



中信保诚资产管理有限责任公司

2022 年度社会责任报告

目 录

一、公司概况.....	3
1.1 公司简介.....	3
1.2 股东介绍.....	4
1.3 党建引领公司发展.....	5
1.4 利益相关方沟通.....	6
二、为股东：完善治理 贡献可持续价值.....	7
2.1 公司治理、信息披露.....	7
2.2 风险管理.....	9
2.3 经营表现.....	11
三、为客户：谋价值.....	12
3.1 服务客户.....	12
四、为员工：聆听需求筑成长成才平台.....	14
4.1 员工关爱和员工保障.....	14
4.2 职业发展，拓宽员工发展通道.....	15
4.3 工作环境.....	16
五、为环境和社会：肩负企业使命 创造社会价值.....	16
5.1 服务国家发展战略.....	16
六、绿色金融.....	18
6.1 绿色投资.....	18
6.2 绿色金融机制建设.....	18
6.3 绿色金融投资实践.....	19
6.4 ESG 报告关键绩效指标统计表.....	20

一、公司概况

1.1 公司简介

中信保诚资产管理有限责任公司（以下简称“中信保诚资管”或“公司”）系中信保诚人寿保险有限公司全资子公司，注册资本 5 亿元人民币，注册地为北京。公司于 2019 年 12 月 16 日获得中国银保监会开业批复，于 2020 年 3 月 31 日正式成立。

2022 年，面临国内外经济环境严峻复杂、不确定性等多重因素影响，公司坚持高质量发展，坚守风险底线，较平稳地度过了市场底部颠簸期，全年经营和运行情况良好。在管理方面，公司重点优化管理体系和完善组织构架，优化团队建设和提升专业能力；在业务方面，公司立足寿险母公司资金，开展资产管理业务，通过优化资产配置和品种投资策略，提升投资业绩。

未来，公司将秉承“专业化运作、市场化经营、精细化管理、差异化竞争”的发展思路，以“服务全面、创新发展、经营稳健、特色突出”为目标，努力打造优质保险资产管理公司。



公司大事记

2020 年 3 月，北京市朝阳区市场监督管理局向中信保诚资管颁发营业执照，中信保诚资管正式成立；

2021 年 1 月，中信保诚资管首次获得信用风险管理能力和股票投资管理能力；

2021 年 12 月，中信保诚资管首次获得衍生品运用管理能力（股指期货）和债权投资计划产品管理能力，取得组合类保险资管产品发行管理业务资格；

2022 年 3 月，中信保诚资管变更营业地址至北京市朝阳区东三环北路乙 2 号 1 幢 10 层 01 单元 1001、9 层 01 单元 901。

1.2 股东介绍

中信保诚人寿保险有限公司

中信保诚人寿保险有限公司（以下简称“中信保诚人寿”）成立于 2000 年，由中国中信集团和英国保诚集团联合发起创建。目前，中信保诚人寿总部设在北京，公司的注册资本为 23.6 亿元人民币。截至 2022 年底，公司总资产达 2,166 亿元。

股东：中国中信金融控股有限公司 英国保诚集团股份有限公司

成立时间：2000 年

注册资本金：23.6 亿元人民币

资产规模：总资产 2166 亿元（截至 2022 年底）

主体信用评级：AAA（中诚信国际、联合资信）

经营评价：2021 年度保险公司法人机构经营评价“A 类”

中信保诚人寿秉承“聆听所至，信诚所在”的经营理念，自成立以来，中信保诚人寿倾心聆

听客户心声，不断推出符合客户需求的产品和服务，覆盖寿险、疾病、医疗、意外、财富管理等多个领域。截至目前，公司已设立了广东、北京、江苏、上海、湖北、山东、浙江、天津、广西、深圳、福建、河北、辽宁、山西、河南、安徽、四川、苏州、湖南、无锡、陕西、宁波、青岛等 23 家分公司，共在 100 个城市设立了近 200 家分支机构。2020 年 3 月，公司设立全资子公司中信保诚资产管理有限责任公司。

