

# 2021

## 南方基金 ESG投资报告

---

/ 长期投资 / 价值投资 / 责任投资 /



# 目录 / CONTENTS

|                   |    |
|-------------------|----|
| 领导致辞              | 03 |
| 走进南方基金            | 05 |
| 数说2021            | 07 |
| 年度荣誉              | 09 |
| 支持联合国可持续发展目标      | 10 |
| 专题:关注气候变化,坚持碳中和实践 | 11 |

|         |    |
|---------|----|
| 附录      | 65 |
| 利益相关方列表 | 65 |
| 报告编制说明  | 66 |
| 联系方式    | 66 |

# 01

## 持之以恒 坚守ESG投资

|         |    |
|---------|----|
| ESG投资管理 | 17 |
| ESG解决方案 | 19 |
| ESG风险管理 | 29 |

# 02

## 以客户为中心的 长期价值创造者

|           |    |
|-----------|----|
| 丰富的投资解决方案 | 33 |
| 打造基金经理队伍  | 36 |
| 加快数字化转型   | 37 |
| 提升金融可获得性  | 39 |
| 维护客户权益    | 42 |

# 03

## 高质量管理 致力高质量发展

|         |    |
|---------|----|
| 党建引领    | 45 |
| 公司治理    | 46 |
| 稳健运营    | 46 |
| 保护知识产权  | 47 |
| 隐私和数据安全 | 48 |

# 04

## 绘就可持续 发展新篇章

|        |    |
|--------|----|
| 携手员工成长 | 51 |
| 推动绿色发展 | 56 |
| 参与社区共建 | 62 |

# 领导致辞

## 做变局中的主动者，开创我们共同的未来

COVID-19 流行、极端气候变化、地缘政治冲突加剧等正在深刻影响着我们的生活，可持续发展目标任务愈发紧迫。国际组织、多国政府、负责任企业以及越来越多人开始积极行动。

资本市场作为资源配置的枢纽、连接未来的桥梁，在推动可持续发展的过程中扮演着重要角色。政策和长线资金形成合力，引领 ESG 投资在全球范围内蓬勃发展，ESG 正在成为影响资产定价的关键因素之一：据全球可持续投资联盟（GSIA）预测，2025 年 ESG 资产规模预计超 53 万亿美元，意味着在 2020 年 35.3 万亿美元的基础上增长 51%。

秉持人类命运共同体理念和责任，顺应时代发展的内在趋势，中国正全方位积极拥抱 ESG，有望成为推动全球 ESG 发展的重要力量。近年来，我国连续发布的碳达峰碳中和、教育公平、共同富裕、乡村振兴、养老体系建设等顶层设计，与 ESG 理念中的多个议题高度契合，为 ESG 投资提供了广阔的市场空间；碳达峰碳中和“1+N”政策体系陆续建成，其中明确提出要积极发展绿色金融；2022 年 4 月，中国证监会发布《关于加快推进公募基金行业高质量发展的意见》，将发展 ESG 投资列为公募基金行业高质量发展的内涵之一。新时代是高质量、可持续发展的时代，新时代的新目标对我国资管行业践行 ESG 投资提出了更新、更高的要求。

南方基金服务客户超 24 年，我们始终将为客户、社会创造价值作为一切业务的原点，致力于通过数智化转型提升核心能力，为时代问题提供专业的资产管理解决方案。自 2018 年加入联合国责任投资原则组织（PRI）以来，我们在投资全链条中持续推动贯彻可持续发展原则，以 ESG 投资重塑价值创造的基石。在 ESG 本土化实践过程中，我们一方面对标国际标准，借鉴先进经验，另一方面，我们在“创新、协调、绿色、开放、共享”新发展理念引领下，聚焦中国 ESG 核心问题，重视 ESG 投资本土化创新。在《南方基

金 2021 年 ESG 投资报告》披露之际，我将向您介绍南方基金在 ESG 投资方面取得的重点进展：

### • 加强数智融合，为更具韧性的价值创造提供支撑

ESG 投资将环境、社会和治理指标纳入考量，建立一套超越单纯财务数据的评估框架，以更多元、更敏锐的触角，预警尾部风险，识别潜在机遇，从而优化投资组合的风险收益比，提高价值创造韧性。2021 年，我们通过外部数据采集和 AI 算法等手段完成了覆盖 4500+ 家 A 股上市公司与 6364 个发债主体的 ESG 自评级体系与数据库，涉及 17 个主题、39 个子主题、115 个子类评选指标。在具体指标选取和赋权上，我们根据 ESG 议题对社会的重大性和关联性进行差异化处理和动态调整，以保证 ESG 因子选股有效性与时效性。可靠的 ESG 数据库成为了 ESG 投研融合的先决条件，为实现后续“应用—完善—升级—革新”的良性循环奠定基础。

举例来说，针对国内发债主体信息披露标准不统一、ESG 数据缺乏等难点，我们自建并不断完善固定收益 ESG 评价体系。凭借 ESG 评级体系的覆盖度、适配性以及创新性等优势，2021 年“南方基金管理固定收益纳入 ESG 整合”入围 PRI “负责任投资奖”新兴市场方向，获得了国际权威认可。

### • 当好积极股东，做上市公司高质量发展的伙伴

除了在构建投资组合中纳入 ESG 因素，作为“专业买方”，我们还基于信托义务，从 ESG 议题切入，通过行使投票权、沟通对话等方式，践行积极股东策略，引导被投企业改善公司治理、加强风险管理、拓宽战略空间，进而提升上市公司的可持续价值创造能力。

在行使投票权方面，2021 年，我们既“用手投票”，也“用脚投票”，

累计在 2010 个持有人会议投票中开展了 ESG 影响评估；在沟通对话方面，针对气候变化等 ESG 具体议题，我们借鉴国际标准，主动向上市公司提出参考与建议。例如，经过历时一年多、数轮沟通辅导后，在南方基金推动下，某央企煤炭龙头建立了较完善的气候变化管理工作机制与人员配置，公开披露了双碳目标的承诺和实施路径。该公司的“转型路径倡议”（Transition Pathway Initiative, TPI）气候变化风险管理评级于 2021 年度提升一级。

#### ● 顺应产业趋势，科学有序提升绿色投资比例

双碳战略将系统性改变行业竞争格局，为绿色低碳等战略新兴产业注入了新的活力，并带来了丰富的投资机遇。在双碳目标引领下，我们立足长期投资、价值投资，顺应低碳发展趋势，继续科学有序提升绿色投资规模，引导资金进入低碳转型企业以及符合可持续发展导向的行业，助力实现资本、科技和实体经济的高水平循环。截至 2021 年底，南方基金旗下产品绿色投资总规模约达 2321 亿元，较年初增加 129%。

#### ● 优化金融供给，形成多层次 ESG 产品体系

公募基金的一个重要作用是联接资本市场和普通投资者。2021 年，南方基金继续丰富 ESG 产品供给，推出了包括绿色投资、科技投资方向的各类创新产品，引导资金流向绿色转型、科技攻关等战略新兴行业，逐步形成多层次的 ESG 产品体系，从而满足客户多元化投资需求。在绿色投资方面，我们发行并成立南方中证新能源 ETF、南方新能源产业趋势基金、南方中证长江保护主题 ETF 等；在科技投资方面，我们布局了中证科创创业 50ETF、北交所主题基金、专精特新主题基金等。

#### ● 全方位助力国民养老，保障社会可持续发展

一方面，夯实财富储备是应对人口老龄化、保障社会可持续发展的重要基础；另一方面，养老金长期特征与避险特征和 ESG 投资的目标高度契合，决定了养老金适合进行 ESG 投资的属性。2021 年，

南方基金继续依托多年积累的养老金管理经验、专业的投研团队、丰富完善的产品体系、严谨的风控体系以及完善的智能投顾技术等，全方位助力国民养老体系建设。特别是，经过近四年的成熟运作，我们基本探索出以养老 FOF 为代表的、适合中国国情的第三支柱解决方案。随着养老第三支柱各项工作向前推进，南方基金将继续贡献积极力量。

除了上述 ESG 投资工作之外，在自身发展中，南方基金也以系列实际行动贯彻 ESG 理念：包括打造质量管理体系、践行以客户利益为中心的经营理念、携手员工共成长、融入湾区建设、助力公益事业、支援应急救援、抗击新冠疫情等举措。

投资是对未来的无尽探索，也是主动开创未来的一种方式。ESG 投资是难而正确的事，仍有很长的路要走，南方基金呼吁更多同仁关注支持 ESG 投资，通过持之以恒共同努力，勾勒可持续发展蓝图，赢得我们共同的未来！

南方基金管理股份有限公司

总经理 杨小松




# 走进南方基金

## 公司简介

南方基金管理股份有限公司（简称“南方基金”）成立于 1998 年 3 月 6 日，是中国证监会批准的国内首批规范的基金管理公司。总部设在深圳，北京、上海、深圳、南京、成都、合肥六地设有分公司，在深圳和香港设有子公司——南方资本管理有限公司（深圳子公司）和南方东英资产管理有限公司（香港子公司）。南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构；南方资本下设南方股权子公司，主要从事私募股权投资业务。

## 愿景与使命

南方基金以打造“值得托付的全球一流资产管理集团”为愿景，秉承“为客户持续创造价值”的使命，坚持“客户、诚信、共享、奋进”的核心价值观，根植于时代，领先于市场。以客户需求为导向，以价值创造为核心，以产品创新为引擎，坚持“长期投资、价值投资、责任投资”的投资理念，历经了中国证券市场多次牛熊交替的长期考验，以持续稳健的投资业绩、完善专业的客户服务，赢得了广大基金投资人、社保理事会、年金客户和专户客户的认可和信赖。

新时代、新理念，践行社会责任是南方基金义不容辞的担当，南方基金作为国内最早推动 ESG 投资的机构之一，持续搭建和完善 ESG 管理架构、评价体系，深度融入公司投资管理实践。我们将争做 ESG 投资的引领者，与亿万客户和资本市场各方携手共创可持续、共富裕的美好未来！

## 企业文化

南方基金以“托付南方，成就梦想”为品牌口号，秉持四大管理理念，不断巩固行业文化建设成果，深刻践行“合规、诚信、专业、稳健”八字方针，为公司和行业的长期健康发展提供价值引领和精神支撑。

## 组织参与



联合国  
责任投资原则组织

签署方

作为负责的机构投资者，南方基金承诺在做出投资决策时遵循 ESG 议题的相关标准，采纳六项责任投资原则，并鼓励所投资的公司遵守和践行 ESG 的要求。



可持续蓝色经济金融倡议

签署方

南方基金成为国内首家签署此倡议的公募基金公司，承诺遵循可持续发展蓝色经济的十四条原则，支持 SDG 第 14 项目标水下生物多样性的实现。



中国 ESG 领导者组织

理事会成员

南方基金与该组织其他商业领袖企业共同推进建立适合中国的 ESG 评价标准体系，促进中国资产管理行业 ESG 投资发展。



气候行动 100+

签署方

作为气候行动 100+ 的签署方，南方基金促进全球最大的 161 家温室气体排放企业采取实际行动关注气候变化问题，实施健全的治理框架以应对气候变化风险，并提升信息披露质量。



气候变化相关  
财务信息披露工作组

支持机构

南方基金基于 TCFD 对气候变化管理的框架要求，开展治理、战略、风险管理、指标和目标等工作构建，探索将气候变化风险因素融入投资策略和组合风险管理。



CDP 全球环境信息研究中心

签署方

南方基金作为 CDP 的签署方，时刻关注气候变化，与海外大型资管机构共同推动企业减少温室气体排放，保护水和森林资源，助力“双碳”目标的达成。



香蜜湖女性董事倡议

首批发起单位

作为香蜜湖女性董事倡议发起单位，南方基金激励上市公司提高女性董事比例，优化上市公司董事会决策效能，将其作为创新治理方式、推动实现性别平等和妇女赋权的重要举措。



气候债券倡议组织

研究支持方

南方基金作为中国最大规模绿色债券投资者之一，参与 2021 年中国绿色债券投资者调研，积极寻求实现绿色债券投资的多元化。

# 数说 2021

## 经济范畴

母公司资产管理规模

单位：亿元



公募规模

单位：亿元



公募基金数

单位：只



客户数

单位：亿户



累计分红数

单位：亿元



绿色投资累计规模

单位：亿元





## 环境范畴

2021 年



温室气体排放  
(范围 1 和范围 2)  
**3,445.3** 吨二氧化碳当量



办公用纸  
**61.32** 吨

## 社会范畴

2021 年



女性员工占比  
**36%**

中层以上  
女性管理者占比  
**21%**



员工股权  
激励计划持股比例  
**8.53%**



员工总数  
单位：人



公益捐赠  
单位：万元



供应商常规审核率  
单位：%

758



2020 年

815



2021 年

243.5



2020 年

412.68



2021 年

100



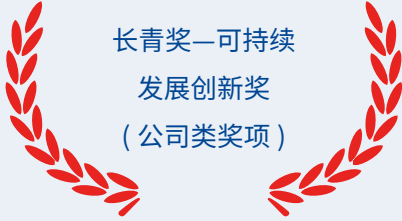
2020 年

100



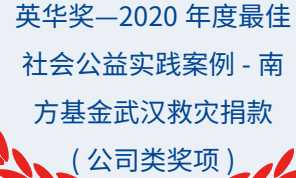
2021 年

# 年度荣誉



长青奖—可持续  
发展创新奖  
(公司类奖项)

《财经》杂志



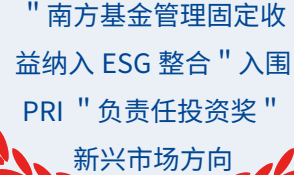
英华奖—2020 年度最佳  
社会公益实践案例 - 南  
方基金武汉救灾捐款  
(公司类奖项)

中国基金报



ESG 业务卓越贡献机构  
(公司类奖项)

中央国债登记结算有限责任公司



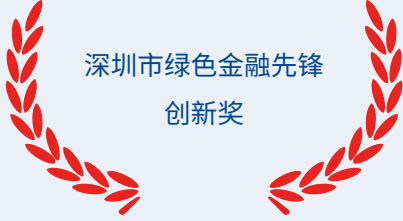
"南方基金管理固定收  
益纳入 ESG 整合"入围  
PRI "负责任投资奖"  
新兴市场方向

