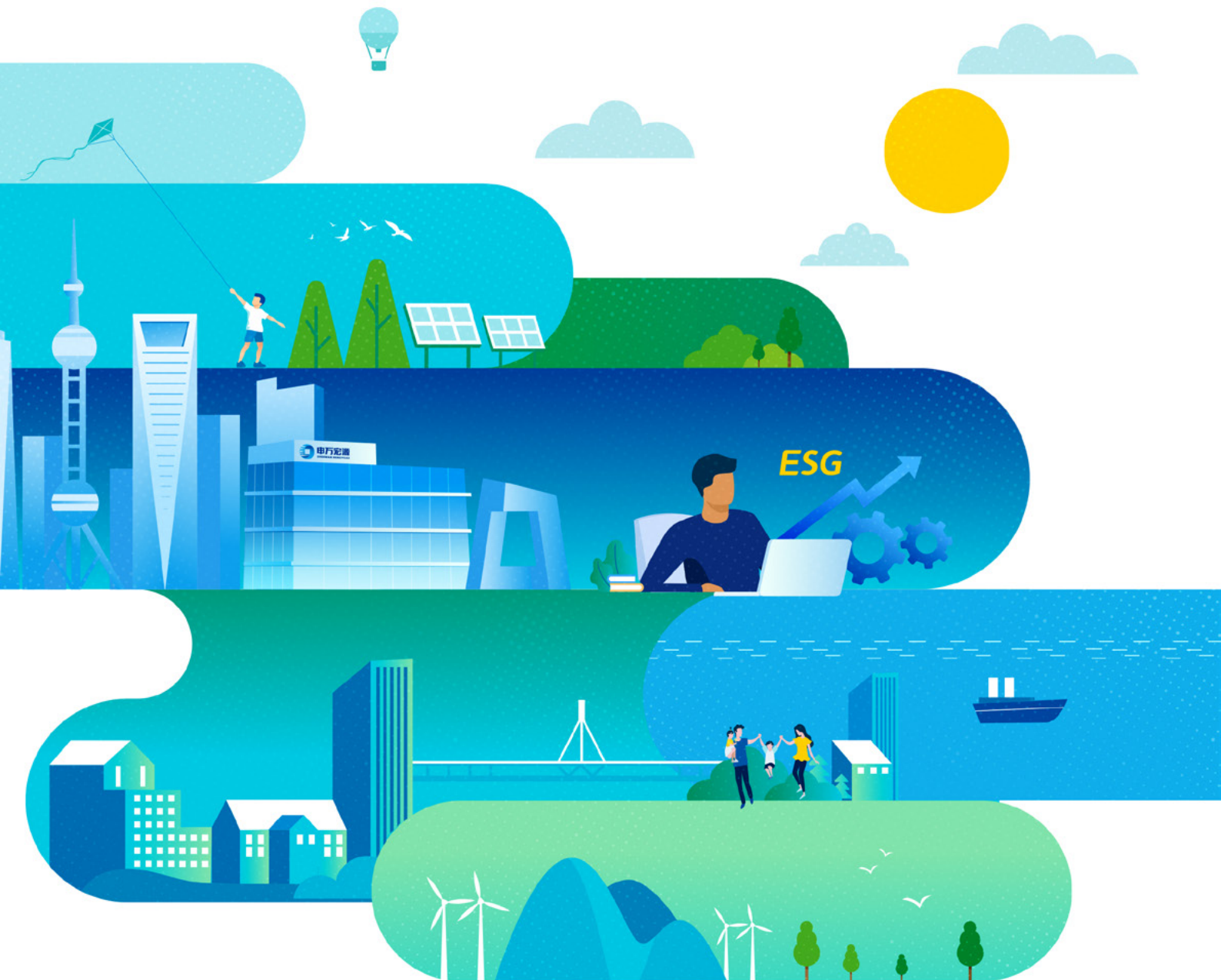




# 2023

## 申万宏源集团股份有限公司 可持续发展暨环境、社会及管治报告



# 目录 CONTENTS

|                 |    |
|-----------------|----|
| 董事会声明           | 01 |
| 关于申万宏源集团        | 03 |
| ESG 治理与管理       | 05 |
| 利益相关方沟通及实质性议题分析 | 07 |

## 可持续发展篇 实践与影响

### 强化担当，支持服务国家战略

|           |    |
|-----------|----|
| 服务“五篇大文章” | 15 |
| 深化金融改革    | 26 |
| 支持区域发展    | 27 |

### 稳中求进，提供高质量金融服务

|            |    |
|------------|----|
| 优化金融服务     | 32 |
| 助力防范化解金融风险 | 34 |
| 保障投资者权益    | 35 |

### 唯实求新，培育可持续发展生态

|        |    |
|--------|----|
| 应对气候变化 | 39 |
| 践行责任投资 | 43 |
| 助力乡村振兴 | 46 |

### 以人为本，建设一流人才队伍

|        |    |
|--------|----|
| 强化人才引进 | 51 |
| 赋能员工发展 | 52 |
| 深化员工关怀 | 55 |

|             |    |
|-------------|----|
| ESG 量化指标绩效表 | 83 |
| 荣誉及奖项       | 88 |
| 对标索引表       | 90 |
| 独立鉴证报告      | 95 |
| 关键数据编报基础    | 98 |
| 报告编制说明      | 99 |

