

海通证券股份有限公司负责任投资声明

海通证券股份有限公司（简称海通证券或公司）秉承“务实、开拓、稳健、卓越”的经营理念，准确定位自身作为上市公司、金融公司以及企业公民的角色，努力实现高质量发展、绘制美好商业蓝图以及致力建设和谐社会，为股东、客户、员工和社会创造价值。

随着 ESG 投资理念的兴起，ESG 因素对上市公司长期投资的影响愈发受到投资者关注。公司积极顺应国内外发展趋势，在投资决策过程中考虑 ESG 相关因素，并应用负面剔除、ESG 因子整合、可持续发展主题投资等责任投资策略，推动责任投资理念与公司投资业务有机融合。

一、组织与管理

为促进 ESG 管理的系统化推进，公司搭建完善的 ESG 三级管理架构，通过设立董事会发展战略与 ESG 管理委员会、ESG 建设领导小组及工作小组、ESG 建设工作主管部门，全面推进 ESG 与责任投资活动的整合。

董事会发展战略与 ESG 管理委员会为董事会制定公司发展战略、经营策略及 ESG 战略提供依据，对包括 ESG 在内的中长期发展战略和重大投融资决策进行研究并提出建议，推进 ESG 管理工作规范、高效实行。

ESG 建设领导小组及工作小组是 ESG 工作的决策部门，领导小组下设工作小组。工作小组由各职能部门、业务部门主要负责人和相关工作人员组成。ESG 工作小组负责推进公司 ESG 理念和发展战略的有效结合，促进责任投资机制建设的上下联动，将 ESG 理念融入日常经营。

总经理办公室是统筹推进公司 ESG 建设工作的主管部门，牵头抓总、统筹协调相关工作，主要负责牵头拟定 ESG 建设和责任投资目标、管理政策及考核方案，编制年度 ESG 工作计划，定期向 ESG 建设领导小组汇报完成情况。

此外，资产管理相关的业务部门或子公司设立了专职岗位负责 ESG 研究与投资，持续推进责任投资实践。

海通证券各部门责任投资相关职能设置情况

单位名称	职责权限/相关内容
权益投资部	指定特定研究人员跟踪新能源行业，及时跟进行业发展动态，有针对性地关注有助于“双碳”战略目标实现的上市公司。
衍生产品与交易部	衍生产品与交易部二级部门——衍生产品设计部，负责与场外衍生品业务相关的 ESG 指数的策略研发和指数编制，实时跟踪 ESG 发展趋势并撰写相关材料，设计相关挂钩指数的产品结构，并负责跟踪 ESG 指数发布的

	全流程事项。
固定收益部	固定收益部二级部门——信评及宏观研究部设有 1 名专员负责 ESG 事宜。负责发起部门内 ESG 培训；组织和参与 ESG 相关尽调工作；分析 ESG 产业类意向投资主体的 ESG 指标等信息，研究 ESG 各方面因素，其中包括环境、社会和治理对企业价值的影响；跟踪境内外市场 ESG 最新研究进展，构建并持续优化 ESG 研究思路和框架。
海富通基金	指定量化投资部 2 名人员兼职 ESG 策略研究与事务处理，市场营销部也同时安排 2 名人员兼职协助处理 ESG 相关事务。
海富产业	董事会通过议案承诺每年将划拨不超过当年营业收入 0.5% 且不高于 50 万元用于 ESG 相关投资和治理。

二、负责任投资策略与应用

公司在投资决策过程中考虑 ESG 相关因素，并应用负面剔除、ESG 因子整合、可持续发展主题投资等责任投资策略，推动责任投资理念与公司投资业务有机融合。2022 年，公司围绕 ESG 投资规则的量化和 ESG 策略的迭代更新，保证策略能够创造超额收益的同时，尽可能将 ESG 策略应用到更大的资产管理规模中。

1. 负面剔除策略

适用产品	上市公司股权、固定收益、私募股权、对冲基金和另类投资
应用情况	<ul style="list-style-type: none"> 公司各业务部门和子公司根据《海通证券股份有限公司 ESG 风险管理办法（试行）》《海通证券股份有限公司（集团）客户 ESG 尽职调查指引》及相关配套文件，通过 ESG 尽职调查、核查 ESG 评级等多维度对投资标的进行投前核查，对于可能存在高 ESG 风险的标的进行限额控制。 公司权益投资部设定严格的“股票池”纳入标准，在投资前就把 ESG 高风险股票排除在外，剔除标准包括：商誉资产占比过高、大股东股票质押数量占比过高等。