UN PRI



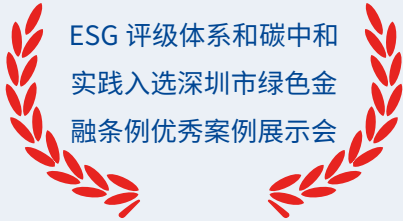
《中国 ESG 投资蓝皮书》:  
中国基金公司 ESG 指数  
行业第一

报告由国务院国资委支持,  
社科院专家团队主编



深圳市绿色金融先锋  
创新奖

深圳经济特区金融学会



ESG 评级体系和碳中和  
实践入选深圳市绿色金  
融条例优秀案例展示会

# 支持联合国可持续发展目标

2021年，新冠疫情持续、极端天气频发、生物多样化面临严峻危机。我们面临贫困、不平等、气候、环境退化、繁荣以及和平与正义有关的全球性挑战，追求美好未来，是人类永恒的主题。联合国提出的17个可持续发展目标是实现所有人更美好和更可持续未来的蓝图，这些目标相互关联，旨在不让任何一个人掉队，在2030年之前实现每个目标，共创永续未来！

探索人与自然和谐相处之路，实现经济社会可持续发展已经成为全人类必须解决的时代命题。为共同创建更美好，可持续的未来，作为连接投资者与资本市场、实体经济的资管机构，南方基金坚定推进ESG可持续投资，高度支持联合国可持续发展目标。

2021年，南方基金开展了一系列联合国发展目标主题的宣传活动。我们发起联合国可持续发展目标调查问卷，希望通过问卷的形式，深入了解公司、员工和社会对可持续发展目标的想法和关注目标，推广可持续发展理念；此外，我们还将联合国可持续发展目标融入公司企业文化，多维度、立体化地助力可持续发展目标的实现，号召员工积极采取行动，共同为消除贫困、保护地球、改善所有人的生活和未来而努力。



## 我们的着重发展目标：

### 从投资的角度，目前南方基金着重于如下目标：

- 目标 3 良好健康与福祉
- 目标 4 优质教育
- 目标 7 经济适用的清洁能源
- 目标 8 体面工作和经济增长
- 目标 9 产业、创新和基础设施
- 目标 10 减少不平等
- 目标 11 可持续城市和社区
- 目标 12 负责任消费和生产
- 目标 13 气候行动
- 目标 14 水下生物

### 从企业公民的角度，目前南方基金着重于如下目标：

- 目标 1 消除贫困
- 目标 3 良好健康与福祉
- 目标 5 性别平等
- 目标 13 气候行动
- 目标 16 和平、正义与强大机构
- 目标 17 促进目标实现的伙伴关系

## 专题

# 关注气候变化， 坚持碳中和实践

近年来，随着可持续理念的持续发酵，气候变化议题在全球范围内获得了高度关注。极端天气、洪水、干旱、山火等事件频发，不仅影响着人们的日常生活，还对企业长期发展前景和全球金融体系的稳定性产生重要影响，环境问题的改善已经成为全人类共同的使命和责任。中国提出“30·60”双碳目标，是基于推动构建人类命运共同体的责任担当和实现可持续发展的内在要求作出的重大战略决策。而南方基金，作为负责任的投资机构，高度重视气候变化议题，积极进行碳中和实践，率先启动碳中和行动，在实现公司运营碳中和的基础上，从加强信息披露、应对气候变化风险识别、多元产品创新、ESG 理念推广多方面发力，降低投资组合气候风险，全面支持并助力国家“碳达峰、碳中和”战略目标的实现。



## 积极实践碳中和行动

南方基金积极承担作为资管机构的减碳社会职责，将绿色低碳发展理念贯穿业务经营发展全过程。

### 形成信息披露长效机制：

南方基金从监管要求和公司实际情况出发，借鉴气候相关财务信息披露工作组（TCFD）所提出的披露建议，细化覆盖治理、战略、风险管理等的全方位披露指标，提升气候相关财务风险信息的披露质量；同时推动基金自身以及投资组合的环境相关信息的披露，推动长期可持续的负责任投资。

### 自建碳排放数据库，提升气候因素对 ESG 评级影响力：

为积极响应“30·60 碳达峰、碳中和”目标，以实际行动推动 ESG 投资理念落地，2021 年，南方基金自建碳排放数据库并将其融入 ESG 评级，通过外部数据采集和 AI 算法等手段完成了对权益投资组合碳排放数据库的测算，精准追踪上市公司的碳排放数据，为投资组合的减排调整提供基础。此外，我们加入 CDP 全球环境信息研究中心，推动企业减少温室气体排放，保护水和森林资源，助力“双碳”目标的达成。

目前，我们已经对投资组合中的权益资产进行碳排放数据跟踪，持续降低投资组合碳足迹，并持续开展与被投资企业的碳中和工作沟通，发挥资管行业作用，助力社会低碳转型和绿色发展。

## 打造多层次 ESG 和气候投融资产品体系：

南方基金按照国际化、特色化、差异化原则，全面探索和践行 ESG 的本土化融合。在此基础上，南方基金加强 ESG 投资中碳减排因素的研究，积极开发相关基金产品，如南方 ESG 主题基金，南方中证新能源 ETF，南方新能源产业趋势基金，南方中证长江保护主题 ETF 等。

## 建立气候风险评估机制：

南方基金在投研流程中加入气候因素的影响分析，采用量化和系统化的方法管理气候风险，并纳入日常投资和经营决策的流程中，进一步细化内部风控的相关规章及手段，实现对机构自身气候风险更有效的管理。

## 促进行业低碳转型：

实现碳中和是经济社会的系统性变革，需要所有主体的共同努力。南方基金积极通过组织参与、重点课题研究、媒体活动等多种方式，发挥机构投资者的影响力，引导资本向低碳创新领域倾斜，促进行业低碳转型。

南方基金通过问卷调查的方式与上市公司沟通，提高上市公司对 ESG 的关注，积极开展减排活动。我们向公司持仓碳排放量最大的 100 家企业发放调查问卷进行调研，深入了解企业温室气体排放情况，提出转型建议，参与公司治理；除此以外，作为 CDP 签署成员，我们还参考 CDP 重点碳排行业问卷模板，与八大重工业行业进行沟通，问卷涉及到气候、水资源、森林三大维度，全方位促进企业进行低碳转型。

## 提升气候变化影响力，构建多层次 ESG 生态圈：

为了促进中国“30·60”双碳目标的达成，构建多层次 ESG 生态圈，南方基金还携手外部机构，共同提升社会各界对气候变化的关注，扩大 ESG 影响力。我们联合外部机构发布《资管行业 TCFD 研究》，梳理全球资管行业借助 TCFD 应对气候变化的方法和实践，持续探索 TCFD 气候相关财务信息披露框架的本土化应用，助力绿色金融发展；作为联合国可持续蓝色经济金融倡议的支持机构，积极参与气候变化课题研究，我们发布了两份气候旗舰报告中文版专题报告，阐述气候风险分析方法和资管行业如何评估相关风险，为气候风险的测算和评估提供实践方法论，促进气候转型；我们牵头《金融科技与碳中和投资融合研究》报告编制，围绕双碳目标下如何将企业碳排放数据成本化，对零碳经济转型过程中的投资标的的价值重估进行研究，该课题还入选深圳经济特区金融学会重点研究课程；最后，作为“气候行动 100+”的签署成员，我们持续推动着全球 161 家主要温室气体排放企业的减排和转型，推进国内绿色经济和可持续发展生态圈的建立。





## 成为中国首家实现运营体系碳中和的资管公司

做好碳管理的第一步是详细摸查自身温室气体碳排放。南方基金建立内部碳排放管理体系，按照国际通行标准对公司运营的碳排放进行核算，并从2020年起实现机构自身运营活动的碳中和（范围一：系所有温室气体的直接排放；范围二：购买的电力、热力或蒸汽消耗产生的间接温室气体排放），成为国内首家实现碳中和的资产管理公司。

2020年，针对范围一使用化石能源产生的直接排放175.1吨二氧化碳当量，南方基金采购并注销了176吨自愿碳减排核证减排量（VCUs），完成了直接排放的全额抵消。针对范围二外购电力6,693.4兆瓦时产生的间接碳排放，南方基金采购并注销了6,694个国际绿证（I-REC），完成了间接排放的全额抵消。

因范围二外购电力产生的碳排放占比达97%，南方基金将在自身的碳排放管理方面，持续推进节能减排措施，通过总部大楼的节能减排设计、租用高效率的数据中心并在公司内部积极推行节能减排举措，加强能源与资源管理，多措并举，持续推进绿色运营。同时，随着碳管理体系的完善，碳中和目标将向范围三（即价值链上下游间接排放）延伸。



01

持之以恒  
坚守ESG投资



ESG投资是指将ESG因素纳入到投资研究、决策的一种投资策略和实践,助力提高投资对象的ESG表现和践行可持续商业实践,是资管行业价值重塑、助力可持续高质量发展的关键切入点。

作为公募基金行业ESG投资的先行者,南方基金成为国内首批成为联合国负责任投资原则(PRI)的签署成员、践行ESG投资理念的资产管理人之一。我们把PRI的负责任投资框架全面纳入ESG投资策略中,建立健全ESG管理框架和流程制度,全方位构建ESG议题风险的评估体系和数据库,以及配套的风险管理机制。在构建投资组合时通过整合法、筛选法、主题法纳入ESG元素,并通过积极所有权提高投资对象的ESG表现,持续探索发挥投资端对实体经济的引导性作用。

践行ESG投资理念,既需要知行合一,也需要持之以恒。在进一步立足资管行业本源的同时,南方基金将继续从多个方面践行ESG投资理念,在为客户创造可持续长期回报的同时,积极推动ESG投资在国内的发展,以实际行动助力社会可持续发展进程。

ESG投资管理 →

ESG解决方案 →

ESG 风险管理 →

# ESG 投资管理

## ESG 投资理念

南方基金始终坚持以“长期投资、价值投资、责任投资”的核心理念为引领，践行可持续性社会责任投资，推进 ESG 投资理念与公司经营、投研、产品布局深度融合。将环境、社会和公司治理方面的因素，补充进以财务绩效为主的传统分析框架中，引导资金流向环境保护、社会公益和公司治理优秀的企业。

作为负责任的机构投资者，南方基金坚定不移地持续深耕 ESG 领域，在为客户创造收益的同时，实现员工、社区和其他利益相关方对更美好、可持续发展未来的期许是我们的首要目标。为此，我们编制了《南方基金 ESG 投资指南》，详细阐述了我们关注的气候变化、员工权益和公正转型、生物多样性、数据安全和数据治理、科技创新、董事会和公司组织架构等重点 ESG 议题，并细化 ESG 投资实践，为公司的 ESG 投资行动和积极持有人策略提供指导，推动绿色投资，助力可持续发展进程。

## ESG 组织架构

南方基金不断完善 ESG 管理组织架构，旨在推动和监察 ESG 投资策略落地。南方基金 ESG 投资的组织架构由以下两个层级构成：

## ESG 领导小组



### 第一层级：ESG 领导小组

ESG 领导小组负责统筹协调公司 ESG 工作建设，牵头落实 ESG 领导小组的各项工作部署，定期审核 ESG 业务进度并制定下一阶段工作重点。

### 第二层级：ESG 工作小组

ESG 工作小组包括固定收益 ESG 融合、权益 ESG 融合、风险管理 ESG 融合、ESG 产品四个工作组，由各资产类别及业务线部门组成，由 ESG 领导小组统筹工作，明确各小组的工作职能，制定相应实施细则，推进 ESG 整合在各资产类别、业务条线和职能部门有效落地。2021 年，南方基金还专门设立了可持续发展部门，作为整个南方基金 ESG 工作的牵头方和推动方，该设置在国内资管行业处于领先地位。

## ESG 解决方案

南方基金各资产类别中，包括权益类及固定收益类产品，均综合使用 ESG 融合、ESG 筛选、ESG 主题投资、积极持有人四大策略。



### 公募基金为助力社会高质量、可持续发展提供资管解决方案

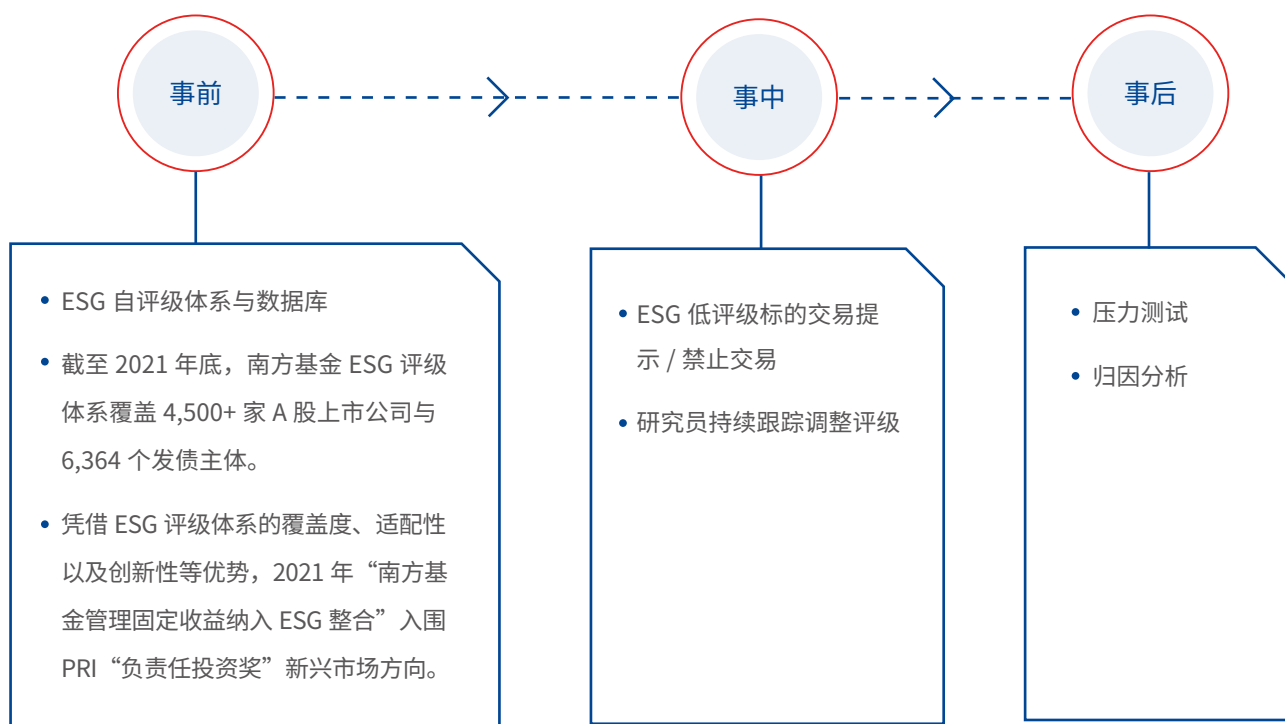
公募基金作为社会上重要的资源配置者，不仅要根植客户需求，同时也要聚焦时代问题，为助力社会高质量、可持续发展提供资管解决方案。立足当下，我们正处于一个社会转型、科技变革与绿色发展的关键时期，投资风险和机会并存，南方基金将持续提升价值创造能力，增强投资组合韧性，以应对不确定中的风险，把握不确定中的机会，携手客户穿越变局，实现客户价值可持续增长。

