

交银国际资产管理有限公司

气候相关风险管理披露文件

证券及期货事务监察委员会（证监会）于 2021 年 8 月 20 日向持牌法团发出关于基金经理管理和披露气候相关风险的通函，要求管理集体投资计划的基金经理在其投资和风险管理过程中考虑气候相关风险并作出适当的披露。我们了解到投资者非常关心我们的投资和风险管理办法，以下是交银国际资产管理有限公司（下称「交银国际资管」）在管治、投资和风险管理流程中纳入气候相关风险考虑的具体办法：

管治

交银国际资管董事会（下称「董事会」）已任命气候相关风险管理工作小组（下称「工作小组」），以负责领导和监督交银国际资管在气候相关政策和投资策略的执行。董事会负责监督将气候相关考虑纳入投资和风险管理的流程，并监督针对解决气候相关事宜而订立的目标的进展情况。

工作小组主要负责领导和监督气候相关政策和投资策略的执行，并最少每半年召开一次会议以密切监察有关进度。工作小组的具体工作内容包括把气候相关风险考虑因素纳入投资和风险管理流程的制定和实施的统筹工作、制定和审查内部监控程序、监督气候相关风险管理状况及进度、分配足够的人力资源和技术资源以便适当地执行管理气候相关风险的职务等。工作小组会就处理气候相关事宜订立及审查目标并制定行动计划、设立完善的内部流程、监测有关气候相关问题的行业发展及监管要求的变化以确保遵从有关的监管规定，并至少每年一次向董事会报告气候相关问题。相关责任人员则应定期向工作小组成员汇报管理气候相关风险的工作情况及进度。

投资管理

在投资分析的流程中，交银国际资管投研团队会为所管理的每项投资策略及每只基金进行气候相关风险关联性 & 重大性评估。对于气候相关风险有关联性及重大性的投资策略及基金，交银国际资管投研团队会对持仓每半年做一次气候相关风险评估，并由交银国际资管风险合规小中台收集及将评估结果汇报至工作小组。在投资策略或基金的气候相关风险被评估为无关联的情况下，交银国际资管会披露这些例外情况，并备存适当的纪录以解释为何气候相关风险并无关联，同时定期进行重新评估。

风险管理

交银国际资管将使用适当的工具、指针和数据库为每项有关联性及重大性的投资策略及基金识别、评估、管理和监察气候相关实体风险和转型风险。在识别及评估气候相关风险方面，我们会透过考虑投资目标的特征（例如所属行业及地理位置等因素），以及这些特征可能涉及的潜在实体风险及转型风险，利用内部的气候风险评分系统以了解基金所承受的气候相关风险。根据评估，我们会留意持仓的风险分布，分析基金是否无意中偏向于高潜在气候相关风险。在管理及监察气候相关风险方面，掌握及分析以上风险识别及评估的结果后，我们会考虑设立适当的管理措施，并定时对相关风险及投资目标进行监察，以减轻及控制投资所涉及的气候相关风险。

交银国际资管将至少每年检视一次披露内容并及时更新披露内容，保证所披露的数据与气候相关风险在投资及风险管理流程中被考虑到的程度相称。如有任何重大变更，会通过交银国际资管的官方网站尽快告知投资者。如果有任何疑问，请联络我们 qrc_am@bocomgroup.com。