中信保诚人寿将用心聆听各方的心声，竭诚服务客户，努力回报社会，开拓进取，不断创造新的辉煌。

1.3 党建引领公司发展

在上级党委的坚强领导下，中信保诚资管党支部深入学习贯彻习近平新时代中国特色社会主义思想及党的二十大精神，始终坚持党的领导与完善公司治理相结合，充分发挥党建引领作用，认真履行全面从严治党主体责任，加强党的各项建设，凝心聚力，持续提升企业综合竞争实力。

一是加强政治建设，全面落实管党治党政治责任。坚决落实中央、中信集团和中信保诚人寿党委决策部署，公司成立之初即将党建写入公司章程，贯彻落实民主集中制，规范党支部前置研究讨论“三重一大”事项，持续加强党的领导，积极在新冠肺炎疫情防控中践行党组织政治责任。

二是强化理论学习，着力提升党员干部思想理论素质。突出习近平新时代中国特色社会主义思想、党中央文件和上级党委工作部署的学习贯彻，切实提高党支部学习质量，扎实抓好全体党员干部的学习教育，进一步强化年轻干部的理论学习。

三是贯彻新时代党的组织路线，严格组织生活。中信保诚资管党支部认真落实“三会一课”制度，推进公司高质量发展，坚持内部选用与外部引进相结合、加强关键人才队伍建设。扎实推进党支部建设全面进步、全面过硬，发挥党员模范作用，严格党员管理。

四是持续正风肃纪，营造风清气正的良好政治生态。加强纪律教育、强化规矩意识，认真组织学习《中国共产党纪律处分条例》，发挥“大监督”格局作用、强化日常监督，抓小抓好日常监督，加强党风廉政建设。

五是加强群团工作和企业文化建设，凝聚发展合力。坚持党建带团建，成立团支部和资管公司工会，充分发挥工会、共青团组织联系及桥梁作用，推进企业文化建设，增强党员、职工的凝聚力、战斗力，激发干事创业热情。



1.4 利益相关方沟通

利 益 相 关	响	应沟通方式	关注议题
---------	---	-------	------

股 东	定期/不定期会议、工作汇报；依法依规履行信息披露义务；切实防范关联交易风险	公司治理 诚信透明 风险管理 合规管理
员 工	分层分类的员工培训 丰富多元的员工活动	员工权益保障 职业发展规划 薪酬福利提升 健康和谐的工作环境
政府与监管机构	现场拜访，电话、传真、邮件沟通，电子政务传输系统进行公文对接，参加会议，接受检查，汇报工作	履行社会责任 应对自然灾害或紧急事务
供应商	邮件，电话，面谈，微信、会议	通过加强线上线下办公方式，构建绿色办公体系

二、为股东：完善治理 贡献可持续价值

2.1 公司治理、信息披露

股权结构、实际控制人

中信保诚资产管理有限责任公司成立于 2020 年 3 月 31 日，由中信保诚人寿保险有限公司发起创建。中信保诚资管治理结构主要依照《中华人民共和国公司法》《中华人民共和国保险法》《保险资产管理公司管理暂行规定》建立和完善。公司设有董事会、监事会、董事会下设专业委员会及管理层，充分尊重并坚决落实董事会领导下的总经理负责制。

公司股权结构如下：

序号	股东名称	持有出资额（人民币/元）	出资比例
1	中信保诚人寿	500,000,000	100%
合计	--	500,000,000	100%

公司仅有唯一股东中信保诚人寿保险有限公司（即实际控制人），因此未设立股东会，根据监管要求建立了“三会一层”公司治理结构，即完善的董事会、监事会及经营层管理机制。

“三会一层”相关制度

公司治理在实际运行中参照经中国银保监会核准批复的《公司章程》《董事会议事规则》《监事会议事规则》，经公司董事会审批通过的《股东承诺管理办法》《专委会会议事规则》《董事、监事履职评价制度》《董事会、监事会相关事务工作流程规范》等相关公司治理制度。

“三会一层”构成及相互制衡情况

自成立以来，公司不断推动权责清晰、决策科学、有效制衡、激励适度的公司治理架构的形成和完善。董事会下设4个专业委员会，分别为提名与薪酬委员会、审计与风险管理委员会、战略与投资委员会、关联交易控制委员会；经营层下设6个委员会，分别为投资管理委员会、风险管理委员会、投资项目评审委员会、关联交易控制委员会、信息化工作委员会、产品管理委员会。公司治理机制有效发挥了制衡功能。