——南方基金副总经理、首席投资官（固定收益）、ESG 领导小组副组长 李海鹏

## ESG 融合

南方基金构建了“事前+事中+事后”全流程 ESG 投资体系，在股票、固定收益、跨资产类别的投资研究和风险管理中全面融入 ESG 因素，优选各个行业质地优秀、ESG 表现突出、具备长期价值增长潜力的投资标的。

## 南方基金全流程 ESG 投资体系



南方基金自主研发既符合国际标准，又具备中国特色的 ESG 评级体系和数据库，该评级体系涵盖全投资标的，有效支持 ESG 投资的落地，剔除 ESG 风险。目前为止，南方基金 ESG 评级系统包括 17 个主题、39 个子主题、115 个子类评选指标，有效支持了 A 股市场和发债主体的 ESG 投资理念的落地，实现了 ESG 与中国投资逻辑的深度融合。

ESG 评分与投资标的的 ESG 争议项事件评分相结合，得到投资标的 ESG 综合评分。我们通过全面综合的考量，将投资标的发生的 ESG 争议项事件影响划分为不同等级，并针对影响的程度采取相应的措施，例如将影响非常恶劣的投资标的加入禁投池。





多维度 ESG 覆盖

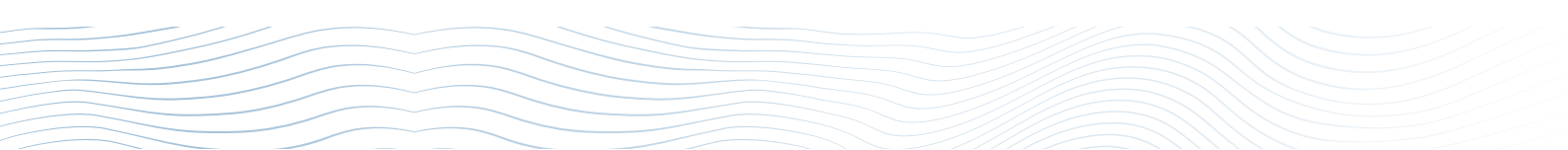


南方基金 ESG 评级系统包括 17 个主题、39 个子主题、115 个子类评选指标。

关注重大议题



定性与定量相结合，选取与基本面投资相关性高且可量化的 ESG 指标，所筛选出的 ESG 有效指标覆盖社会广泛关注的 ESG 议题，突出 ESG 议题对社会的重大性和关联性。



### 智慧技术提升多源数据融合



使用 AI 辅助数据挖掘，并通过金融大数据分析补充 ESG 新闻舆情和重大负面事件，提升 ESG 数据获取的效率和范围，实现多源数据融合。

### 参照行业实质性动态调整



通过对行业的研究和分析，我们对行业实质性进行区分，根据行业实质性对评级体系的指标和权重进行调整，提高 ESG 评级的有效性和准确性。

### 量化模型实现 ESG 理念与投资收益兼顾



南方基金评级体系构建了 ESG 因子评价体系，针对每类 ESG 数据，采用科学的评价模型评估因子的有效性，量化选取投资标的的实质性影响指标。只有那些符合 ESG 投资理念且不降低投资收益的 ESG 指标才会被纳入南方基金 ESG 评级体系，保障投资者投资收益。

### 全面覆盖市面主体评级



截至 2021 年末，实现对 4,500+ 家 A 股上市公司与 6,364 个发债主体（包括国债、地方政府债、信用债等）的 ESG 评级覆盖，是国内目前覆盖面最广的 ESG 评级体系之一。

### 综合外部数据完善评级



为了提升 ESG 评级系统的有效性，推动 ESG 投资理念与南方投资研究的深度融合，南方基金积极扩充 ESG 数据源，并参考外部 ESG 评级对内部评级体系进行完善，并将所有 ESG 评级模块融入研报系统，在公司中央系统进行呈现。

### 评级应用于风控管理



ESG 评级结果融入风控系统，实现投资组合 ESG 风险暴露提示。

### 案例：南方基金固收投资中 ESG 融合策略实施

某港口是我国综合性多功能国际贸易大港，是北方地区货物吞吐量最大的综合性港口。某港口集团是某港口最大的港口运营商，负责某港口多个区域的开发建设和运营，总资产规模超过千亿，外部评级持续维持 AAA。综合考量公司经营实力，南方基金初始评级为 6 级。

在对某港口集团进行跟踪研究分析时，我们发现了某港口集团在公司治理和环境方面存在明显瑕疵。一是在公司治理方面，某港口集团与所在地市国企和关联方存在巨额资金拆借问题，拆借款项总额超过百亿，且资金回收存在重大不确定性。二是在环境方面，2021 年 2 月，中央环保督察组向公司所在市反映情况，某港口集团疏运结构失衡、专用通道缺乏、港口功能布局不合理、风险防范能力不足，出现

5 个油气码头均未安装油气回收装置，区域内油品储运企业未建设事故废水收集系统等问题，某港口的环境瑕疵已经受到监管重视。

综上，固定收益研究部研究员认为此前 ESG 评级虚高，因此将 ESG 评级进行下调，位于可投池临界值，与外部评级 AAA 高评级有显著区别，并将 ESG 调整情况提示基金经理，持续跟踪整改情况，考虑后续是否进一步下调出池。

在下调 ESG 评级后，三个月内某港口集团债券估值显著上行 70BP，固定收益研究部将 ESG 因素纳入持续研究框架，帮助投资避免了估值大幅上行风险。

## ESG 筛选

### ● 负面筛选

我们对有违反过相关国内外法律、禁令、协议记录的企业，以及大规模杀伤性武器等可能对社会造成严重负面影响的投资标的，采取绝对排除的筛选策略，禁止公司各组合买入。此外，我们在公司内部投资风控系统中设置筛选指标，对公司各组合买入低 ESG 评级的股票和债券进行风险提示，禁止公司各组合买入低 ESG 评级或无 ESG 评级的股票和债券，通过负面筛选排除 ESG 表现相对于业内同行较低的投资标的，从而达到交易限制的效果，并防范高 ESG 风险。

### ● 正面筛选

ESG 标准筛选出的高分企业，具有信用品质良好、管理体系完善、发展可持续的特点，在面对如“疫情”等系统性风险时表现出更强的抗压性。因此，我们鼓励基金经理在构建投资组合时运用正面筛选策略，优选 ESG 表现良好的企业，支持具备长期增长潜力的公司。



## ESG 主题投资

ESG 主题投资是指在构建投资组合时，考虑实现特定环境或社会效益，并结合低投资风险的考量，从而促进实现收益的投资。我们重点关注的主题包括：气候变化、公正转型、生物多样性、董事会多样性、可持续蓝色经济等。

在固定收益方面，我们重点关注绿债、疫情防控债券、碳中和债、乡村振兴债等 ESG 主题债券。

## 可持续发展主题投资

### 联合国可持续发展目标

### 南方基金相关投资项目

|  |                                |   |
|--|--------------------------------|---|
| <p><b>3</b> 良好健康与福祉</p>     | <p>确保健康的生活方式，促进各年龄段人群的福祉</p>   | <ul style="list-style-type: none"> <li>南方医药创新股票型证券投资基金</li> <li>南方养老目标日期 2035 三年持有期混合型 FOF</li> </ul>   |
| <p><b>7</b> 经济适用的清洁能源</p>   | <p>确保人人获得负担得起的、可靠和可持续的现代能源</p> | <ul style="list-style-type: none"> <li>南方中证新能源交易型开放式指数证券投资基金</li> <li>南方新能源产业趋势混合型证券投资基金</li> </ul>   |
| <p><b>9</b> 产业、创新和基础设施</p>  | <p>对实现可持续发展至关重要</p>            | <ul style="list-style-type: none"> <li>南方中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金</li> <li>南方科创板 3 年定期开放混合型证券投资基金</li> <li>南方科技创新混合型证券投资基金</li> <li>南方专精特新混合型证券投资基金</li> <li>南方北交所精选两年定期开放混合型发起式证券投资基金</li> </ul> |
| <p><b>12</b> 负责任消费和生产</p>   | <p>确保可持续消费和生产模式</p>            | <ul style="list-style-type: none"> <li>南方新兴消费增长股票型证券投资基金</li> <li>南方中证长江保护主题交易型开放式指数证券投资基金</li> </ul>   |

注：此处仅列举部分产品，并非全部披露

## 绿色投资

南方基金积极响应国家绿色金融发展战略，推动绿色投资，在投资端避免高污染、高耗能行业的投资，支持绿色产业发展。

践行“双碳”目标，重点挖掘新能源方向及碳减排领域的投资机遇，提升“双碳”领域投资力度。

同时，南方基金积极丰富产品供给，推进碳排放产品研发，布局了南方中证新能源 ETF 及联接基金、南方新能源产业趋势混合基金、南方中证长江保护主题交易型开放式指数证券投资基金等。截至 2021 年底，南方基金旗下产品绿色投资累计总规模约达 2,321.30 亿元，较年初增加 1,306.95 亿元，增长 129%，以实际行动助力经济社会的绿色转型。

截至 2021 年底，

南方基金旗下产品  
绿色投资累计总规模约达

**2,321.30** 亿元

较年初增加

**1,306.95** 亿元

增长

**129%**



以实际行动助力经济社会  
的绿色转型。

| 绿色投资产业 <sup>1</sup> | 2021 年规模 (亿元) <sup>2</sup> | 2020 年规模 (亿元) <sup>3</sup> |
|---------------------|----------------------------|----------------------------|
| 节能环保产业              | 1,427.31                   | 628.14                     |
| 清洁生产产业              | 457.50                     | 112.93                     |
| 清洁能源产业              | 1,267.69                   | 279.95                     |
| 生态环境产业              | 465.04                     | 58.81                      |
| 基础设施绿色升级            | 433.38                     | 241.06                     |
| 绿色服务                | 231.86                     | 35.16                      |

<sup>1</sup> 参考《绿色产业指导目录 (2019 年版)》对投资产业进行分类汇总

<sup>2</sup> 规模为截至 2021 年 12 月 31 日的存量规模

<sup>3</sup> 规模为截至 2020 年 12 月 31 日的存量规模

### 案例：支持清洁能源产业发展



某能源互联网企业是全球领先的能源系统企业，掌握特高压输电领域、智能电网相关的核心技术与设备制造能力，同时是节能服务提供商，绿色生态效益显著。

公司投资该企业 2021 年度第二期绿色中期票据（碳中和债）（简称“21 DWGN002”），债券募集资金用于支持多段特高压直流输电工程建设。该工程负责输送大型梯级水电站所发电量，项目建成后促进清洁能源电力消纳，减少二氧化碳和大气污染物排放，其中每年合计减排二氧化碳 77.3 万吨，同时优化全国能源资源布局，满足华中华东电力需求，具有突出的生态和社会效益。

## 绿色投资产品： 南方中证长江保护主题交易型开放式指数证券投资基金

2021年11月26日，南方中证长江保护主题交易型开放式指数证券投资基金成立，首募规模23.71亿元。本基金标的指数为中证长江保护主题指数，该指数从沪港深三地市场中选取100只致力于长江流域生态环境保护的上市公司证券作为样本，聚合长江经济带优质绿色上市公司，凸显生态保护主题。

南方基金推出南方中证长江保护主题交易型开放式指数证券投资基金，吸引了更多市场参与者关注并投资长江大保护相关的上市公司，改善参与长江大保护相关公司的融资环境。通过投资ETF，社会资本可间接与指数成份股公司形成资本纽带，可以更加有效地动员和凝聚各方面力量，加快形成全社会共同参与共抓大保护、不搞大开发的格局，是践行金融支持实体经济、探索长江经济带绿色发展“共抓共赢”新模式的有益创新。



“以ETF为代表的指数化投资是精准实现投资人既定投资目标高效、便捷的投资工具。通过精细化投资管理和运作，ETF或可以为投资人提供低跟踪偏差、匹配基准指数的投资回报。绿色生态文明建设和可持续发展是未来的一个重要发展方向，长江保护主题ETF在主题上符合国家战略方向、顺应时代潮流，是落实ESG投资理念、绿色投资理念的一个重要工具性产品。在这一趋势背景下，未来ESG投资策略给投资组合贡献的超额收益或会愈加显著。”

——南方中证长江保护主题ETF基金经理 龚涛



## 积极持有人策略

南方基金在与被投资企业沟通过程中融合ESG议题，使被投资企业提高对ESG的关注程度，优化其治理结构并构建更良好的生态圈；参与被投资企业所在行业的监管对话，促进和优化行业的可持续发展环境；在与被投资企业沟通无效的情况下，考虑实际情况使用代理否决票。

南方基金始终坚持ESG投资理念，践行积极股东权利，2021年，南方基金明确了基金投资人应该成为积极所有者，将ESG问题纳入所有权政策和实践，通过参与公司治理、委托代理投票等多种方式促进投资对象改善ESG情况。其中，研究员应基于公司投研体系的研究成果，在合法合规的前提下，积极参与改进影响投资标的长期价值创造能力的所有方面，如战略规划、财务绩效、资本结构、公司治理以及可持续性风险和机遇。同时，研究员应在调研中积极推动投资标的充分披露ESG相关议题且在生产运营中将ESG因素纳入考量，评估相关重点关注议题的ESG影响，给出投票建议，提示基金经理进行决策，并记录相关投票信息。

## 参与公司治理

参与是南方基金践行积极持有人策略的重要手段之一。在对上市公司进行调研时，如果发现不利于被投资企业长期可持续发展的因素，南方基金会通过研究员调研、电话会议、电子邮件、信函和询问等方式与被投资企业的董事会、管理层和相关职能部门沟通，提出疑虑和看法，来提升被投资企业对于 ESG 的关注程度，促使他们在 ESG 方面做出积极改变，为利益相关方带来可持续的长期价值。

南方基金参与公司治理的方式：

### 直接参与

南方基金会直接与企业讨论 ESG 问题，以改进其对 ESG 问题的处理。

### 协作参与

南方基金加入多个合作机构，积极签署有助于 ESG 投资的倡议，在与其他股东和利益相关方目标一致时，会采取协作参与的方式参与公司治理。

### 外包参与

南方基金也会将参与活动转包给服务提供商，采取外包参与的方式与企业进行沟通。

## 行使代理投票权

南方基金践行积极持有人策略，积极参与持有人会议并行使代理投票权，在系统自动发起的持有人会议投票流程中，如投票内容包含 ESG 相关内容，则基金经理需要积极参与投票，并在投票中贯彻 ESG 投资理念。截至 2021 年底，共参与 2,010 个持有人会议投票，并开展了 ESG 影响评估。

