

朱雀基金管理有限公司

负责任投资准则

(1.0 版, 2022 年)

2022 年 10 月

目 录

第一章 总则.....	1
第二章 负责任投资指导原则和承诺.....	1
第三章 适用范围.....	2
第四章 负责任投资的组织架构.....	2
第五章 负责任投资政策的实施.....	2
第六章 气候倡议.....	3
第七章 合作与发展.....	4
第八章 信息披露和宣传推广.....	4
第九章 附则.....	4

第一章 总则

第一条 为规范朱雀基金管理有限公司（以下简称“公司”）负责任投资活动，加强公司负责任投资体系建设，促进公司“可持续创造价值”愿景实现，根据国家相关的法律法规、部门规章、自律规则和监管要求以及朱雀基金有关制度，参照联合国责任投资原则组织（“UNPRI”）发起的负责任投资原则的规定，制定本准则。

第二条 “负责任投资”是指除关注投资对象的财务表现外，还将它们的环境（“E”）、社会责任（“S”）以及公司治理（“G”）等相关因素纳入投资决策和积极所有权的投资策略和实践。将 ESG 因素整合到现有的投资过程有助于增强长期的风险收益、更好地保护客户利益并促进企业与社会的可持续发展。

第三条 在实施负责任投资准则的同时，公司应当遵循“投资者利益最大化”的原则，贯彻长期投资、价值投资理念，强化风险控制，专业、严谨、务实地分析和处理 ESG 相关风险，为投资者可持续创造价值。

第四条 公司所有涉及负责任投资的相关部门与人员应当遵守该准则，并用以指导各相关资产组合的投资活动。

第二章 负责任投资指导原则和承诺

第五条 公司在实施负责任投资的过程中应当遵循以下指导原则：

（一）ESG 整合：公司将 ESG 因素融合到投研决策与投资分析过程。在包含权益资产的投资中，在行业选择和个股选择中应将 ESG 因素纳入考量。

（二）积极所有者：公司从维护投资者利益和实现可持续发展出发，通过提交相应股东建议、行使投票表决权等方式推动企业可持续发展和履行企业社会责任；

（三）报告负责任投资原则的实施情况和进展：公司应当定期向投资者及相关负责任投资组织报告其在负责任投资上的进展。

第六条 负责任投资承诺：公司认同践行负责任投资是承担社会责任的最好方式之一，承诺在投资活动中积极践行负责任投资原则，致力于通过在投资实践中履行积极所有者

原则，引导社会资金流入“碳中和”概念等符合 ESG 投资原则的上市公司。公司承诺将 ESG 因素融入投资决策与分析、风险评估等环节，持续成为资产的积极所有者，公司将积极地与国内外负责任投资机构合作，共同倡导和推定长期、可持续的 ESG 投资理念。

第三章 适用范围

第七条 公司负责任投资准则适用于所有的资产类别。公司相关投资决策和研究等人员应当在研究分析、投资决策与风险管理层面考虑 ESG 因素，对相关 ESG 因素开展深入研究与分析。公司各相关部门应当在负责任投资实践中提供必要的工作支持和履行相应职责。

第四章 负责任投资的组织架构

第八条 公司全面开展负责任投资工作，将负责任投资准则充分融入管理与投资流程。负责任投资的组织架构包括以下三个层级：总经理办公会、ESG 委员会和所有相关部门。

第九条 公司总经理办公会负责审定负责任投资相关制度和承诺，提供纲领性指导和对 ESG 项目及负责任投资的监督，听取并审定 ESG 委员会提供的负责任投资报告。

第十条 公司 ESG 委员会是总经理办公会的下设机构，负责制定公司层面的负责任投资原则和战略，组织和协调相关部门开展负责任投资相关工作，组织撰写负责任投资相关报告，推进公司负责任投资有序发展。

ESG 委员会由公司产业与直销客户服务部分管高管牵头开展工作，成员包括公募投资部、专户投资部、研究部、产业与直销客户服务部、风险管理部、财务行政部等部门相关人员，具体人员组成由公司总经理办公会决定。ESG 委员会应以不低于年度的频率总结公司负责任投资政策的执行进度并向总经理办公会报告。

第十一条 公司所有相关部门，包括但不限于研究部、公募投资部、专户投资部、产业与直销客户服务部、风险管理部、财务行政部等相关部门选派专人，负责公司负责任投资政策的具体实施，承担与其工作职能相关的负责任投资工作。