报告期内，公司严格遵守《保险公司信息披露管理办法》以及资金运用信息披露准则等相关文件的要求开展信息披露工作，并进一步完善信息披露管理制度体系，促进信息披露工作合规、有序开展。2022年度内，公司在官方网站“公开信息披露”板块基本信息、年度信息、专项信息、重大事项、其他信息披露公告约56条，对公司概况、公司治理概要、信息披露等栏目进行持续更新，并配合公司股东做好信息披露有关工作，为客户和公众提供真实、准确、充分的信息。

董事会监事会召开情况

截至2022年末，公司共召开4次董事会现场会议、7次董事会书面会议。主要就2022年经营计划、自有资金配置计划、重大关联交易、开展资产支持计划产品发行业务、开展股权投资计划业务、董事会授权、公司基本政策、薪酬方案、聘请年报审计会计师事务所等38项

议案进行审议审批，主要就经营管理报告、战略与投资委员会报告、审计与风险管理委员会报告、关联交易控制委员会报告、提名与薪酬委员会报告等共计 28 项报告事项予以审议指导。2022 年，公司共召开 5 次监事会现场会议、2 次监事会书面会议。主要就 2021 年监事履职评价报告进行审批，并主要就财务情况及财务工作计划、审计情况及审计工作计划、监事履职工作情况、监管评级结果等 10 项报告事项予以监督指导。

董事监事履职情况

截至 2022 年末，公司董事会共有 5 名在任董事，其中执行董事 1 人，全体董事能够克服疫情等不利影响，勤勉履职，积极出席董事会及其专业委员会等各项会议，出席率 100%；能够投入足够的时间履行职责，及时了解本公司业务经营管理，维护本公司利益，推动本公司履行社会责任，符合董事履职的各项监管要求。

截至 2022 年末，公司监事会共有 3 名在任监事，其中职工监事 1 人。全体监事能够克服疫情等不利影响，勤勉履职，积极出席监事会会议、列席董事会会议及尽可能的列席各项董事会专业委员会会议；各位监事均能够投入足够的时间履行职责，监督本公司财务活动、风险管理、内部控制、内部审计等重要工作，维护本公司利益，推动本公司履行社会责任，符合监事履职的各项监管要求。

2.2 风险管理

2022 年，百年变局和世纪疫情相互交织，世界进入新的动荡变革期。面对外部诸多不确定性因素，以及国内防范和化解系统性金融风险遇到的困难和挑战。公司坚决贯彻落实党和国家政策要求，以党的二十大精神为引领，深刻领会党中央关于国内外形势的分析研判，遵循监管规定和保险资金运用规律，结合中信集团风险管理和母子公司并表管理等要求，基于“1+3”委托合作协议，保持母子公司“五个一致性”原则，以公司战略和风险战略为导向，以风险偏好管理为核心，坚持“稳字当头、稳中求进”工作总基调，资金运用规模稳步

增长、投资范围逐步扩大、产品结构不断丰富，充分发挥“三道防线”风险防控协同作用，积极防范和化解重点领域资金运用风险，守住了信用风险零容忍、市场风险降波动和操作合规内控不发生“三个重大”的合规风险底线，坚持以“平衡风险与收益”“风险管理创造价值”的风险管理思维，持续完善全面风险管理体系建设，持续优化资产负债匹配，力争实现“资本、风险、价值、社会责任”的平衡稳健发展，实现 2022 年度经营目标和风险目标的双收官。

公司风险治理体系持续完善，整体运行良好

中信保诚资管构建了由董事会负最终责任、监事会有效监督、高级管理层直接领导，以风险管理部门为依托，相关业务部门密切配合，覆盖所有业务及流程的风险管理与内控组织体系。明确公司治理层面、业务部门及各岗位的风险与内部控制责任，确保风险管理的独立性。同时建立了以风险管理为核心的三道防线，各司其职、各负其责。董事会下设 4 个专委会，管理层下设 6 个专委会，并设立若干专业工作小组。公司风险管理各专业委员会、各职能部门和业务单位，按照相关要求履行相应的风险管理责任，各司其职、各负其责。风险治理体系进一步完善，整体运行良好。