赞成票数

**1,969** 票



反对票数

**24** 票

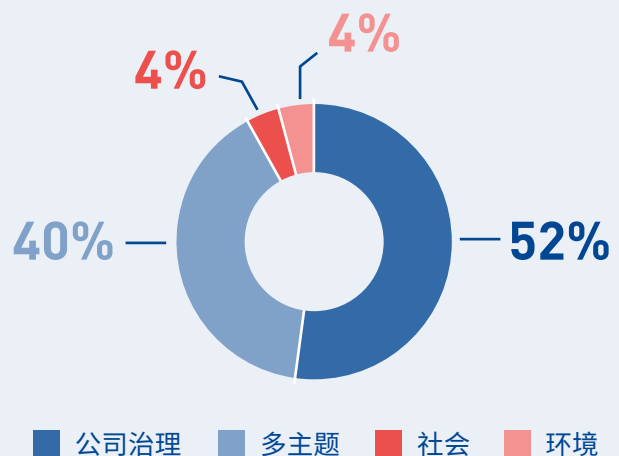


弃权票数

**17** 票



南方基金按 ESG 议题参与发债主体沟通情况<sup>4</sup>



<sup>4</sup>资料来源：2021 年度固定收益部与发债主体沟通记录



## ESG 价值已成国际、国内投资者共识

我深刻感受到 ESG 价值已成为国内和国际投资者的一个共识。在操作层面，对于传统的机构投资者而言，需要把 ESG 因素纳入到基本面分析当中。一方面，ESG 水平较高的企业，治理程度相对更好，中长期的回报率更稳定。另一方面，对于 ESG 的关注能够帮助投资者规避各类风险，尤其在政策风险和融资成本方面。此外，ESG 引领的价值转向也将推动科技创新，带来新一轮的发展和机遇。

——南方基金副总经理、首席投资官（权益）史博



### 案例：南方基金权益投研板块积极持有人

某上市公司为我国石墨电极行业龙头企业，主要产品为石墨电极和炭素新材料，下游应用领域涉及锂电池、光伏等新型能源行业。研究员在对该公司进行调研时，发现公司在环境、社会治理方面存在风险，随后积极与公司进行沟通，促进公司改善 ESG 表现，降低潜在风险。

研究员通过调研了解到公司的主营业务（采矿、炭素生产等）会产生一系列的空气、水资源污染，公司在生产经营活动中产生的废弃物排放可能会对生态环境以及周边社区产生恶劣影响，情况严重的话可能会引起社区居民抗议，阻碍到公司正常的生产经营，进而影响公司营收和价值；另一方面，研究员了解到该公司近两年发生了 11 起气候风险关联事件，被当地政府要求提供环境影响评价报告，其中两起为高影响等级。污染物的过渡排放会引起监管单位的关注，甚至有可能导致行政处罚，影响公司利润。通过研究，我们发现该公司的主营业务进行清

洁能源替代敞口较小，因此，我们和公司进行沟通，建议其通过技术研发，利用相关排污技术对排放的废弃物进行过滤，加以控制，降低对生态环境和周边社区的影响。

此外，研究员还发现需要对该公司在员工薪酬和福利方面的表现进行关注。虽然该公司在员工薪酬和福利体系方面获得了较好的评级，但是近年来由于公司业绩出现下滑，公司的人均创收、人工薪酬等指标出现了一定的下滑。作为一家劳动密集型企业，劳动力管理至关重要，若不提高对于员工薪酬和福利的重视，可能会降低生产经营效率，从而影响到公司的收益。基于此，我们就保护员工权益与该公司进行了沟通，希望企业在转型过程中需更好地兼顾各层级的员工，保障员工福利与培训，尽量保证企业在应对气候变化转型过程中不造成大面积的裁员等发生。

### 案例：南方基金固定收益投研板块积极持有人

某公司为我国中部省份市级城投平台，拟收购 A 上市公司股权并成为该公司实际控制人，由于收购标的触发重大资产重组条款，因此发起持有人会议提请同意该项重大资产重组事宜。在股东大会中，研究员充分考虑 ESG 因素，发现议案中存在社会责任和公司治理瑕疵，损害外部投资者利益，坚定投出反对票，使得最终议案未获通过。

研究员了解到该收购案在发起持有人会议时按约定价格已账面浮亏 25%，由于现金收购金额巨大因此会对现金流造成压力，且 A 公司现金缺口较大，债务迅速增长，预计后续仍将需要输血支持，如收购 A 公司将进一步恶化偿债能力，损害外部债权人的利益。该收购事项反映了该公司对于投资者保护意识淡薄，存在典型的股东侵害债权人利益的代理问题。

此外，研究员了解到本次收购案程序不正当，背后反映公司存在较大的公司治理问题。本

次收购在已完成股份过户后才发起，完全违背了募集说明书中“发行人拟进行重大资产重组时应召开债券持有人会议”的约定。这种无视募集说明书约定的行为，反映了公司在公司治理上存在缺陷。

综上，研究员考虑其在 ESG 方面的负面因素，建议基金经理积极参与投票行使反对权，最终使得议案未获通过。后续进展也验证了研究员对该起收购案存在 ESG 缺陷的判断。一方面，截至 2022 年 2 月 10 日，该起收购案已账面浮亏 36%，A 公司股价较此前进一步下滑。另一方面，2021 年 12 月 A 公司收到监管机构的监管函，指出该次收购事项存在其他信息披露违规现象，ESG 缺陷进一步暴露。

## ESG 风险管理

公司在为客户和投资者持续创造价值的同时，致力于控制 ESG 因素所带来的风险。2021 年，我们制定《南方基金 ESG 投资风险管理制度》，明确了公司各部门 ESG 投资风险管理职责，风险控制委员会负责从整体上控制公司旗下的投资组合 ESG 的投资风险，投资部门是一线的风险控制责任部门，风险管理部和监察稽核部是公司风险控制和合规管理的具体组织和管理部门。

公司通过定期开展 ESG 压力测试，评估公司整体 ESG 风险并进行风险提示；通过 ESG 业绩归因分析，帮助基金经理优化未来 ESG 投资策略；通过风控系统定期开展 ESG 融合情况的跟踪与分析。



#### ESG 监控与提示

风险管理部负责 ESG 风险监控与提示，优化提醒方式与效果，防范长期投资风险。



#### 开展 ESG 压力测试

根据 ESG 内部评级，或第三方外部 ESG 评级，针对以 ESG 投资为策略或主要标的的基金产品，在现有压力测试基础上新增 ESG 因子压力测试。



#### 开展 ESG 业绩归因

跟踪 ESG 投资的实际情况，计算自定义时间内高、中、低 ESG 评分资产的涨跌幅差距；呈现基金经理调整 ESG 因子暴露、选择不同类型 ESG 证券对组合最终业绩的影响，帮助其优化未来 ESG 投资策略。



#### ESG 融合情况分析 与跟踪

持续跟踪 ESG 评级动态，根据不同类型组合的持仓明细并统计各组合所持不同 ESG 评级证券的比例，根据组合持仓情况进行统计分析，并结合持仓的时点和时间序列数据分析我司整体 ESG 融合以及变化情况。



# 02

以客户为中心的  
长期价值创造者



南方基金长期坚持"以客户需求为导向,以价值创造为核心,以产品创新为引擎"这一经营理念,致力推动中国基金业的创新发展,丰富投资方案,强化人才队伍建设,加快数字化转型,维护投资者权益,精诚服务客户,持续探索符合中国资本市场和投资者特点的产品与服务。

丰富的投资解决方案



打造基金经理队伍



加快数字化转型



提升金融可获得性

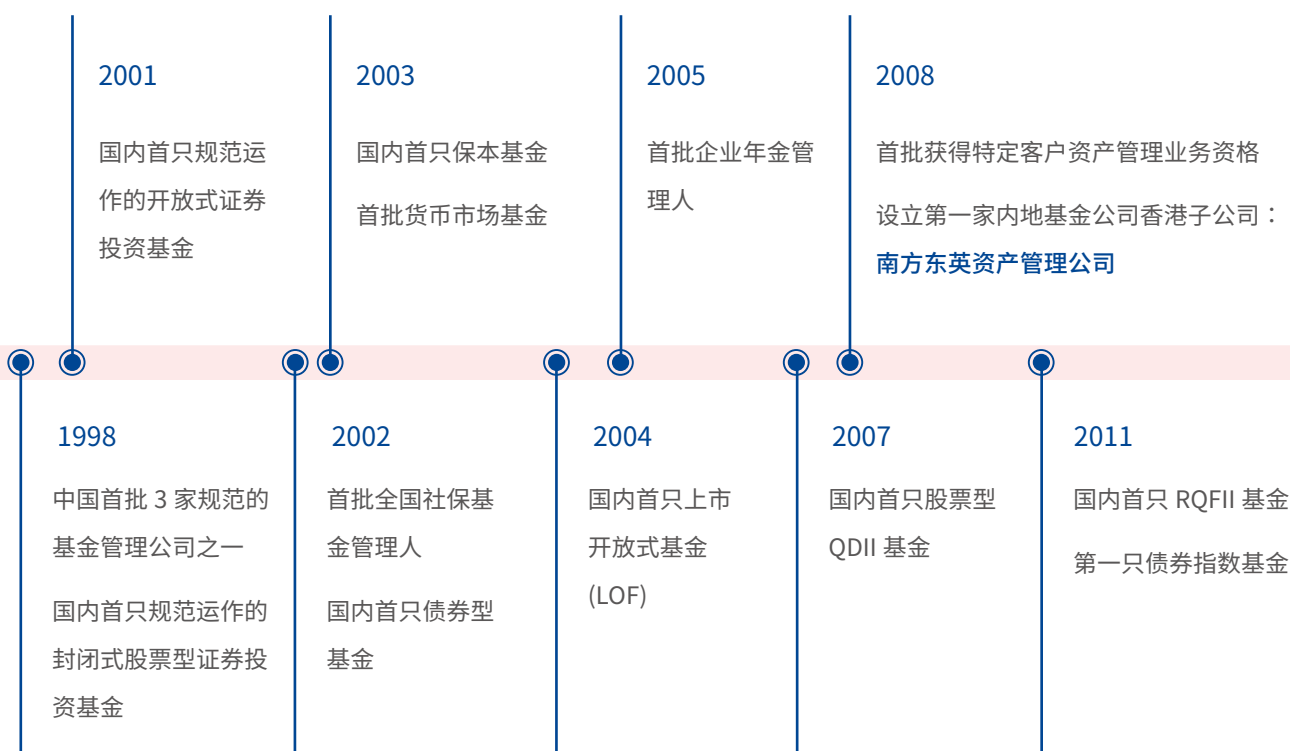


维护客户权益



## 丰富的投资解决方案

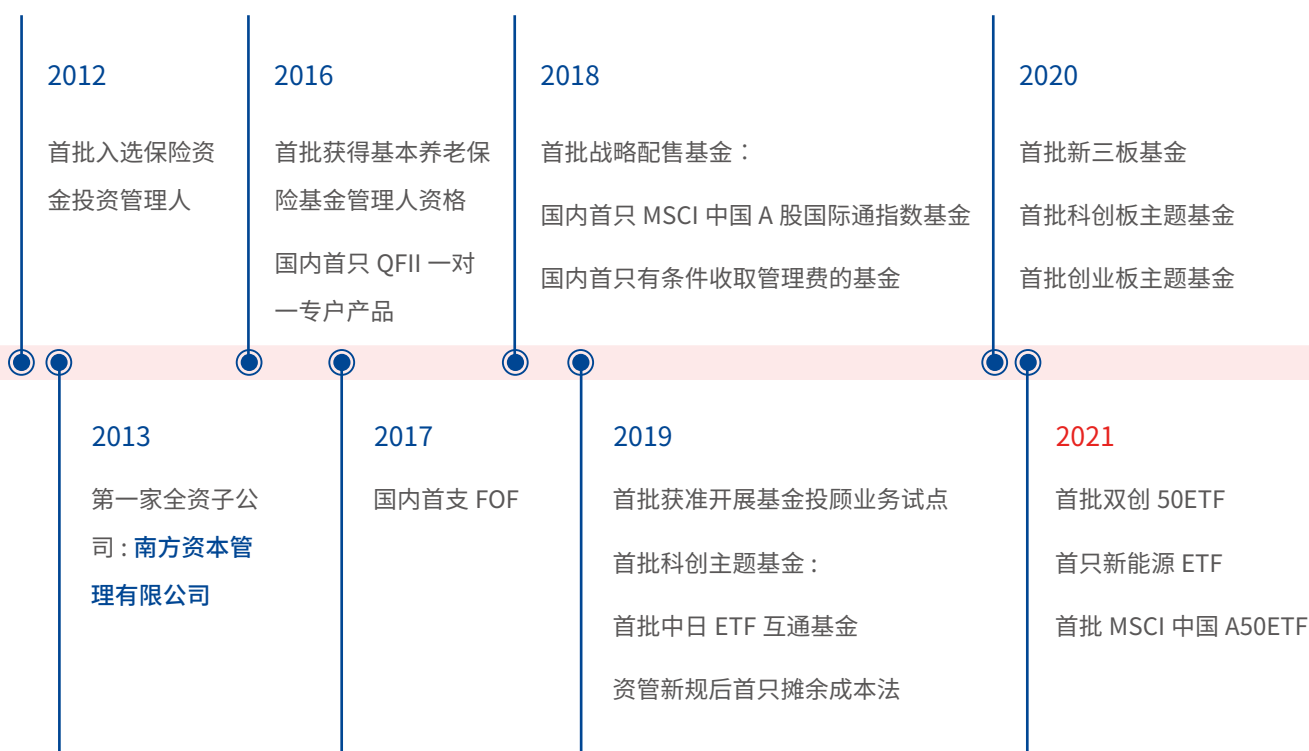
自 1998 年 3 月成立以来，南方基金相继获得包括公募基金、专户理财、社保基金、企业年金、保险资金、基本养老保险基金等在内的公募基金行业全牌照，在产品方面不断创新，持续引领市场。



### 产品体系创新

我们根据市场需要创新打造了多层次的产品体系。公募基金以投资标准化的产品为主，产品类型多样、产品线齐全。目前已设计开发包括股票型、债券型、货币型三个大类的公募基金产品，在此基础上衍生开发了偏债型、偏股型、指数型、量化型、行业基金等多个子类，各类型产品管理经验丰富。

2021 年，我们响应国家对资本市场改革、稳健创新的号召，开发和推出各类创新产品，包括中证科创创业 50ETF、MSCI 中国 A50 互联互通 ETF、同业存单指数基金、北交所主题基金、专精特新主题基金，满足客户多元化投资需要。



