地使用土地资源，并提供相对而言更为集中的公共服务设施，充分利用太阳能，采用节能的建筑围护结构以及减少采暖和空调的使用。根据自然通风的原理设置风冷系统，使建筑能够有效地利用夏季的主导风向。建筑采用适应当地气候条件的平面形式及总体布局。在建筑设计、建造和建筑材料的选择中，均考虑资源的合理使用和处置。要减少资源的使用，力求使资源可再生利用。节约水资源，包括绿化的节约用水。建筑过程中使用更高比例的可再生材料和可循环材料，更充分的考虑场地自然条件，合理设计建筑的围护结构，运行过程中使用节能灯具，并配置相应的智能控制系统，电梯配置高效变压器，供水按照功能和区域分配，使用节水卫生洁具，设计雨污分流、节水滴灌等，这些措施都直接或间接的减少能耗。

8、绿色金融培训及公益活动

8.1 培训活动

2023 年度，渤海汇金未集中组织员工开展绿色金融相关培训活动。但为深化员工对绿色投资及环境、社会、治理（ESG）前沿政策的理解，并切实将绿色金融与 ESG 发展理念融入公司运营之中，渤海汇金积极鼓励全体员工自发学习绿色投融资和国内外 ESG 政策等领域知识，拓宽知识面，进一步提升员工的绿色投资专业水平，推动公司绿色金融的可持续发展。

8.2 公益活动

渤海汇金一直积极响应国家在绿色金融方面公益事业号召，鼓励员工自发开展相关领域公益实践。

9、绿色金融创新案例及成果奖项

9.1 绿色金融创新实践案例

➤ 绿色债券创新，推进能源绿色转型

渤海汇金-国君-济南城市建设集团绿色资产支持专项计划（碳中和）于 2023 年 9 月 7 日取得无异议函，助力济南城市建设集团有限公司通过类 REITs 产品实现优质资产存量盘活，融资规模达 18.50 亿元，发行期限为 18 年。本项目底层资产为济南城建集团的标志性建筑物，单体超高层商务综合体——济南城市建设大厦，荣获绿色建筑领域国际国内多个权威认证，作为山东省首单“绿色+碳中和”双重标识的资产证券化产品，将进一步推动济南城建集团高质量发展。



图 2 绿色资产支持专项计划喜报

➤ **低碳概念基金，助力双碳目标实现**

2022 年末，渤海汇金发行成功了“渤海汇金低碳经济一年持有期混合型发起式证券投资基金”，该基金运作稳定，重点投资于符合全球碳中和发展目标，受益于全球碳减排浪潮的行业和领域，包括新能源发电、储能、电动汽车、垃圾处理、智能电网系统、节能环保、大气污染治理、氢能源开发利用等行业，以及产业链上下游的相关公司。重点投资的行业有电力设备、有色金属、机械设备、基础化工、公用事业、环保、电子和计算机等行业。

➤ **绿色租赁探索，贡献“渤海力量”**

2023 年，渤海汇金作为第一批共建单位参与发布“绿色租赁生态港”，并签署“绿色租赁生态港”建设倡议。这是渤海汇金深入贯彻落实我国“双碳”战略部署、天津市“十项行动”和天津高质量发展支撑引领行动的重要举措，是推动绿色融资租赁高质量发展、助力绿色金融体系建设的有益探索。

9.2 绿色金融研究及成果奖项

渤海汇金一直致力于绿色金融研究，管住行业发展新机遇，推动行业的绿色可持续发展。同时，公司对同业金融机构在环境信息披露方面工作保持高度关注，以不断提高自身在可持续发展领域的专业素养，提升自身竞争力。

10、数据梳理、校验及保护

10.1 数据梳理、校验及保护

渤海汇金建立了数据库一体机，数据库云平台采用两台计算节点用于业务系统数据库的生产运行平台，实现从原有硬件平台迁移至新建数据库云平台，解决现有架构遇到的 IO 等待问题，并满足未来业务增长对平台的性能需求，实现估值、TA 等多套系统数据库的云化整合，对系统进行统一运维，统一管理，通过云平台可视化功能提升数据库运维管理效率，同时通过 QBackup 备份管理软件，实现多套数据库的 CDP 备份保护，解决现有数据库传统备份易造成数据丢失的风险，同时可利用备份平台进行开发测试环境的快速搭建，提升开发测试的快速