公司风险偏好体系运行良好，风险水平整体可控

中信保诚资管不断探索并建立健全以风险偏好为核心的现代风险管理机制，构建并不断完善全方位、多层次、统一协调的风险偏好体系，涵盖公司面临的主要风险。2022 年，公司紧密围绕监管要求和公司经营目标，持续深化重点风险领域偏好指标体系建设，通过全面重检修订各层级指标，明晰了风险偏好体系在内外部管理要求的传导路径，通过各层级指标勾稽呼应，深化落实风险偏好在公司内部“三道防线”的有效传导；坚持公司精细化管理要求，持续完善第四层级一般风险指标体系，指标设定紧密结合市场走势，指标敏感度明显提高，加强了对上层指标的风险预警和防护功能；强化风险穿透化管理，积极应对实体经济绿色转型需要，探索并践行绿色金融风险管控，强化跨周期经营稳定性的风险管理要求，持续强化风险偏好的引领作用；整体来看，公司风险偏好体系总体运行平稳，各项监管指标全部符合

监管要求，风险偏好体系得以有效遵循，风险水平整体可控，守住了合规经营红线、守住了信用风险和市场风险总体容忍度底线，守住了不发生“三个重大”合规底线。

以全面风险管理体系为基础的投资能力建设稳步推进，风险管理能力持续提升

中信保诚资管按照党和国家大政方针政策，以及银保监会《保险资产管理公司管理规定》《偿二代二期监管规则》和母子公司并表管理等相关要求，坚持母子公司“五个一致”原则，提升风险识别的全面性、风险计量的统一性、风险监测的穿透性和风险管控的及时有效性，以资本为纽带，以偏好为核心，强化风险协同与风险防火墙建设，优化风险识别、评估、计量、控制、监督和报告的全流程管理，建立健全母子公司全面风险管理体系和协作机制，确保将风险控制在公司总体目标相适应并可承受的范围之内。公司在母公司的全面风险管理体系框架下，建立符合自身业务特征的全面风险管理体系，包括风险偏好、风险管理组织、政策、流程、技术和文化体系等，并将风险偏好有效传导至其各级经营管理活动中。

截至 2022 年 12 月 31 日，公司获得信用风险管理能力、股票投资管理能力、债权投资计划产品管理能力、衍生品运用管理能力（股指期货），已启动股权投资计划产品管理能力建设筹备工作；公司获得组合类保险资管产品业务资质。公司将投资能力建设及应用工作与发展规划相结合，不断提升公司资产管理能力，增强核心竞争力。

2.3 经营表现

2022 年国内经济发展环境严峻复杂，面临“三重压力”，叠加新冠疫情反复，地缘冲突、欧美通胀压力，市场波动明显加剧，多次进入“类危机模式”。公司坚持高质量发展，坚守风险底线，较平稳地度过了市场底部颠簸期，全年经营和运行情况良好：

业务规模持续提升：公司受托及合作资产 2,013 亿元，较年初增长 18%。

价值与利润稳步增长：营业收入 2.74 亿元，业管费支出 1.37 亿元，实现净利润 1.04 亿元。

风险管理能力不断夯实：2022 年，公司风险偏好有效遵循，守住了信用风险零容忍和不发生“三个重大”的底线。公司按照“1+3”委托合作协议，在中信保诚人寿并表管理基础上，坚持母子公司“五个一致”原则，在母公司全面风险管理体系框架下，建立自身的全面风险管理体系，包括风险偏好、风险管理组织、政策、流程、技术和文化体系等。同时，建立了以风险管理为核心的三道防线，公司各部门各司其职、各负其责，将风险偏好有效传导至其各级经营管理活动中。

能力建设实现突破：截至 2022 年末，公司获得股票投资管理、信用风险管理、衍生品（股指期货）运用管理、债权投资计划产品管理 4 项投资管理能力，并取得组合类保险资管产品发行管理业务资格。2022 年，公司共发行产品 11 只，规模共计 73.46 亿元，产品管理、运行平稳。公司将投资能力建设及应用工作与发展规划相结合，不断提升公司资产管理能力，增强核心竞争力。