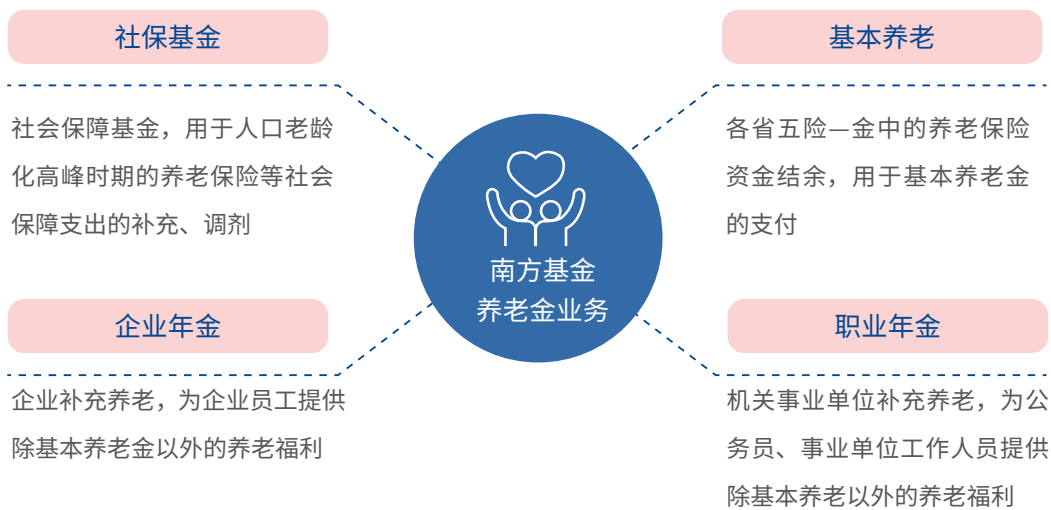
## 专属理财服务

为个人客户提供多样专属理财服务，每位高端个人客户配备全程一对一的专属理财顾问，客户可以根据自己的投资需求和风险偏好，选择合适的定制组合或专户产品，通过南方基金 APP、微信交易或网上交易等交易方式，满足多样化的理财需求，目前主要包括司南定制和专户理财。



案例：南方基金助力国民养老

中国社会老龄化程度持续加深，养老金融的发展受到全社会关注。南方基金是首批获得养老金业务投资管理资格的基金公司，是拥有养老金投资管理业务“全牌照”的基金公司。我们积极参与第三支柱建设，精耕体系搭建、品牌培育、投研实力及用户体验，建立了基本养老、社保基金、企业年金、职业年金全方位业务体系，不断提升养老资产投资管理能力，助力养老金融发展。南方基金已在官方 APP 打造了养老宝专区，支持根据客户的退休需求定制养老投顾方案。



“



“大力发展养老金业务，推动养老资金入市，不但有利于广大人民安享晚年，更有助于建设从长期资金到长期资本的形成机制，打造资本市场良性循环生态链，成为资本市场的‘压舱石’，助力实体经济发展。”

——南方基金副总经理 俞文宏

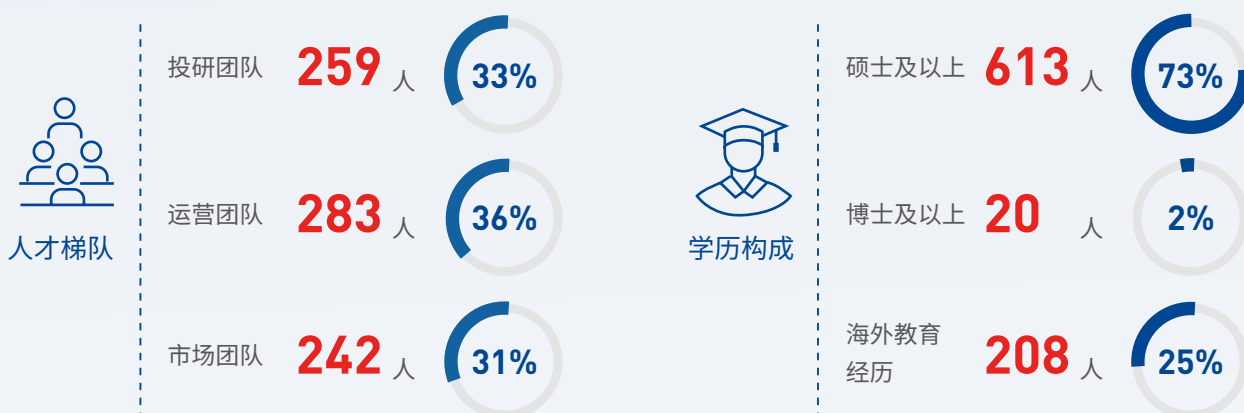
”

# 打造基金经理队伍

南方基金聚焦投研核心能力建设，致力于打造“价值驱动、科技智选”的业务特色，优化投研体系的长期考核激励机制，形成了权益、“固收+”、固收三大投研团队。

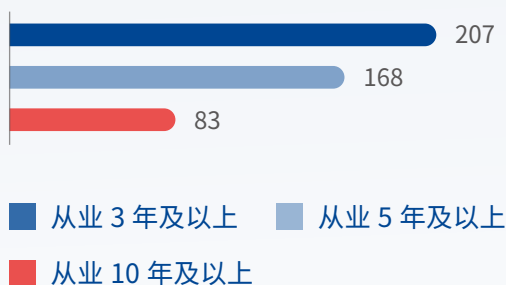
南方基金培养了一批拼搏进取、基本功扎实、团结分享、积极向上的优秀人才队伍。有一批资深专家从业经验超10年、把握大局，中坚力量经验丰富、投资风格多样，新生代专业素质过硬、成长迅速，构成多层次、全方位的人才梯队发展体系。

## 人力资源



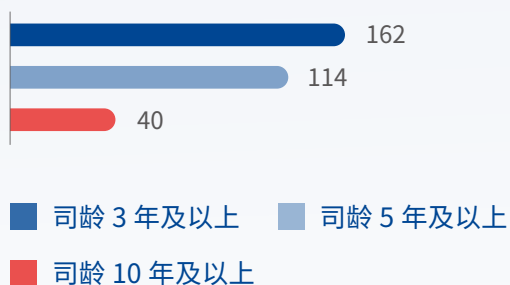
投研人员从业年限

单位：人



投研人员司龄年限

单位：人





## 加快数字化转型

南方基金积极借助科技力量赋能业务发展，提升金融科技应用水平，不断夯实自身“软实力”。加大 IT 系统建设投入，加强 IT 人才梯队建设，不断向公司各业务条线输送金融科技人才。提升自主研发能力，打造投研、运营、客户服务、合规风控一体化的金融科技生态闭环，在客户关系管理、精准营销、智能客服、主动服务等重点领域，加强信息技术与业务深度融合；建立完备的信息安全防护体系，保障信息系统安全。

### 科技创新亮点产品

#### ● 欧拉系统 ●

欧拉系统是一款以用户为中心，将资讯、产品、研究、投资、交易、风控、清算、核算、监控进行有机整合的资产管理系统，能够让不同业务部门同事在同一平台上相互协作，实现了业务能力的整合和业务知识经验的有效沉淀。



#### ● “司南投顾” ●

“司南投顾”通过金融科技手段，将南方基金专业的资产配置能力、风险管理能力及客户服务能力进行全面融合。该一站式智能投资顾问服务包含个性化深度定制、全市场精选标的、智能多策略匹配和专业团队全程管理四个方面。自主研发 3 大系统：基金投顾投资管理系统、基金投顾账户管理系统、基金投顾风险管理系统。

司南投顾严格履行“受托人责任”，联合合作伙伴为客户提供优质的投顾服务，已与银行、券商、三方销售等各类平台建立了投顾业务合作。司南投顾团队投资业绩靓丽，截至 2021 年底，盈利客户占比 87%，客户留存率 72%，复投金额占比 80%



盈利客户占比

**87%**

客户留存率

**72%**

复投金额占比

**80%****数据来源**

▶ 南方基金管理股份有限公司

**计算说明**

▶ 盈利客户占比 = 正收益客户数 / 持仓客户数

客户留存率 = 截止统计期末客户持仓金额 / 所有客户申购金额

复投金额占比 = 复投交易金额 / 复投客户总投资金额

**风险提示**

▶ 以上为历史统计数据，不代表个人投资收益，过往盈利数据也不预示未来盈利表现，南方基金不对投顾组合盈利能力进行任何保证

# 提升金融可获得性

## 投资者陪伴服务

投资者保护与投资者的利益直接相关，保护好投资者特别是中小投资者的合法权益，是我们的责任。公司充分发挥自身优势，积极开展投教素材制作，举办线上、线下投教活动，并在公司自有平台及外部媒体进行活动宣传推广，提高投资者专业知识水平及风险防范意识的同时，营造理性投资、长期投资、认识风险的良好氛围。

### 案例：南方直播间全年覆盖投资者人次破亿

顺应投资者获取信息渠道的变迁趋势，南方基金积极打造“南方直播间”，通过持续的直播业务开展投资者教育和陪伴业务，提升投资者体验。2021 年全年举办直播超过 1,200 场，合计覆盖投资者超过 1.2 亿人次，获得了《中国基金报》“英华奖”年度品牌创新公司奖（直播）荣誉。

### 案例：315 投资者保护主题教育活动

公司积极开展“基金 3·15 保护投资者合法权益我们在行动”主题教育活动。通过官网、APP、微博、微信、短视频、线上及线下活动等多种形式深入开展投教专项活动，3·15 活动期间公司原创投教产品 18 种，实物投教产品总发放 28 件，电子投教产品总点击量 560,619，共计开展现场活动 15 场、线上活动 13 场，合计覆盖投资者近 74,525 人。



活动现场



## 案例：“彩虹之旅”

“风雨之后见彩虹”——南方基金“彩虹之旅”投资者互动巡讲活动创办于2007年，至今已延续15年，超130场活动，遍及40城，数万人次的覆盖。坚守资管本源，践行投教责任，聆听客户心声，传递“长期投资、价值投资、责任投资”理念。



“彩虹之旅”活动宣传图



“彩虹之旅”在杭州

## 多元化渠道建设

南方基金积极推进多元化渠道建设，持续深化渠道合作，除直销外，与银行、券商、第三方代销机构、保险信托以及其他机构建立了多领域、全方位的合作伙伴关系，不断延伸服务边界，践行公募基金发展普惠金融的使命。在代销渠道建设方面，截至2021年12月31日，南方基金合作代销渠道261家；在直销渠道建设方面，公司自运营平台触达客户人次2,289.23万。

同时，南方基金以“APP+投顾”为两大“触点”，不断加大创新力度，提升客户体验，以具有竞争力的资产配置和投顾服务深度开发和服务现有客户。



南方基金合作代销渠道

**261** 家



公司自运营平台触达客户人次

**2,289.23** 万

## 应急服务能力

南方基金作为资管行业，注重提升自身应急服务能力，坚持“效率”优先。在地缘政治冲突等对资本市场有重大影响的事件发生时迅速响应，积极通过线上化渠道发布市场解读与公告，始终着眼于长期分析的立场，做好投资过程的安抚，为投资者增强信心。

## 普及金融知识

公司重视金融知识普及，通过多渠道向投资者们传播金融知识，帮助投资者们提高投资知识水平，增强风险防范意识。

### 案例：南方基金投资者教育基地网站上线运营

2021年10月28日“南方基金投资者教育基地网站”正式上线。以网站形式对外发布公益、专业、特色的投教产品，通过开展多样化投资者教育活动，引导投资者学习理财知识，辨别投资风险，树立理性投资观念。南方基金投教基地的建立标志着南方基金投资者教育工作揭开了新的篇章，南方基金也将以此为契机，展示资本市场发展成果，探索创新的投教模式，进一步丰富投教内容，将投教基地办成有温度、有广度、有深度的一站式投资者教育、咨询和服务平台。

# 维护客户权益



## 客户沟通

公司致力于搭建与客户多元化的沟通平台。投资者可以通过南方基金全国统一客服热线、在线客服、书信、电子邮件、短信及各销售机构网点柜台等不同的渠道对公司旗下产品、服务、系统等方面进行投诉或提出建议。通过 400 客户服务电话、多媒体线上服务、微信服务通知、客户现场活动等方式针对客户的服务满意度进行调研，2021 年客户服务满意度为 **99.69%**。



## 客户投诉处理

我们关切客户诉求，以完善的投诉处理制度、明晰的投诉处理流程和及时的预防改进措施，推动客户建议的落实，提升客户体验。我们根据投诉纠纷的受理渠道、案情性质及复杂严重程度，对投诉分类分级处理，明确了投诉内部流转流程、具体处理程序、责任分工、处理时限、应急处理、责任追究、信息管理等具体内容并严格执行，保障投诉处理工作有章可循，责任明确。

同时，公司定期分析总结客户投诉内容，形成报告发送公司领导及相关部门，提高公司对客户诉求的重视程度。通过发现问题、解决问题等方式，推动客户建议的落实，提前防范风险，预防投诉纠纷并针对投诉发现的薄弱环节和风险隐患及时进行重点改进，以提升客户体验。2021 年南方基金收到关于产品及服务的投诉数目 213 个，客户投诉办结率 **100%**。



03

高质量管理  
致力高质量发展



高起点引领、高水平治理、高品质运营、高标准管理,南方基金以习近平新时代中国特色社会主义思想为指导,把加强党的领导与建设现代企业制度紧密结合,将强化公司治理作为转变体制机制的重要着力点,夯实企业发展根基,符合现代金融企业权利责任对等、激励约束相容、风险控制严格的特征,适应金融业快速发展、金融体系更加复杂和不断开放的趋势,推进公司高质量发展。

党建引领



公司治理



稳健运营



保护知识产权



隐私和数据安全



## 党建引领

坚持党建引领，夯实制度基础，制定《南方基金“三重一大”决策制度实施办法》《中共南方基金管理股份有限公司委员会议事规则》《总经理办公会议制度》及党委会和总办会事权划分规则，从制度层面规范了公司党委、经营层议事规则，保证决策民主化、科学化、规范化。加强党委班子建设，突出党委的政治核心和领导核心作用。按业务条线将原有十二个支部设置调整为十六个支部，以支部建设促进业务建设，强化跨部门协同，提升党支部凝聚力。截至2021年末，公司共有党员334人。

迎接建党百年，开展形式多样的党建文体活动。公司邀请外部专家教授为全体党员讲授专题党课两期，同时各党支部推选党员代表，面向全公司进行6期业务专题分享，累计覆盖295人次。发挥基层党组织战斗堡垒作用和党员先锋模范作用，联合各党支部推出了“党建促业务、业务强党建”系列培训。打造“建党百年”专栏，营造党史学习氛围；定期推出党史知识试题24期，将党史学习教育融入日常学习。

