

## 交銀國際資產管理有限公司

### 氣候相關風險管理披露文件

證券及期貨事務監察委員會（證監會）於 2021 年 8 月 20 日向持牌法團發出關於基金經理管理和披露氣候相關風險的通函，要求管理集體投資計劃的基金經理在其投資和風險管理過程中考慮氣候相關風險並作出適當的披露。我們了解到投資者非常關心我們的投資和風險管理辦法，以下是交銀國際資產管理有限公司（下稱「交銀國際資管」）在管治、投資和風險管理流程中納入氣候相關風險考量的具體辦法：

#### 管治

交銀國際資管董事會（下稱「董事會」）已任命氣候相關風險管理工作小組（下稱「工作小組」），以負責領導和監督交銀國際資管在氣候相關政策和投資策略的執行。董事會負責監督將氣候相關考慮納入投資和風險管理的流程，並監督針對解決氣候相關事宜而訂立的目標的進展情況。

工作小組主要負責領導和監督氣候相關政策和投資策略的執行，並最少每半年召開一次會議以密切監察有關進度。工作小組的具體工作內容包括把氣候相關風險考慮因素納入投資和風險管理流程的制定和實施的統籌工作、制定和審查內部監控程序、監督氣候相關風險管理狀況及進度、分配足夠的人力資源和技術資源以便適當地執行管理氣候相關風險的職務等。工作小組會就處理氣候相關事宜訂立及審查目標並制定行動計劃、設立完善的內部流程、監測有關氣候相關問題的行業發展及監管要求的變化以確保遵從有關的監管規定，並至少每年一次向董事會報告氣候相關問題。相關責任人員則應定期向工作小組成員匯報管理氣候相關風險的工作情況及進度。

#### 投資管理

在投資分析的流程中，交銀國際資管投研團隊會為所管理的每項投資策略及每隻基金進行氣候相關風險關聯性及重大性評估。對於氣候相關風險有關聯性及重大性的投資策略及基金，交銀國際資管投研團隊會對持倉每半年做一次氣候相關風險評估，並由交銀國際資管風險合規小中台收集及將評估結果匯報至工作小組。在投資策略或基金的氣候相關風險被評估為無關聯的情況下，交銀國際資管會披露這些例外情況，並備存適當的紀錄以解釋為何氣候相關風險並無關聯，同時定期進行重新評估。

#### 風險管理

交銀國際資管將使用適當的工具、指標和數據庫為每項有關聯性及重大性的投資策略及基金識別、評估、管理和監察氣候相關實體風險和轉型風險。在識別及評估氣候相關風險方面，我們會透過考慮投資標的特徵（例如所屬行業及地理位置等因素），以及這些特徵可能涉及的潛在實體風險及轉型風險，利用內部的氣候風險評分系統以了解基金所承受的氣候相關風險。根據評估，我們會留意持倉的風險分布，分析基金是否無意中偏向於高潛在氣候相關風險。在管理及監察氣候相關風險方面，掌握及分析以上風險識別及評估的結果後，我們會考慮設立適當的管理措施，並定時對相關風險及投資標的進行監察，以減輕及控制投資所涉及的氣候相關風險。

交銀國際資管將至少每年檢視一次披露內容並及時更新披露內容，保證所披露的資料與氣候相關風險在投資及風險管理流程中被考慮到的程度相稱。如有任何重大變更，會通過交銀國際資管的官方網站盡快告知投資者。如果有任何疑問，請聯絡我們 [qrc\\_am@bocomgroup.com](mailto:qrc_am@bocomgroup.com)。