三、为客户：谋价值

3.1 服务客户

中信保诚资管充分发挥险资长期资金的优势，借力集团协同发展战略，为服务国家重大战略、助力实体经济、践行企业社会责任作出贡献。

专业化投研能力，稳健的资产管理能力，为客户谋效益

公司坚持“优选交易主体、优选底层资产、优选交易结构”原则，从源头把控风险，提升业务获取、产品创设、风险识别和管理能力，更好地为客户做好资产配置。

组合类产品方面，公司已初步形成了资产差异化、风险收益特征阶梯分布的产品线，产品类型涵盖流动性产品、传统固收产品、“固收+”产品、“FOF”产品、行业主题类权益产品、混合类产品等。2022 年，公司新设立产品 11 只（含专项产品 1 只），产品规模 67.47 亿元，

产品开发、管理、运作平稳顺利。

债权类产品方面，2022 年 11 月，公司首单保债产品“中信保诚-四川港投基础设施绿色债权投资计划”在保险资产管理业协会成功登记，产品以最高等级（G-1）标准获得中诚信绿金认证。该产品以“绿色保债、绿色产业、绿色投资”为核心，充分发挥险资长期资金的优势，为客户提供资金支持，是公司服务国家“双碳”战略的具体体现。2022 年，公司债权投资计划业务运作管理情况正常，公司已具备较为完善的债权投资计划产品运营管理能力和经验。

未来三年，公司将继续围绕“中长期资管与理财产品供应商”的战略定位，一方面，立足寿险母公司配置需求进行产品发行，不断丰富产品类型、提升业务能力，从资产端为寿险公司发展和战略转型提供有力支撑；另一方面，面向市场提升产品开发和管理能力，积极申请试点开展第三方业务，多渠道拓展资管业务，提升业务获取、产品创设、风险识别和管理能力，促进产品发行业务市场化转型。秉承以客户为中心的理念，持续向客户提供有竞争力的产品与服务，为客户创造价值。

中信保诚资管为首批支援上海抗疫的保险资管公司之一

在上海疫情期间，中信保诚资管为缓解上海建工集团投资有限公司（以下简称“上海建工”）和上海城投控股股份有限公司（以下简称“上海城投”）复工复产的资金压力，多次与两家公司进行线上沟通、为其定制融资方案，成为首批支援上海抗疫的保险资管公司之一。

上海建工所属集团上海建工集团股份有限公司是中国建筑行业先行者、上海城市基础设施建设的主力军，疫情期间承担了上海方舱建设的重要任务；上海城投的控股股东上海城投（集团）有限公司，是上海市重要的城市基础设施运营主体和重大项目投资建设主体。

深入实施集团“五五三”战略，搭建业务协同常态化机制，为客户提供多维服务

中信保诚资管通过与集团内公司协同，为客户提供多维、深入的服务。与中信银行协同并建立常态联动机制；在中国中信金融控股有限公司总体安排下与中信证券、中信信托等机构协作，拓宽项目获取渠道，并对集团重点客户进行协同营销；配合寿险母公司对非标客户进行

团险产品的营销。

四、为员工：聆听需求筑成长成才平台

保障员工权益；完善员工及家属福利；关爱员工身心健康；拓宽员工发展通道。

4.1 员工关爱和员工保障

中信保诚资管人力资源管理制度完备，在制订涉及员工切身利益的规章制度时，严格按照法律规定，广泛征求员工意见，履行法定民主流程。在人员招聘、晋升、调动、薪资、解雇等相关工作中，严格遵循国家劳动法律法规和公司内部流程，不存在种族、社会等级、国籍、宗教、身体残疾、性别等方面的歧视行为。



公司薪酬体系体现了外部竞争性、内部公平性和激励性的原则，薪酬福利主要由基本工资、津贴福利、年度绩效和长期激励构成。薪酬分配原则是通过适度提高固定工资水平，保证员工基本收入；通过合理调整绩效工资占总薪酬比重，充分激励员工；通过企业年金和团体保险，给予员工附加退休保障和医疗保障；不断激励提升各层级人员的绩效表现，从而推动公司稳健发展。