截至2021年末，

公司设置



**16** 个党支部

共有



**334** 名正式党员

### 案例：建党百年党史学习活动

邀请中国人民大学马克思主义学院王向明教授，开展题为《重温建党百年峥嵘岁月》的讲座，公司全体党员团员共421人通过现场、线上的方式学习了中国共产党建党百年的历史。

邀请深圳市委党校徐晓迪教授，举办主题为《一个伟大组织的制胜密码》的专题党课，公司党员330余人通过深入学习党史，汲取党史智慧，凝聚奋进力量。



《一个伟大组织的制胜密码》培训照片

## 公司治理

建立了完善的“三会一层”现代公司治理架构，股东大会、董事会、监事会和管理层各司其职，高效运转。南方基金始终把坚持党的领导作为第一要务，进一步完善法人治理结构，突出权责边界划分，确保公司党委与“三会一层”之间的定位准确、权责衔接、有效制衡。

## 稳健运营

### 内控合规

完善合规管理制度，相继出台《南方基金合规手册》《南方基金合规管理制度》，在投资交易、基金销售、基金运营等各环节加强合规管理，为公募基金、私募资产管理计划等主要业务在产品的设计、宣推销售、投资运作、信息披露及投资者保护等环节制定具体的操作指引。完善内控合规组织体系，成立风险控制委员会、监察稽核部，并设立专（兼）职风控专员。培育合规文化，开展合规培训，提升全员合规风险防范意识。报告期内，没有出现重大合规风险事件。



### 廉洁从业

根据中国证监会《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》及中国证券投资基金业协会《基金经营机构及其工作人员廉洁从业实施细则》相关要求，发布了《南方原则》《南方规范》《南方基金职场规范提示》等文件，要求全体员工在开展证券期货业务及相关活动中，严格遵守法律法规、监管部门规定和行业自律规则，遵守社会公德、商业道德、职业道德和行为规范，公平竞争，合规经营，忠实勤勉，诚实守信，不直接或者间接向他人输送不正当利益或者谋取不正当利益。2021年，公司组织开展廉洁从业及基金从业人员违法风险、道德风险防控等多场培训，强化对职业道德的管控，努力构建良好的职业道德文化氛围。



开展廉洁从业合规培训

## 反洗钱

遵守国家反洗钱法律法规的要求，设立内部审计、绩效考核和奖惩机制，全面推进各项反洗钱工作深入开展。成立以总经理为组长，督察长为常务副组长，相关业务分管领导担任副组长，部门负责人为成员的反洗钱领导小组。监察稽核部为公司反洗钱工作的组织协调和办事机构，负责组织协调各部门的反洗钱日常工作。公司通过《南方基金洗钱和恐怖融资风险管理制度》《南方基金洗钱和恐怖融资风险管理策略》及《南方基金反洗钱内部控制制度》建立了风险为本的洗钱风险管理体系，并落实各项反洗钱监督管理要求。通过《南方基金洗钱可疑交易报告操作规程》明确了与洗钱犯罪相关的可疑交易筛查机制及上报机制，通过系统筛查与人工分析相结合的形式，切实提升洗钱可疑交易线索质量。

持续完善反洗钱相关系统建设，从客户身份识别、黑名单监控、风险等级评估、可疑交易筛查等多领域全面提升洗钱风险防控能力，持续探索构建客户行为特征指标库，优化反洗钱相关流程，强化反洗钱信息安全技术保障。2021 年，公司开展反洗钱合规检查 1 次、反洗钱专项稽核 4 次，实现了反洗钱检查母子公司全覆盖。

2021 年，

公司开展  
反洗钱合规检查

1 次



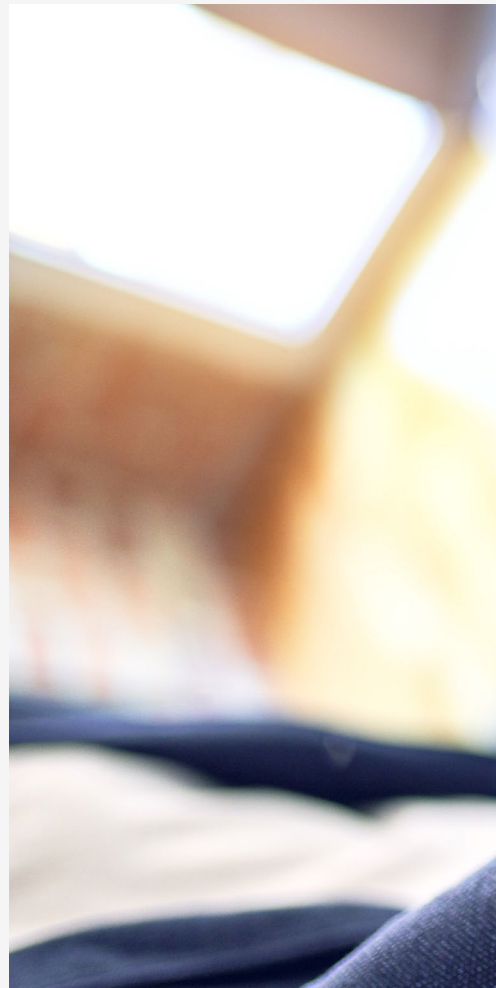
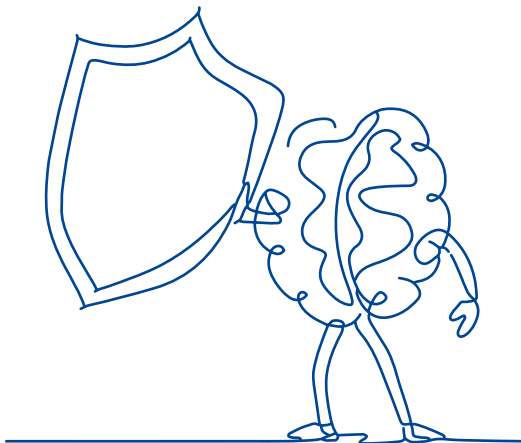
反洗钱专项稽核

4 次

实现了反洗钱检查母子公司  
全覆盖。

## 保护知识产权

严格遵守国家法律法规，尊重和保护知识产权，规范使用自身及客户和第三方机构的知识产权和商业信息。为鼓励知识产权创新，成立信息技术知识产权确权工作小组，确立公司自主研发系统的软件著作权申请工作流程和公司技术研发专利申请的工作流程，并定期组织 IT 部全体成员开展知识产权保护的系列主题培训。





## 隐私和数据安全

根据法律法规的要求，制定《南方基金信息和保密管理制度》《南方基金数据治理制度》《南方基金信息技术管理制度》等内部制度，从数据登记划分、数据治理、信息系统安全等多角度全方位保障公司的数据安全。


制定《南方基金投资者权益保护制度》，并通过智能质检系统、人工质检的方式严格监控客户服务的流程，以确保制度的有效执行和保障客户隐私。在日常的业务操作中，具体通过限制或禁止客户账户数据的导出功能、严格要求服务人员详细核实客户账户信息、拒绝对无法提供准确账户信息的客户提供账户查询服务等举措来保障客户资料安全。为保障客户于线上平台的隐私、权益，遵守国家相关法律法规与监管要求，在网页公开披露《南方基金电子直销平台隐私政策》，向使用南方基金产品或服务的用户说明公司如何收集、使用、保存个人信息和目的，并提供删除和保护这些信息的方式。



04

# 绘就可持续发展 新篇章





精诚所至,金石为开。我们真心关爱员工,用心服务客户,诚心回应利益相关方关切。南方基金作为负责任的企业公民,肩负社会责任,在注重为客户创造价值的同时,通过实施绿色运营与绿色公益活动推动绿色发展,在实现共同富裕的美好征程上稳步迈进。

携手员工成长



推动绿色发展



参与社区共建



## 携手员工成长

携手南方，成就梦想。我们相信，托付我们的，不只是客户，更是我们的员工。南方基金持续加强人才队伍建设，强化人才培养机制，保障员工权益，注重员工成长，关爱员工健康，让员工携手南方共同进步、共同成长。

### 合法雇佣

南方基金严格遵守《劳动法》《劳动合同法》等国家法律法规，完善公司内部政策，发布《南方基金劳动合同管理办法》《南方基金招聘管理办法》《南方基金员工考勤管理办法》《南方基金实习生管理规定》，对薪酬及解雇、招聘及晋升、工作时数、假期、平等机会、多元化、反歧视以及其他福利待遇做出明确规定，坚决抵制雇佣童工、强制劳工等违反劳工准则的行为。

我们要求员工招聘秉承公平、公正和公开原则，建立了完善的招聘流程，招聘渠道丰富多元，招聘信息公开透明。在候选人面试过程中以及新员工录用前，均须对候选人及新员工的基本录用条件逐项核实。2021年，通过公开招聘、内部推荐、猎头推荐等多渠道及时补充和引进核心人才，全年招聘到岗正式员工 115 人，其中金融科技类人才 39 人，权益研究类 14 人，较往年均有较大增幅。源源不断为业务输送后备力量，通过线上、线下等方式开展校园招聘，首次同时招聘未来两届实习，全年招聘实习生 316 人，录用 2021 届及 2022 届实习生 39 人，为年轻人提供更多发展机会。我们遵循劳工合同自愿签订原则，2021 年劳动合同签订率为 100%。



校招活动现场



全年招聘到岗正式员工

**115** 人



录用 2021 届及 2022 届实习生

**39** 人

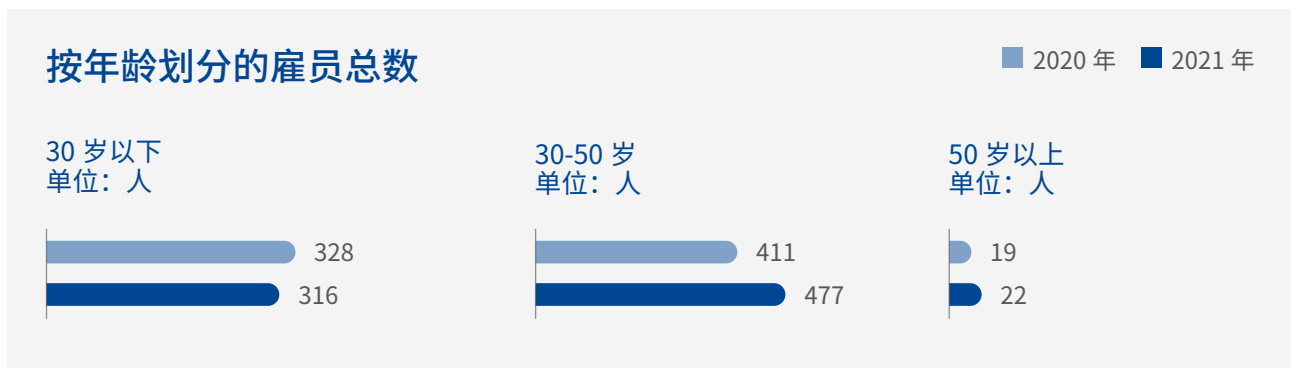
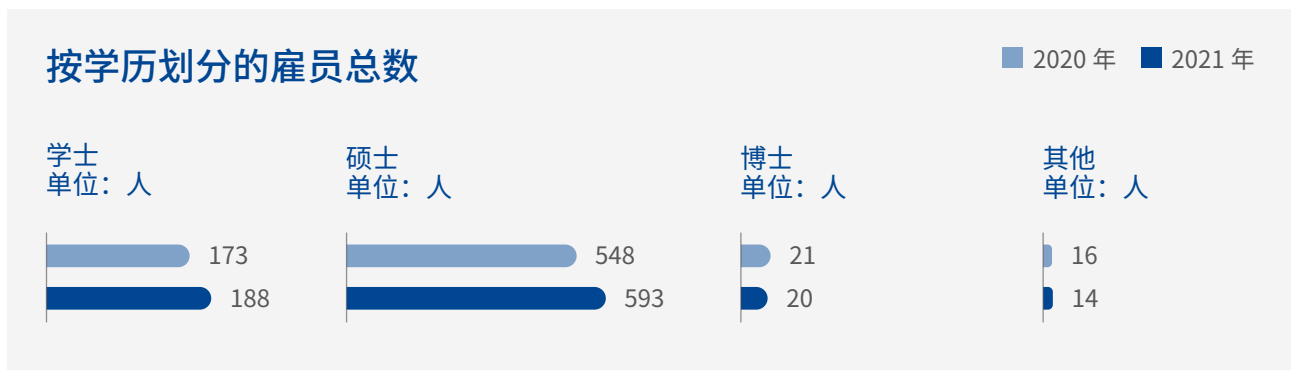
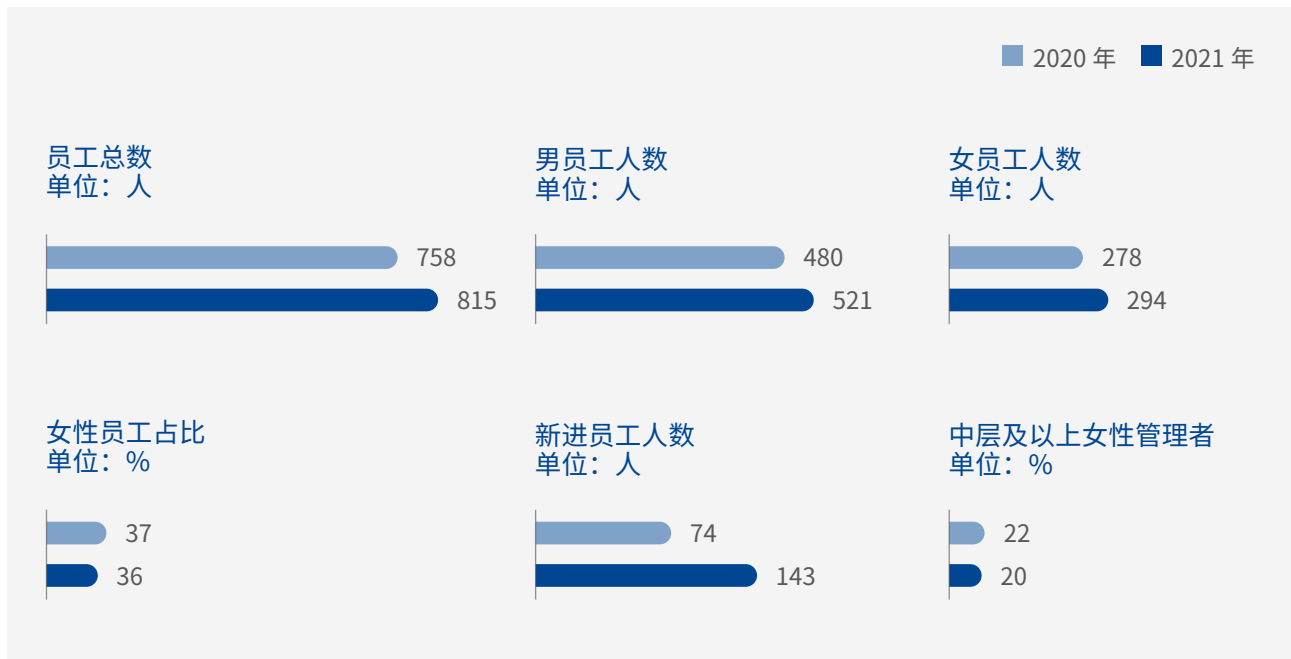