2. 正面筛选策略

适用产品	上市公司股权、固定收益、私募股权
应用情况	<ul style="list-style-type: none"> 根据《海通证券股份有限公司权益类证券及其衍生品自营业务风险管理办法》《海通证券非权益类证券及其衍生品投资交易业务管理办法》，公司权益投资部、固定收益部要求投资备选库内标的必须符合《海通证券股份有限公司 ESG 风险管理办法（试行）》有关规定。 子公司海富通基金在入池资产打分模型中设置 ESG 评价条目，包括不限于公司治理情况、管理层稳定性、环保合规情况、在社会责任上的表现等，对于 ESG 表现较好的主体在入池定量、定性评分时会予以加分，以促进对 ESG 优质主体的投资。

3. ESG 因子整合策略

适用产品	上市公司股权、固定收益
------	-------------

应用情况	<ul style="list-style-type: none"> 根据《海通证券股份有限公司权益类证券及其衍生品自营业务风险管理办 法》《海通证券非权益类证券及其衍生品投资交易业务管理办法》，公司权 益投资部、固定收益部在遴选投资标的时将 ESG 因子作为考量标准之一， 对于可能存在高 ESG 风险的客户，在投资交易或收益互换业务累计达到一 定规模时，必须开展 ESG 尽职调查。 子公司海富通基金将第三方 ESG 舆情整合进多因子模型，在优化器中考虑 沪深 300 等基准的 ESG 综合得分，使优化后组合的综合得分优于当期基准。 子公司海通国际在主动管理的投资组合构建过程中融合 ESG 因子分析，剔 除不符合 ESG 标准的股票，增加 ESG 表现优异的公司权重。相关基金管理 规模较初始发行规模均增长并屡获好评。
-------------	--

4. 可持续发展主题投资策略

适用产品	上市公司股权、固定收益、对冲基金和另类投资、私募股权
应用情况	<ul style="list-style-type: none"> 截至 2022 年末，海通证券固定收益部累计投资绿色债券 19.7 亿元，因绿 色债券投资产生的收入约 1,074.17 万元，该收入占部门总收入的 0.51%。 此外，子公司海富通基金累计投资绿色债券 34.97 亿元。 为响应国家“双碳”战略目标，并满足客户多样化理财需求，公司衍生产品 与交易部通过发行挂钩碳中和 ETF 的保本雪球收益凭证，引导投资者对绿色 金融产品进一步关注。截至 2022 年末，已累计发行 164 期，累计名义本金 5,962 万元，其中 61 期已成功敲出提前结束，为投资者带来较好投资体验。 2023 年 3 月，公司联合中证指数公司正式发布“中证海通证券 ESG 股债联 动策略指数（指数代码：931227）”，旨在碳达峰、碳中和政策以及高质 量发展理念引领下，依托该指数丰富“海通指数”以及对应产品体系，并为 践行 ESG 提供良好投资工具。截至 2023 年 4 月末，挂钩“中证海通证券 ESG 股债联动策略指数”的保本看涨收益凭证存续规模 3.5 亿元，占公司发 行的保本型浮动收益凭证存续规模的 32.3%。 子公司海富通基金已推出多只碳中和主题基金，如海富通碳中和主题基金， 该基金成立于 2021 年，截至 2022 年末，总规模达 9.41 亿元。 子公司海通国际先后发行港股市场首支 ESG 主题的 A 股 ETF 及全球首支 ESG 主题的亚洲（除日本外）企业高收益美元债 ETF，涵盖股票和债券等不 同地区不同资产类别，通过追踪指数、融合 ESG 因子，以加强和提高投资 者和上市公司对公司治理以及环境社会责任的关注。

5. 影响力投资策略

适用产品	固定收益
应用情况	<ul style="list-style-type: none"> 截至 2022 年末，海通证券累计投资乡村振兴债、扶贫专项债等 17 亿元。 2022 年 12 月 15 日，公司与中债金融估值中心有限公司合作编制的中债- 海通证券陕川渝国企信用增强债券精选指数正式发布，为投资者参与区域国 有企业信用债市场提供优质便捷的投资工具。同时，指数产品化的业务模式， 降低地方国有企业融资成本，支持陕川渝区域经济高质量发展。

6. 积极股东策略

适用产品	上市公司股权、私募股权
应用情况	<ul style="list-style-type: none">积极行使股东权利，主动、定期与持股企业进行 ESG 议题沟通，通过与高级管理层对话、提交股东大会议案、代理投票等多种方式，引导持股企业积极创造对环境和社会的正面影响，助力持股企业提高 ESG 水平。