公司按时足额为员工缴纳法定社会保险，严格遵循国家倡导的稳定就业政策，实行人性化的用工管理制度，公司在给予带薪年假、婚假、产假、护理假、育儿假等法定假期的基础上，公司人性化地设置了年资假、全薪病假，并允许法定年假部分递延到次年享受，注重保障员工合法休息和休假权利。公司员工队伍稳定，离职率低于行业平均水平。

4.2 职业发展，拓宽员工发展通道

中信保诚资管持续为员工发展打造良好的职业平台和成长通道，通过多种方式的人才培养和培训培养项目，不断满足不同层次、不同类别员工的职业发展需求，满足企业经营人才脱离职场进行知识沉淀的实际需求，强化企业核心人才的专业化素养。

公司为员工提供多种培训、考试机会，选派员工积极参与股东方、监管机构、行业协会等组织的培训，包括中保协人才发展高峰论坛、中青年干部培训班、中信卓越培训班等，同时鼓励员工参加增强职业能力的考试，为通过 CFA、FRM 等专业考试的员工报销相应考试费用，并专门为备考员工提供带薪备考假期，保障员工充分的复习与休息时间。



4.3 工作环境

中信保诚资管于 2022 年 3 月 18 日搬迁至中信保诚人寿大厦，公司持续关注员工需求，改进和升级办公环境，让员工在工作期间感受舒适及便利。公司为员工提供的舒适的座椅、宽敞明亮的办公空间、先进的通信技术以及良好的空气质量。此外，公司也为员工提供了一系列便利设施，例如休息区、茶水间和健身房等，让员工在繁忙的工作之余得到放松和休息，公司也鼓励员工在工作之余进行适度的运动，以保持身心健康。



五、为环境和社会：肩负企业使命 创造社会价值

中信保诚资管用心聆听社会需求，积极参与公益事业，并将保险资金运用于服务国家发展战略上，切实支持实体经济发展。

5.1 服务国家发展战略

中信保诚资管资产端注重发挥寿险资金运用的特点与优势，致力于提升服务实体经济与国家战略质效。一是通过跨周期进行地方政府债券配置，在优化资产负债匹配的同时支持地方财政；二是通过债权计划、信托计划、资产支持计划、公募 REITs 等工具，积极支持国家重大项目建设与重大战略实施，为适度超前开展基础设施投资提供长期资金支持；三是通过直接或间接股权投资持续加大科技创新领域的支持力度，重点加强对于高端制造业、专精特新企

业的投资布局。四是坚持长期投资、价值投资理念，发挥保险资金长期稳定的优势，助力资本市场结构完善与效率提升。

2022 年，中信保诚资管继续通过债券、债权、股权等方式积极服务实体，支持重大基础设施和民生工程建设，支持国企混改及中小企业融资。截至 2022 年 12 月末，公司向实体领域投资规模达到 651 亿元，较年初增长约 93 亿元。地方债投资上，截至 2022 年 12 月末，公司非投连持仓国债/地方债约 194 亿元，较去年同期下降 6.21%，继续支持地方经济发展。非标债权投资上，截至 2022 年 12 月末，公司非标债权投资中约 179 亿元资产投向了城镇化建设、轨道交通、创新扶贫、普惠金融、农村基础设施改造、国家“双碳”战略等实体经济领域，较去年同期持平，在风险可控的前提下，继续实现保险资金与实体经济的良性互动。股权投资上，截至 2022 年 12 月末，公司直接与间接投资的股权项目中有约 126 亿元投向包括医疗、养老大健康、新能源、科技创新、基础设施等实体经济领域，较去年同期上升 26.00%，切实以长期资金支持国家经济战略转型，改善实体经济融资结构。股票投资上，截至 2022 年 12 月末，公司股票投资（不含战略投资）市值约 153 亿元，较去年同期上升 108.57%，其中工业、可选消费、信息技术、能源、材料等实体领域占比较高，公司股票投资坚持价值理念，以深度研究为支持，助力资本市场稳定与效率提升。