2021 年劳动合同签订率为

**100%**

保障员工权益，制定《南方基金员工薪酬分配办法》，将薪酬激励与公司长远发展相结合，建立了包含工资、奖金与综合福利在内的薪酬激励体系，保持薪酬策略的前瞻性，以有竞争力的薪酬实现吸引、保留、激励优秀人才的目标。

公司坚持意见开放政策，持续畅通员工沟通渠道，通过职工代表大会、员工座谈、电子邮箱、企业微信、“总经理午餐会”等方式开展员工交流活动。2021 年全年未发生任何劳资纠纷。



## 健康保障

为体现公司“以人为本”的人才管理理念，我们建立健全福利保障体系，保障员工利益，为公司的经营和发展构建更为和谐、稳定的环境。

### 健康与安全机制

我们重视公司员工医疗保障水平，制定《南方基金员工健康意外保险及特殊困难补助基金暂行管理办法》，在为员工提供五险一金基础上，为员工购买商业保险，明确员工可享有的健康意外保险种类、额度、投保流程、特殊困难补助基金的申请条件、发放流程及相关额度等内容。为规范公司员工患病和非因工负伤的管理，公司制定《南方基金员工医疗期管理办法》，明确规定员工医疗期的确认、额度、计算方法以及医疗期内的相关薪酬福利。

为保障公司人、财、物的安全，加强员工安全防范意识，防范和化解办公环境中的安防风险，公司制定《南方基金安全防范工作流程》，系统化梳理及规范对安全防范工作的相关岗位、人员权责以及工作要求，为员工提供安全、安心的工作环境。

#### 案例：新冠疫情常态化防控

公司密切关注最新疫情形势及政府防疫政策，严格落实报备审批要求，并做远程办公、核酸检测等建议安排。公司积极与社康和核酸检测机构联动，为员工提供核酸检测和疫苗接种的便利和资讯，保障员工健康，杜绝出现因疫情风险影响公司业务运转的情况。2021 年公司有效预防疫情风险，实现全公司 0 确诊、0 感染、0 疑似，保障了全体员工的健康，未发生任何风险事件，公司业务平稳运行。

2021 年公司有效预防疫情风险，实现全公司

0 确诊    0 感染    0 疑似

## 工作与生活平衡

为鼓励员工劳逸结合、工作生活平衡，我们组织开展多项文体活动，包括“南方杯”司庆系列活动、工会季度团建等活动，丰富员工生活，助力员工身心和谐健康成长。

### 案例：倡导员工健康运动

公司提供各种活动支持，形成了浓厚的健康运动氛围。健身房使用率较高，每周均有员工积极参加网球、羽毛球、篮球、足球等各项运动。另外，公司特邀请中医专家进行健康讲座，并现场组织中医理疗团队为员工进行理疗活动。公司工会球队还代表公司参与了2021年“招商杯”篮球联赛、“恒生杯”及“华羽杯”羽毛球赛。



## 员工关怀

南方基金注重员工关爱与关怀，积极开展健康保险讲座、专属心理咨询服务、探望生病员工等一系列保障和关怀员工的暖心活动。公司已与第三方专业机构“中智关爱通”合作，为员工建立了心理健康援助，员工可通过微信及电话预约心理咨询师进行咨询，咨询方式包括电话、视频、面对面等多种形式。

### 案例：EAP“南得有你”服务项目

为了关注员工健康，帮助员工悦纳情绪、塑造积极心态，公司持续提供“南得有你”员工关爱项目 EAP (Employee Assistance Program)，员工可通过电话、视频或现场面对面的方式向咨询师咨询“职业发展、家庭亲子、婚姻情感、情绪调节”等问题。

2021年，公司对员工关爱的重视度进一步提升，加强了广泛宣传，EAP项目运行平稳，受到员工们的一致好评。咨询回访满意度4.72分（总分5分），高于行业平均水平。

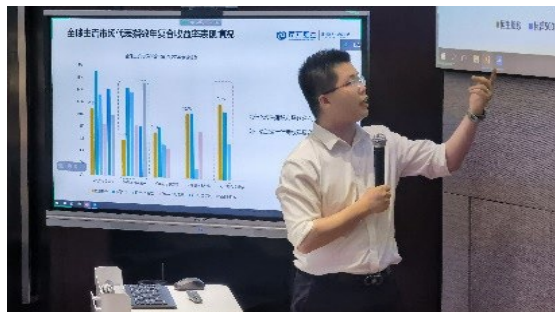
## 职业发展与培训

我们坚持正确选人用人导向，以职业发展机会平等化、多元化原则，持续构建员工职业发展通道，促进公司员工的职业发展与成长进步。

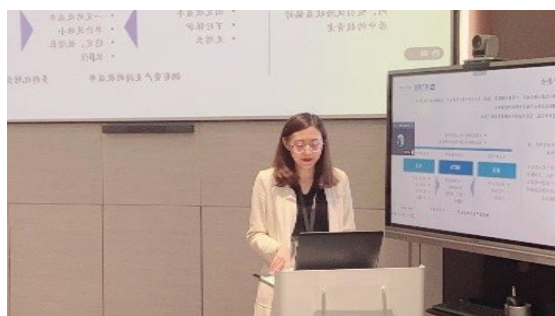
我们重视员工培训与发展，根据员工职业发展和晋升需要，保障职级晋升及评审的规范性、有效性，确保评审标准、评审流程及操作规则的合理应用。

保障员工培训工作制度化、规范化，制定《南方基金员工培训管理办法》，通过研讨、专题讲座、视频培训等多种培训方式和渠道，提升员工职业素养、工作技能、工作绩效和合规风控意识。为新入员工定制培养方案，通过导师制管理帮助新员工迅速了解并认同企业文化、学习工作流程、掌握工作方法。开展应届毕业生岗前培训，帮助应届毕业生知悉公司、了解业务、深入一线、尽快融入公司。2021 年，我们的员工培训覆盖率达到 100%，员工培训经费支出 2,852,514 元，共覆盖 3,244 人次。

结合业务发展要求，持续强化专业人才队伍建设。紧密结合投研业务属性及投研人员需求，通过培训为投研团队赋能，提供开拓国际视野、提升专业能力的培训服务，2021 年共针对性地开展了 6 期培训，累计覆盖 269 人次，助力投研人才梯队建设。为市场与一线销售人员培训赋能，与各部门、分公司深度联合，实施了全方位、定制化的培训，共组织策划了 8 场培训，累计覆盖 546 人次，系统性地提升营销体系战斗力。根据数字化转型需要对科技人员开展培训，全方位引进外部资源、调动内部资源，2021 年共组织实施 8 场培训，累计覆盖 171 人次，为公司金融科技发展输送人才。



港股培训



公募 REITs 培训



“固收+”培训

2021 年，



员工培训  
覆盖率达到  
**100%**



员工培训经费支出  
**2,852,514** 元

共覆盖  
**3,244** 人次



### 案例：开展新员工训练营及入职培训，赋能新入职员工

开展 2021 年新员工训练营，历时 5 周，为各业务输送后备力量 75 人（其中，投研 29 人，市场 12 人，运营 34 人）。在新员工培训中打造“先为同学、后为同事”的培养模式，助力新员工快速融入团队，促进跨部门协作、营造共享文化氛围，通过传帮带，共同践行“客户、诚信、共享、奋进”的核心价值观。

## 推动绿色发展

### 绿色运营

南方基金贯彻落实绿色发展理念，积极推行绿色运营，努力减少资源能源消耗及废弃物排放，落实节能减排、促进低碳转型，打造绿色环境友好型企业。2021 年公司没有发生有关违反环境法律法规的案件或举报。2021 年，我们率先启动碳中和行动，并实现自身运营（范围一、二）碳中和，积极支持“2030 碳达峰”和“2060 碳中和”国家战略落地。

虽然 2021 年温室气体排放量较 2020 年呈上升趋势，但人均温室气体排放量密度是有所降低的。2020 年 2 月至 4 月，为了遏制新冠肺炎的传播，保障员工健康安全，我们采取远程办公的形式，这也是 2021 年温室气体排放量增加的主要原因。作为负责任的机构投资者，未来南方基金会继续全方位，多角度地采取减排措施，坚决贯彻落实可持续的绿色运营理念。

| 温室气体排放          | 单位        | 2021 年  | 2020 年 |
|-----------------|-----------|---------|--------|
| 范围 1 排放量        | 吨二氧化碳当量   | 175.1   | 175.1  |
| 范围 2 排放量        | 吨二氧化碳当量   | 3,270.2 | 3081.3 |
| 温室气体总排放量        | 吨二氧化碳当量   | 3,445.3 | 3256.4 |
| 人均温室气体排放量       | 吨二氧化碳/雇员  | 4.2     | 4.3    |
| 每平方米楼面面积温室气体排放量 | 吨二氧化碳/平方米 | 0.1     | 0.1    |

注：温室气体排放计算口径包括南方基金总行办公室及所有分公司，即北京、上海、深圳、南京、成都和合肥。

范围 1 包括固定源（即设备）和流动源（即公司自有的运输工具）的燃料燃烧所致的直接排放。计算所采用的温室气体排放因子是根据《2006 年 IPCC 国家温室气体清单指南目录》；温室气体的全球变暖潜能值则采用 Greenhouse Gas Protocol Fifth Assessment Report (AR5) 数值。

范围 2 包括向电力公司外购电力所致的间接排放。计算所采用的国家电网排放因子是根据国家发展和改革委员会所发布的 2012 年中国区域电网平均二氧化碳排放因子。

## 废弃物处理

加强废弃物排放管理，我们继续推进垃圾分类工作，开展废弃物分类宣传和培训、加强辅导等方式，提高员工环境保护意识。

严格遵循深圳市城市管理等相关主管单位规定，有效处置公司运营产生的废弃纸张、废弃办公家具、生活垃圾、厨余垃圾等无害垃圾。如厨余垃圾与主管单位指定的回收公司签订协议，实行定点回收。对废旧的电子设备和元器件采用分类回收、集中处置的方式环保处理。对于无法回收的有害废弃物如废弃墨盒、废弃硒鼓、废弃灯管等，进行单独收集、集中收集处置，避免造成有的环境污染，例如废弃的硒鼓墨盒用完由打印机厂家回收处置，报废电子设备每年由服务商集中回收后处理。

## 能源和资源使用

加强能源和资源使用管理，采取节水节电、无纸化办公、垃圾分类等一系列节能降耗举措，提升资源和能源使用效率。

### 节水节电

推广使用节能产品，加强空调管理，采用更少能耗的 VAV (Variable Air Volume) 平衡空调系统。使用节水型器具，减少水资源浪费。采用可再新能源系统，例如健身房淋浴间采用太阳能热水器。日常加强督导，强化用水用电管理。

### 无纸化办公

楼层设置打印纸回收箱，鼓励全体员工重复利用打印纸；将环保理念融合进投资者教育工作中，对未定制电子账单的客户，建议客户取消纸质账单、定制电子账单。推广视频会议或电话会议，现场会议占比下降。

### 倡导低碳生活

鼓励员工养成绿色低碳的生活方式，优选公共出行工具，增加对可回收物品的使用和消费，以实际行动助力绿色发展。

### 南方基金总部能源使用：

2021 年总用电量

**6,064** 兆瓦时

2020 年总用电量

**5,375** 兆瓦时

### 2021 年能源 / 燃料使用



外购电力

**6,064** 兆瓦时



液化石油气

**10,868.7** 公升

天然气

**36,517** 立方米

无铅汽油

**5,384.4** 公升

能源消耗总计

**6,676** 兆瓦时

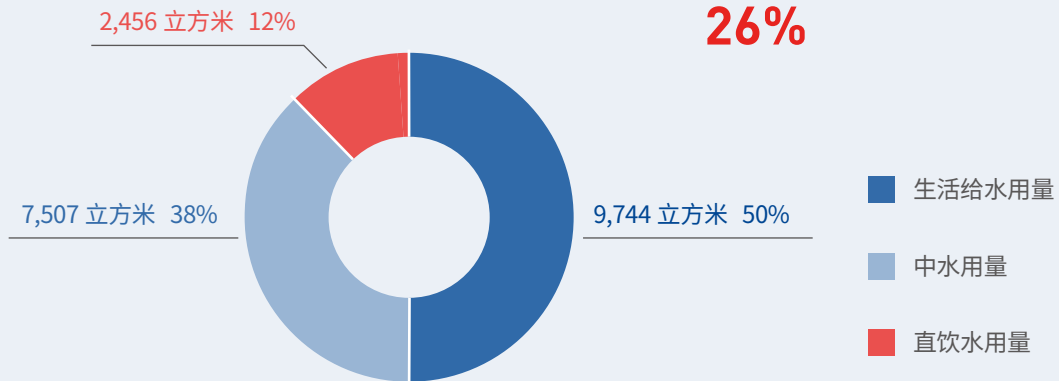
注：能源 / 燃料使用量的计算口径包括南方基金总部及所有分公司，即北京、上海、深圳、南京、成都和合肥。

能源消耗量数据是根据中华人民共和国国家标准《综合能耗计算通则（GB/T2589-2020）》中提供的有关换算因子进行计算，包含外购电力、液化石油气、天然气及无铅汽油。