更新迭代。从而在容灾性、拓展性、可视化监控、阈值预警等多方面得到提升。建立了异地数据级备份。

10.2 数据安全应急预案

结合公司业务发展、外部环境要求以及用户对于系统数字化升级诉求，渤海汇金信息系统的建设重心从流程治理、功能应用转变为关注数据资产的沉淀应用以及系统整体运营效率提升。渤海汇金建立了《渤海汇金证券资产管理有限公司数据安全规范》《渤海汇金证券资产管理有限公司信息系统安全管理制度》《渤海汇金证券资产管理有限公司网络与信息安全事件应急预案》《渤海汇金证券资产管理有限公司网络与信息安全事件应急处置计划》等制度规范。每年开展至少1次应急演练。设立了信息技术委员会负责公司数据治理工作。

10.3 数据安全规划

为确保数据安全，未来渤海汇金计划建立纵深防御体系，加强数据安全意识和技术保护措施。通过引入支持 S3 协议的分布式对象存储技术，进行设备利旧，为公司提供备份资源，达到降本增效目的。

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 | 对应披露内容索引 |
|-------------------|----------------|
| 1. 基本信息 | 对应本报告第 1 节 |
| 2. 战略目标 | |
| 2.1 环境、绿色金融相关目标 | 对应本报告第 2 节 |
| 2.2 环境、绿色金融相关发展战略 | 对应本报告第 2 节 |
| 3. 环境及绿色金融相关治理结构 | |
| 3.1 董事会层面 | 对应本报告第 3 节 3.1 |
| 3.2 高级管理层 | 对应本报告第 3 节 3.2 |
| 3.3 专业部门层面 | 对应本报告第 3 节 3.3 |
| 环境及绿色金融相关政策制度 | |
| 4.1 内部政策 | 对应本报告第 4 节 4.1 |

| | |
|------------------------|--------------------|
| 4.1 外部政策 | 对应本报告第 4 节 4.2 |
| 4. 环境风险管理 | |
| 5.1 环境风险及机遇管理机制 | 对应本报告第 5 节 5.2 |
| 5.2 利益相关方关注的重大环境议题 | / |
| 5.3 识别的环境风险和机遇 | 对应本报告第 5 节 5.1 |
| 5.4 环境风险量化分析 | 对应本报告第 6、7 节 |
| 5.经营活动的环境影响 | |
| 5.1 经营活动能源消耗 | 对应本报告第 6 节 6.1 |
| 5.2 营业办公耗水 | 对应本报告第 6 节 6.1 |
| 5.3 纸张消耗 | 对应本报告第 6 节 6.1 |
| 5.4 废弃物排放 | / |
| 5.5 温室气体排放 | 对应本报告第 6 节 6.2 |
| 5.6 环保措施及环境效益 | 对应本报告第 6 节 6.3 |
| 5.7 碳抵消信用 | / |
| 7.投融资活动的环境影响 | |
| 7.1 整体投融资情况 | 对应本报告第 7 节 7.1 |
| 7.2 绿色投融资活动情况 | 对应本报告第 7 节 7.3 |
| 7.3 棕色资产投资情况 | / |
| 7.4 绿色投融资活动环境效益 | 对应本报告第 7 节 7.4 |
| 7.5 整体投融资活动碳排放 | 对应本报告第 7 节 7.2 |
| 8.绿色金融培训及公益活动 | |
| 8.1 宣传教育 | 对应本报告第 8 节 8.1-8.2 |
| 9.绿色金融创新案例及成果奖项 | |
| 9.1 绿色金融创新实践案例 | 对应本报告第 9 节 9.1 |
| 9.2 绿色金融成果奖项 | 对应本报告第 9 节 9.2 |
| 9.3 绿色金融研究 | 对应本报告第 9 节 9.2 |
| 10.数据质量管理 | |
| 10.1 数据梳理、校验及保护 | 对应本报告第 10 节 10.1 |
| 10.2 数据安全应急预案 | 对应本报告第 10 节 10.2 |

附录 2 TCFD 指标索引

| 指标内容 | 对应披露内容索引 |
|-------------------------------|------------|
| 1.治理 | |
| 1.1 描述董事会对气候相关风险和机遇的监督 | 对应本报告第 3 节 |
| 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 | 对应本报告第 3 节 |
| 2.策略 | |

| | |
|---|------------|
| 2.1 描述组织在短期、中期和长期内确定的与气候相关的风险和机遇。 | 对应本报告第 5 节 |
| 2.2 描述气候相关的风险和机遇对组织的业务、战略和财务规划的影响 | 对应本报告第 5 节 |
| 3.风险管理 | |
| 3.1 描述组织识别和评估气候相关风险的流程 | 对应本报告第 5 节 |
| 3.2 描述组织管理气候相关风险的流程。 | |
| 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。 | |
| 4.目标 | |
| 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。 | 对应本报告第 5 节 |
| 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。 | 对应本报告第 6 节 |