2022 年以来，公司进一步完善了服务实体经济方面的制度保障，梳理资金运用行业投向政策，明确加大对基础设施、新能源、先进制造等实体经济领域支持力度。

在支持国家战略，补齐基础设施短板方面，公司拟投项目中铁建基础设施股权基金已通过评审，并提交投资决策，本次投资是公司与中信系股权投资基金在重大基础设施投资领域协同合作的示范，深化中信集团产融并举、协同发展战略的同时，还进一步发挥了保险资金在“支持基础设施建设、区域发展、乡村振兴”等国家中长期战略发展中的重要作用。此外，公司已投资中铁保定基础设施项目、厦门建发会展中心项目，支持国家城镇化建设，补充基础设施短板方向。

在助力先进制造业方面，目前正在推进的项目：屹唐半导体基金已经完成协议签署，中信杭州城西科创大走廊股权基金已经完成第一笔出资、中金瑞盈基金正处于投资期内。其中中信杭州城西科创大走廊股权基金是中信集团为进一步落实落地落细集团“十四五”规划和“五五三”战略布局，充分发挥中信集团综合经营和资本运作优势，拓宽多元融资渠道，加速战略投资平台搭建，做好协同，助力集团布局战略新兴产业，实现高质量发展而设立的基金，基金直接或间接投向于先进制造、先进材料、生命健康、人工智能、云计算大数据、信息软件、互联网+、集成电路等领域。

在实现绿色环保方面，中信建投宁德润信基金已完成全部实缴出资，公司出资共计金额 4.95 亿元。本基金主要投向新能源电池上游产业链，助力国家双碳战略。此外，公司已投资广州产投项目（资金用途包括绿色清洁能源方向）、深能源潮州燃气热电联产基础设施项目以及中信保诚-四川港投基础设施绿色债权投资计划符合国家双碳战略。

六、绿色金融

6.1 绿色投资

近年来，中信保诚资管在受托母公司中信保诚人寿资产的驱动下，不断探索绿色投资新路径，创新具有保险特色的绿色投资方式。发挥保险资金优势，面向环保、新能源、节能等领域的绿色项目，为我国经济向绿色化转型提供融资支持。公司积极贯彻落实国家战略，大力投资碳中和相关领域，积极服务实体经济绿色转型。截至 2022 年末，公司绿色金融投资规模达到了 75.58 亿元，主要投向水电、光伏、风电、储能等清洁能源产业，以及绿色交通、能效提升、污染防治、节能环保等行业。

6.2 绿色金融机制建设

公司积极践行新发展理念和国家“双碳政策”要求，2022 年 2 月，根据国家经济工作会议精神和政策方针，明确提出“2022 年，公司投资将深入贯彻党中央、国务院经济工作会议

精神以及监管机构政策导向要求，落实碳达峰、碳中和目标导向，支持绿色金融；调整存量资产分布，压缩退出落后产能、高风险行业项目，在符合公司整体风险偏好的条件下，积极跟进“十四五”规划明确的国家级重大项目；积极支持煤电油气等基础能源供给，电信、航空等基础网络运营项目；积极支持战略性新兴产业、高端制造业投资等产业基础再造工程项目，积极支持实体经济，ESG、绿色能源项目等”，并发布《2022 年行业投向指引和项目审查审批要点》。公司遵循监管和集团要求，基于 ESG 基础数据和主流机器学习方法构建了 ESG 评分卡，对 A 股上市公司进行 ESG 评价，实现行业内和跨行业的 ESG 表现比较，该评分体系的建立也为后续基于个股 ESG 表现构建 ESG 风险管理策略奠定了基础。同时，公司积极开展绿色金融相关专题研究，2022 年主要完成《ESG 评级体系及应用研究报告》、《银行业保险业绿色金融指引政策解读及工作方案》、《基于随机森林方法的 ESG 评分卡构建的研究报告》等。

6.3 绿色金融投资实践

案例一：华泰-潮州燃气热电联产基础设施债权投资计划

2022 年 4 月，投资华泰-潮州燃气热电联产基础设施债权投资计划，金额为 5 亿元。投资项目为潮州深能凤泉湖高新区燃气热电联产项目和深能潮安 2×100MW 级燃气热电联产工程项目。项目均为清洁能源项目，采用清洁的天然气作为燃料，是现代化环保型电厂。项目建成后解决区内能耗高、污染大的问题，节能减排；同时向潮州市区供电，解决潮州市区仅有小水电、缺乏稳定主力电源问题，提高城区供电可靠性。投资项目对优化地区能源结构，促进低碳经济、改善生态环境将产生积极的影响，为潮州市科学发展、绿色发展创造有利条件。