### 2021 年南方基金总部用水量

总用水量比 2020 年减少

**26%**

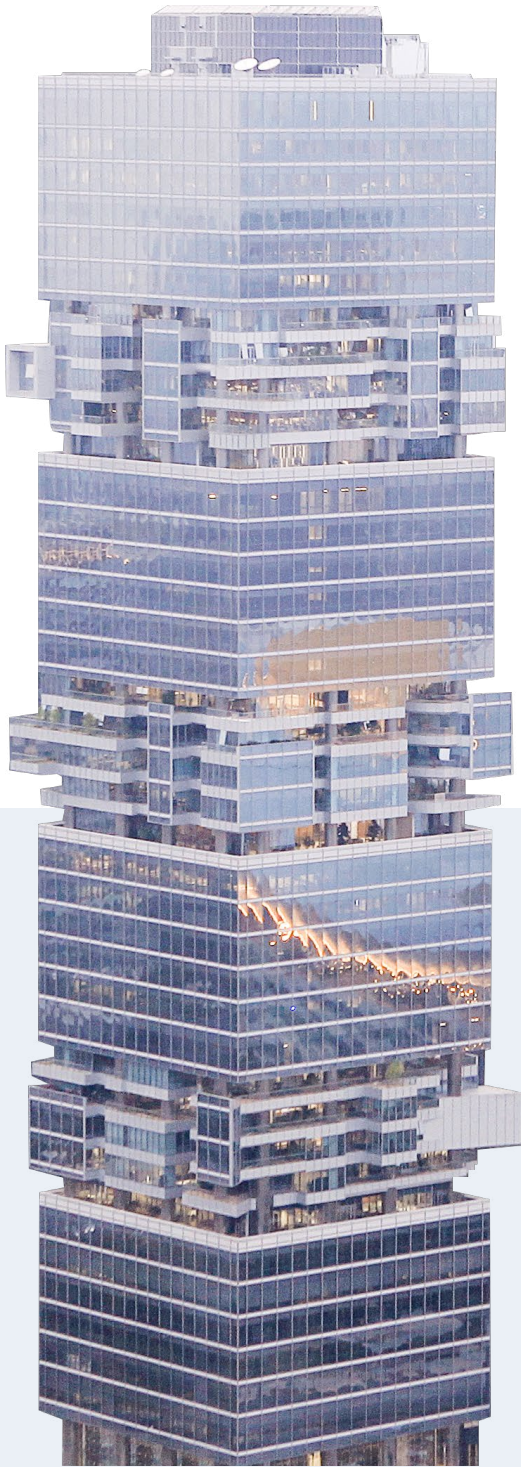


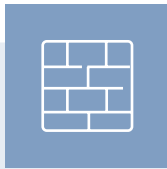
## 绿色建筑

南方基金日常运营管理中融入绿色元素，对于硬件设施亦十分注重环保绿色的考虑。公司位于深圳市福田区 CBD 金融中心的办公总部大楼——基金大厦，大厦以“循环建筑，绿色技术，低碳生活”为设计理念，融入地方精神与岭南建筑特色，关注建筑全生命周期中产生的环保效益，积极响应国家大力发展绿色建筑号召。

基金大厦占地 7,260.06 平方米，总建筑面积 11 万平方米，高 200 米。基金大厦从方案、设计、施工、建材，严选每个细节，并践行国际绿色节能标准，全面融入绿色建筑的设计元素。2020 年 11 月，经过美国绿色建筑委员会、绿色建筑认证协会的多轮考评，基金大厦荣获领先能源与环境设计 (LEED) 的黄金级认证，成为受国际标准所认可的绿色建筑。

2020 年，南方基金总部大楼“基金大厦”荣获 LEED 绿色建筑黄金级认证





外墙设计

将花园纳入写字楼，建设“空中花园”，增加大厦绿化面积。采用更有利于节能的双层幕墙，降低建筑能耗。



给排水设计

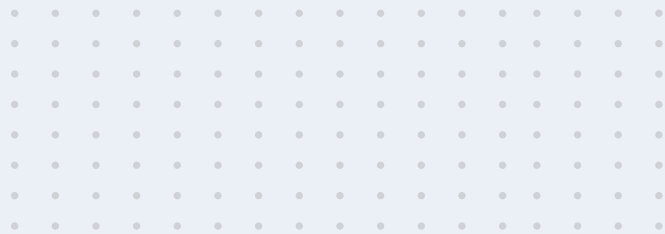
采用中水处理、雨水回收系统，实现“废水零排放”，洗手间选用低水量的节能洁具，配合直饮水系统的使用，减低了大厦水资源消耗。



电气设计

采用更少能耗的 VAV 平衡空调系统和人走灯灭的智能照明系统等设施设备，大大降低了用电能耗。此外，大厦还积极使用太阳能热水器等新能源系统。

2021 年，南方基金总部大楼“基金大楼”获三星级绿色建筑运营标识证书



## 绿色采购

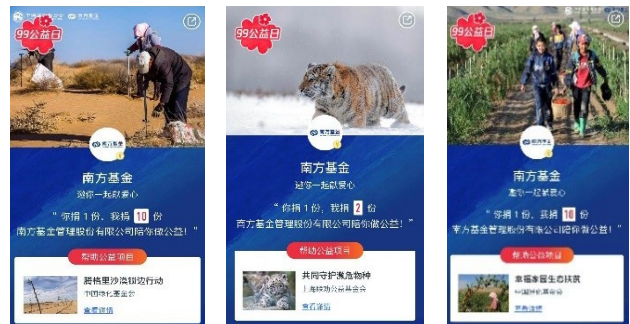
我们遵循《中华人民共和国招标投标法》《中华人民共和国招标投标法实施条例》等法律法规要求开展采购工作，不断完善供应商管理体系，强化供应商管理。由于我们所处金融行业的特点，供应商主要涉及 IT 软硬件、办公用品、设施设备及服务采购等，供应链较短，对环境及社会造成负面影响的风险较低。在供应商选择方面，南方基金要求供应商近三年内没有行政处罚或违规行为，优先考虑具有较好社会形象、企业社会责任履行较好的供应商。践行绿色采购，特别是在采购保洁、办公等用品时，在满足服务质量的前提下优先选择环境友好型产品和服务。优先采购环保类用品，如办公家具、清洁等日用品等，降低对环境的影响。

## 绿色公益

南方基金以实际行动践行着绿色环保，和谐共融的生态理念。我们投身绿色公益活动，足迹跨越祖国大地，从腾格里沙漠到长江流域，为环境保护、守护物种多样性、生态扶贫贡献力量。以一种公益环保、积极健康的方式鼓励全员绿色生活，为支持绿色生态公益事业做出积极贡献。

## 参与腾安“99 公益日”

2021，南方基金作为腾讯腾安联合腾讯公益举办的“99 公益日”活动的首批重点合作的 5 家机构之一，共投入五十万元捐赠款，款项主要投入沙漠锁边行动、守护濒危物种、生态扶贫，一亿棵梭梭、留住长江的微笑等环保项目。南方基金希望借助互联网平台，以务实行动凝聚起公司员工、合作伙伴、客户及社会大众的爱心和力量，共同助力社会可持续发展。



腾格里沙漠  
锁边行动

共同守护  
濒危物种活动

幸福家园  
生态扶贫项目



一亿棵梭梭

留住长江的微笑

## 参与社区共建

作为国内首批成立且资产管理规模始终位居前列的基金公司，南方基金高度重视社会责任的履行，积极开展各项公益慈善和环境保护工作，累计投入逾千万元用于社会公益事业，以爱心企业的责任形象树立行业标杆，打造责任南方、爱心南方、幸福南方。

## 融入湾区发展

作为国内首批规范的基金管理公司，南方基金成立以来，立足大湾区，顺应时代潮流和趋势，积极把握发展机遇，成为深圳特区公募资管规模最大的公募基金公司。

服务大湾区发展，2019年9月，推出南方粤港澳大湾区创新100ETF，跟踪湾创100指数，聚合创新能力突出的粤港澳大湾区企业，助推大湾区战略性新兴产业、现代服务业和海洋经济产业发展。推动跨境投资，南方东英作为境内基金公司获批成立的第一家境外资产管理公司，自2008年成立以来始终走在中国资本市场开放的前沿，投资产品遍布全球，包括中国香港、美国、日本、卢森堡、爱尔兰和开曼群岛等多个地区。凭借RQFII产品管理上取得的优势地位，南方东英成为香港重要的ETF提供商。

## 助力公益事业

多年来，南方基金热心公益，积极参与社会公益慈善活动，积极履行企业社会责任，为更好地履行企业社会责任，公司于2011年7月25日捐资800万元设立广东省南方基金慈善基金会，主要从事奖教助学、救济赈灾、扶贫济困、环境保护等社会公益慈善活动。

截至2021年底，南方基金直接捐赠累计1,548.82万元，通过南方基金慈善基金会捐赠累计767.57万元，合计捐赠累计**2,316.39万元**。2021年，南方基金年度捐赠总额412.68万元。



2021年度，  
南方基金捐赠总额

**412.68** 万元

### 案例：汾西县贫困学生助学计划

“百年大计，教育为本”。教育是立国之本，是民族兴旺的标志。南方基金积极投身中国乡村教育计划，持续开展教育公益事业，为社会主义伟大事业添砖加瓦。2021 年 11 月，南方基金捐资 25.4939 万元，用于汾西县贫困学生助学计划，资助了 247 名学生。



南方基金捐资  
**25.4939** 万元  
资助  
**247** 名学生





## 支援应急救援

我们充分履行企业社会责任，在疫情防控、河南暴雨等重大事件中迅速响应、提供支援，用行动回报社会。

### 案例：共担风雨，携手向前，南方基金驰援河南

2021年7月，河南省多地遭受严重暴雨洪水影响。为驰援河南人民对抗暴雨灾害，南方基金向河南省慈善总会捐款300万元，专项用于河南省抗洪救灾和灾后重建。



南方基金向河南省慈善总会捐款

**300** 万元



# 附录

## 利益相关方列表

南方基金以积极和开放的态度与利益相关方进行沟通，不断拓展沟通渠道，充分聆听和了解相关群体的意见及反馈，及时、真诚地回应利益相关方关注的 ESG 重要议题，推动南方基金业务进步，积极打造优秀的企业公民形象。

| 利益相关方  | 主要沟通渠道  |
|--|---|
| <br>政府监管  | <ul style="list-style-type: none"> <li>• 关注落实监管政策</li> <li>• 通过公司投资策略和产品推出来响应国家战略</li> <li>• 线上问卷调查</li> </ul>  |
| <br>投资者  | <ul style="list-style-type: none"> <li>• 线上问卷调查</li> <li>• 年报</li> <li>• 投资者教育活动</li> <li>• 定期报告与信息公告</li> <li>• 通过媒体、电话、邮件等渠道与投资者保持沟通</li> </ul>   |
| <br>客户  | <ul style="list-style-type: none"> <li>• 客户产品需求调研</li> <li>• 线上问卷调查</li> <li>• 服务专线、微信通知、邮件订阅等线上沟通功能</li> <li>• 客户满意度调研</li> <li>• 客户意见反馈</li> <li>• 客户权益保护</li> </ul>  |
| <br>员工  | <ul style="list-style-type: none"> <li>• 公司高管开放日</li> <li>• ESG 资讯月刊</li> <li>• 内部访谈</li> <li>• 线上问卷调查</li> <li>• 员工培训及技术支持</li> <li>• 员工满意度调查</li> <li>• 员工意见箱</li> <li>• 职工代表大会</li> <li>• 员工问题发展与健康关怀活动</li> </ul> |
| <br>公众  | <ul style="list-style-type: none"> <li>• 线上问卷调查</li> <li>• 对外捐赠</li> <li>• 社区服务与志愿活动</li> <li>• 金融知识普及活动</li> </ul>   |
| <br>供应商 | <ul style="list-style-type: none"> <li>• 线上问卷调查</li> <li>• 集中采购</li> <li>• 供应商培训</li> </ul>   |

## 报告编制说明

本报告为南方基金管理股份有限公司（简称“南方基金”）正式发布的第二份年度 ESG 投资报告，机构涵盖南方基金总部、分公司及子公司。报告周期以 2021 年度为主，部分信息超出报告周期。如无特别说明，本报告涉及的计价币种为人民币。

在本报告中，“南方基金管理股份有限公司”“南方基金”“公司”“我们”均指代南方基金管理股份有限公司。

报告编制依据主要包括深圳市绿色金融协会《深圳市金融机构环境信息披露指引（征求意见稿）》、深圳市地方金融监督管理局《深圳经济特区绿色金融条例》、香港联合交易所《环境、社会及管治报告指引》（2020）、联合国负责任投资原则 PRI、气候相关财务信息披露工作组（TCFD）的建议、国家发展和改革委员会《绿色产业指导目录（2019 年版）》、联合国开发计划署《可持续发展投融资支持项目目录（中国）》等。

## 联系方式

尊敬的读者：

您好！

感谢您在百忙之中阅读《南方基金 2021 年 ESG 投资报告》。为了更好地满足您的需求，向您提供更有价值的信息，同时促进我们持续改善 ESG 绩效，提升负责任投资和履行社会责任的能力，我们殷切地期望您能够对我们的报告提出宝贵意见！

您可以通过扫描右方二维码即时反馈。



您也可以通过以下方式联系我们。

- 地址：广东省深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼可持续发展部

- 邮编：518017

- 邮箱：lisisi@southernfund.com

南方基金 ESG 投资报告工作组

2022 年 6 月 16 日

Signatory of:



## 免责声明

1、本文所载内容仅供参考，不视为任何形式的要约、要约邀请或承诺。本文引用的信息来源于已公开的资料，除本公司依法应当披露的信息外，本公司对该等信息的准确性、完整性或可靠性不作任何保证，本公司或本公司的任何董事或雇员并不就该等数据之任何错误或遗漏承担责任（包括任何第三者责任）。除另有说明外，本文所载相关个人观点、分析、建议、模型等内容仅反映作者于本文发出当日的见解和看法，并不代表本公司的立场，本文作者亦可在未加通知的情况下对任何内容进行更改。

2、本文所述任何投资(如有)都包含相应的风险，并不适合所有投资者。据此投资的证券、基金等资产价值或收益会有波动。本文没有考虑单个投资者投资目标、财务状况、风险承受能力或个别需求，相关观点在任何时候均不构成对投资者的投资建议。投资者应当

充分考虑自身特定状况，并完整理解和使用本文内容，不应视本文为做出投资决策的唯一参考因素。投资者应咨询专业顾问，自主判断证券、基金的投资价值，自主做出投资决策，并自行承担投资风险，对依据或者使用本文所造成的一切后果，本公司及作者均不承担任何法律责任。

3、本公司作为基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。本公司旗下基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现，个别基金的业绩不构成对其他基金业绩表现的保证。本公司提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

4、投资者在做出投资决策前应仔细阅读基

金合同、招募说明书以及本公司在中国证监会指定信息披露媒介上发布的正式公告和有关信息。任何在本文中出现的信息(包括但不限于评论、预测、图表、指标、理论等)仅作参考，不应作为投资者投资决策与基金交易的依据。投资者应当在基金销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回，但基金并不是销售机构的存款或负债，也没有经销售机构担保或者背书，销售机构并不能保证其收益或本金安全。

5、本文的著作权受法律保护，未经书面许可，任何机构和个人不得以任何形式发表、署名、修改、复制、转载或传播。本文可能包含了专有信息、保密信息或其他受法律保护的信息，若您并非指定收件人，请立即通知发件人并予以销毁或删除，且不得复制或使本文，亦不得向任何其他人披露本文内容。