三、对外行使投票表决权

1、对外行使投票表决权的决策和行使流程

子公司海通开元投资标的对应项目组对投票方案提出初步建议，通过 PE 业务综合管理系统提交审批流程，经合规风控部、管理层审议后，根据审批意见实施投票。如需进行现场投票表决的，应当根据审批意见填写对投票表决人的书面授权委托书；授权委托书列明授权范围、明确的表决意见、表决理由及授权期限。该投票表决人根据书面授权委托书的内容进行现场表决。

子公司海通创新证券以自有资金对外投资，根据项目需要，海通创新证券派出董事、监事代表公司参加被投资企业的董事会、监事会，派出董事、监事提前向投决会提交相关会议议案及决议事项，按照投决会意见，参加被投资企业的董事会、监事会会议并进行表决。股东代表代表公司参加被投资企业的股东会，原则上应提前向投决会提交相关的会议材料及议案，按照投决会意见，参加被投资企业的股东会并进行表决。

2、对外行使投票表决权时关注 ESG 事项

子公司海通开元积极关注投资标的 ESG 管理水平可能带来的财务影响，如投票方案包含 ESG 相关事宜，则对应项目组积极跟进后续，支持、促进投资对象提升 ESG 治理水平；子公司海通国际在投资决策中积极履行管理权、参与代理投票，并与所投资方保持沟通，旨在促进所投资方可持续发展。

四、责任投资交流与合作

1、ESG 研究与交流

“双碳”目标的提出加速了 ESG 投资在中国资本市场的蓬勃发展，海通证券研究团队专注以碳中和等绿色研究为主的 ESG 研究，持续跟踪研究 ESG 前沿和关键问题，通过撰写研究报告、研究课题、提供咨询服务等 ESG 实践，推动 ESG 生态建设，为企业和相关监管部门提供信息披露依据，为机构与个人投资者提供投资参考，助力国家经济高质量发展。2022 年，海通证券通过提供 ESG 研究咨询累计服务 420 名大中型客户。

海通证券研究咨询服务内容

研究报告或服务	<ul style="list-style-type: none">《对于碳中和，还有什么可以期待？》《绿色能源革命进行时》
---------	---

	<ul style="list-style-type: none"> • 《“碳中和”投资深度透视（上）》 • 《“碳中和”投资深度透视（下）》 • ESG 月报（已发布 11 篇） • 针对“如何设计 ESG 相关产品？”开展研究
研究课题	<ul style="list-style-type: none"> • 上海市政府决策咨询研究项目——《上海打造具有国际影响力的碳定价与碳金融中心建设》 • 央行上海总部 2022 年下半年政策性调研课题——《发展碳金融，完善碳交易市场风险管理功能》
研究机构	<ul style="list-style-type: none"> • 子公司富国基金与上海财经大学联合创立 ESG 研究院

公司积极与相关企业、研究机构、国际组织广泛联系、密切合作，持续推进“双碳”目标下的产业合作、路径探讨、交流活动等，不断扩大金融服务碳中和的技术实力和影响力。2022 年，公司积极参与各类碳中和及绿色金融专题会议，与 ESG 领域专家进行圆桌交流，就国家减碳政策作专业解读。此外，研究所宏观策略、金融工程、固定收益组及相关行业分析师对 ESG 投资热点及相关产品作解读和分析。子公司海富通基金作为“上海市证券期货投资者教育基地”授牌的省级投教单位，依托线上、线下多个影响力平台开展关于 ESG 主题的相关金融服务、金融产品的系列投教工作。

2023 年 4 月，公司衍生产品与交易部参加中证指数公司举办的 ESG 主题系列研讨会。培训主题为“以绿色助力中国高质量发展——中证 ESG 主题系列研讨会”，以中证 ESG 评价体系和指数体系服务国家战略，推动落实中国高质量发展。参会人员部门晨会传达此次研讨会的主要内容，并就如何高效践行 ESG 理念、加强 ESG 能力建设等展开探讨。

2、ESG 合作

公司积极参与 ESG 投资沟通及交流活动，践行 ESG 投资理念，树立负责任投资形象。在中国金融学会绿色金融专业委员会 2021 年年会上，子公司海富通基金与多位学者及多家机构共同签署《北京 ESG 投资（基金）生态倡议》，积极参与 ESG 投资相关标准、政策、制度的研究和制定工作。2021 年 9 月，子公司海富通基金加入联合国责任投资原则组织（UNPRI），承诺将在其六项责任投资原则指导下，挖掘对环境和社会产生长期积极影响的投资机会，也表现出公司践行 ESG 投资策略的决心。