案例二：中信保诚-四川港投基础设施绿色债权投资计划

2022 年 12 月，发行中信保诚-四川港投基础设施绿色债权投资计划，已投资金额 6 亿元，资金主要用于岷江龙溪口航电枢纽工程项目。该项目是一座以航运为主、结合发电，兼顾防洪、供水、环保的的综合性枢纽工程，对于促进长江经济带发展和加速融入成渝地区双城经济圈具有重要意义，项目已纳入交通运输部水运“十三五”发展规划和四川省“十四五”综

合交通运输发展规划。项目建成后，预计每年水力发电 20.20 亿千瓦时，每年可减排二氧化碳 115.56 万吨，替代 61.11 万吨标准煤，绿色环保效益显著。

6.4 ESG 报告关键绩效指标统计表

中信保诚资产管理有限责任公司 2022 年环境类关键绩效指标统计表

关键绩效指标				未披露原因或其他备注
指标项目			2022 年 (总量)	
KPI A1.3: 有害废弃物	有害废弃物	 (请根据实际情况分类列明主要有害废弃物情况)	0	不涉及
A1.4:无 害废弃物	无害废弃物	 (请根据实际情况分类列明主要无害废弃物情况)	0	不涉及
A2.1:能源 消耗	直接能源 总耗量	煤炭(吨)	0	中信保诚资产管理有 限责任公司为金融类 企业，没有此项消耗
		天然气(立方米)	0	中信保诚资产管理有 限责任公司为金融类 企业，没有此项消耗
		(其他，请列明)	0	中信保诚资产管理有 限责任公司为金融类 企业，没有此项消耗
	间接能源 总耗量	电(千瓦时)	69454.34	
		汽油(公升)	0	不涉及
		柴油(公升)	0	中信保诚资产管理有 限责任公司为金融类 企业，没有此项消耗
		石油液化气(公升)	0	中信保诚资产管理有 限责任公司为金融类 企业，没有此项消耗
		(其他，请列明)	0	中信保诚资产管理有 限责任公司为金融类 企业，没有此项消耗

A2. 2:耗水量	间接用水耗水量(吨)	购买的自来水	0	不涉及
		购买的可饮用水		
A2. 5:	制成品所用包装材料总量(吨)	(请列明具体种类)	0	本年度未产生包装

中信保诚资产管理有限责任公司 2022 年社会类关键绩效指标统计表

关键绩效指标				未披露原因或其他备注
指标项目			2022 年	
健康与安全	因工死亡人数及占比 （该项需报送 2019、2020、2021、2022 每年的数据）		-	中信保诚资产管理有限责任公司为金融类企业，不会因工作产生健康与安全问题。
	因工伤损失工作日数		-	中信保诚资产管理有限责任公司为金融类企业，不会因工作产生健康与安全问题。
发展及培训	全年所有培训人次 不同类型员工占比 （%）	男性	45.22%	
		女性	54.78%	
		高级管理层	4.34%	
		中级管理层	13.91%	
	全年所有培训时数 不同类型员工完成 受训的平均时数（小时）	男性	-	根据目前公司培训情况，因各部门主动参加培训覆盖维度、广度不同，暂无法统计男、女参训时数
		女性	-	根据目前全公司培训情况，因各部门主动参加培训覆盖维度、

				广度不同，暂无法统计男、女参训时数
		高级管理层	52	
		中级管理层	-	根据目前全公司培训情况，因各部门主动参加培训覆盖维度、广度不同，暂无法统计中层管理人员参训时数
供应链管理	按地区划分的供应商数目	（请根据实际情况填写地区）	无	按照公司的采购制度，大额采购采用招标的方式确定供应商
			无	按照公司的采购制度，大额采购采用招标的方式确定供应商
产品责任	因安全或健康等原因回收产品的百分比（%）		不涉及	
	接到的关于产品及服务投诉数目		不涉及	
社区投资	扶贫投入资金（元）		0	
	其他公益捐助资金（元）		0	