第五章 负责任投资政策的实施

第十二条 负责任投资政策的实施：公司应在整个投资与管理过程中贯彻负责任投资理念，成为积极的资产所有者、开发 ESG 主题相关产品并持续增强负责任投资能力。公司秉承可持续发展、长期投资、价值投资理念，在追求长期投资收益的同时积极承担企业社会责任。

第十三条 ESG 整合：公司全面地将 ESG 因素纳入投资分析中，在投资研究决策过程中，考虑 ESG 因素对投资对象的潜在影响与风险，通过积极与国际、国内的专业机构开展合作，建设和持续完善公司 ESG 评价体系。

第十四条 积极所有权：公司通过直接沟通、行使投票表决权等股东权力和积极持股等方式来促进投资对象的可持续发展。在与投资对象沟通时，公司积极分享和倡导负责任投资价值观和理念，沟通其 ESG 风险和机遇，对其相关信息披露及公司治理实践进行指导和改善。引导投资对象创造可持续的 ESG 效益，推动投资对象持续改善 ESG 表现。

第十五条 泛 ESG 主题产品：公司通过发行负责任投资或泛 ESG 主题产品来贯彻负责任投资政策，在相关产品的投资理念和投资方法中整合和推行 ESG 因素。

第十六条 营销宣传：公司通过多种渠道和方式向客户宣传负责任的投资理念，在为客户谋取可持续投资回报的同时，履行社会责任和创造社会效益。

第十七条 投资能力建设：公司定期组织负责任投资相关培训，邀请专业机构开展培训交流以提高员工的负责任投资意识，加深对负责任投资政策和方法的理解，推进负责任投资实践，持续提升公司负责任投资能力建设。

第六章 气候倡议

第十八条 应对气候变化是 21 世纪全人类的重大挑战，需要各国根据其国情，共同携手加速推动绿色低碳转型和气候技术创新。中国于 2016 年签署《巴黎气候变化协定》，并在 2020 年做出了“二氧化碳的碳排放力于 2030 年前达到峰值，努力争取到 2060 年前实现“碳中和””的承诺。2021 年 9 月 22 日，中共中央、国务院联合发布了《关于完整准确全面贯彻新发展理念做好碳达峰碳中和工作的意见》（以下简称“《意见》”）。公司认识到《巴黎气候变化协定》及《意见》的重要性，并将在《意见》指导下，密切

关注最新的气候变化问题。公司逐步将气候变化、气候风险等因素纳入投资决策流程及研究评价体系。公司将持续关注碳达峰、碳中和相关的投资机会、积极开展该主题产品的研发，同时积极减少自身的碳排放。

第七章 合作与发展

第十九条 公司积极参与国内外的负责任投资会议与论坛，与倡导负责任投资原则的公司合作，与同业共同推动负责任投资的发展。广泛的国际合作有助于开拓公司的视野，加强负责任投资的交流，同时提高公司自身的相关研究与投资能力。公司积极寻求与负责任投资领域领先的专业机构合作，探讨负责任投资方法与应用，梳理和总结负责任投资的研究成果和相关实践经验，持续推动公司内部负责任投资框架的搭建和完善。

第八章 信息披露和宣传推广

第二十条 公司重视负责任投资的报告与相关披露，公司定期向客户和 PRI 报告和披露公司负责任投资相关实践及进展等情况。

第二十一条 公司通过官网、官微等平台积极宣导负责任投资理念，积极参加负责任投资相关奖项评选、行业交流和各种形式的绿色低碳公益活动，促进负责任投资的广泛推广和实践。

第九章 附则

第二十二条 本准则未尽事宜，按照国家有关法律法规、部门规章、自律规则或监管要求、公司其他制度的规定执行，若与届时修订的法律法规、部门规章、自律规则或监管要求冲突的，以届时修订的法律法规、部门规章、自律规则及监管要求为准。

第二十三条 凡未按照法律规定及/或本准则执行的，公司将依据《朱雀基金管理有限公司差错管理办法》《朱雀基金管理有限公司合规问责管理办法》等规定予以处罚。

第二十四条 本准则由 ESG 委员会负责解释与修订，经公司总经理办公会审议通过，自发布之日起施行。