## ESG 篇 管理与绩效

### 公司治理议题

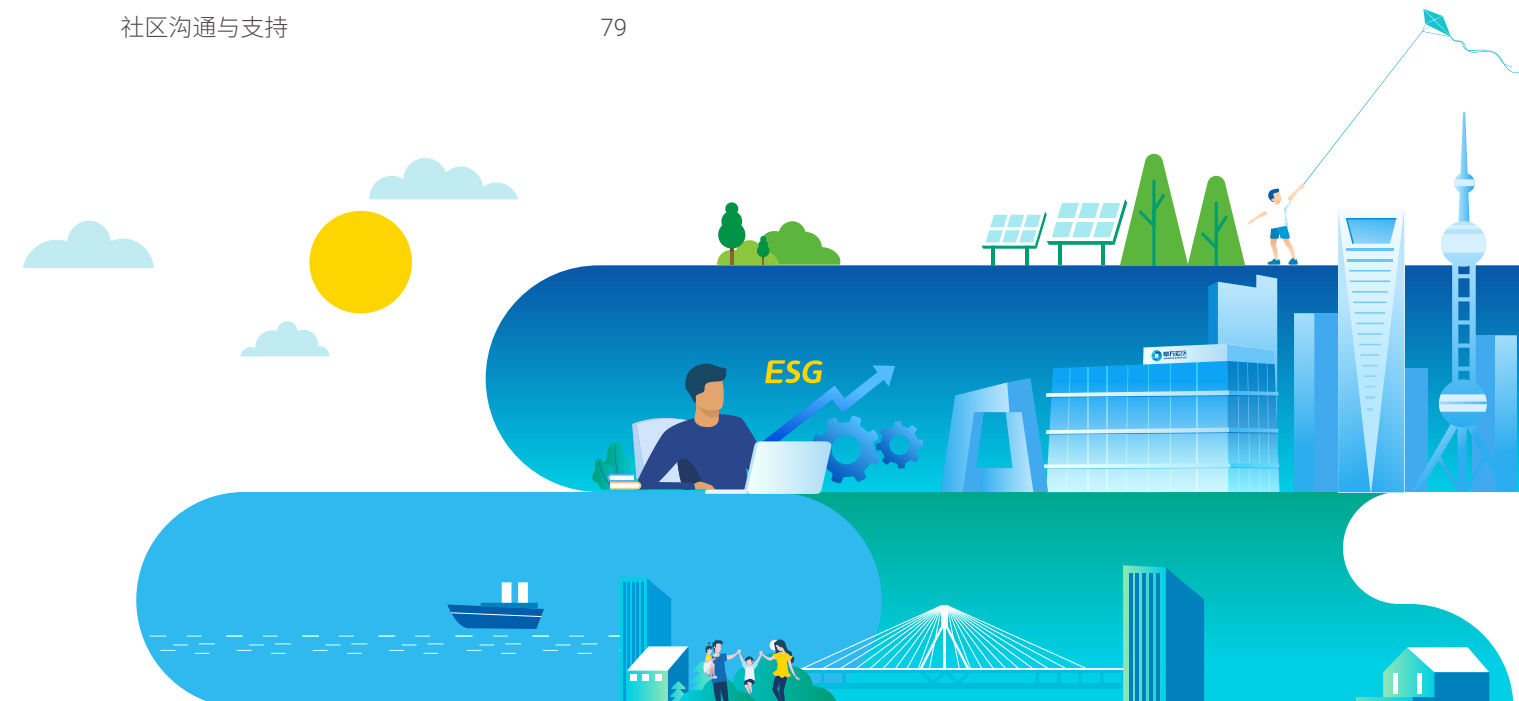
|            |    |
|------------|----|
| 加强党的全面领导   | 59 |
| 公司治理       | 59 |
| 股东及债权人权益保障 | 60 |
| 全面风险管理     | 61 |
| ESG 风险管理   | 64 |
| 合规管理       | 65 |
| 商业道德       | 66 |

### 社会议题

|             |    |
|-------------|----|
| 客户权益保障      | 70 |
| 强化数据安全与隐私保护 | 71 |
| 员工权益与福利     | 73 |
| 员工考核与晋升     | 76 |
| 责任采购        | 78 |
| 社区沟通与支持     | 79 |

### 环境议题

|          |    |
|----------|----|
| 能源及碳排放管理 | 81 |
| 水资源管理    | 82 |
| 废弃物管理    | 82 |





# 董事会声明

2023 年是贯彻党的二十大精神的关键之年，是实施“十四五”规划承前启后的关键一年，也是全面建设社会主义现代化国家的重要一年。申万宏源积极落实中央金融工作会议关于加快建设金融强国的总体部署要求，坚持思想、政治和行动的高度统一，通过积极践行 ESG 理念，不断完善公司 ESG 管理体系，持续围绕 ESG 重点领域开展实践行动，切实提升公司 ESG 绩效，致力于实现公司可持续发展，推动我国金融高质量发展。

**夯实 ESG 治理根基。**良好的 ESG 治理架构和管理机制是公司可持续发展的基石，公司将 ESG 管理与企业发展战略相结合，建立“董事会-董事会战略与 ESG 委员会-ESG 管理领导小组”三层 ESG 管理架构，形成自上而下高效运作的组织架构。董事会是公司 ESG 管理的最高决策机构，对公司 ESG 战略目标、规划和重大事项行使决策权和监督权；董事会战略与 ESG 委员会负责研究公司 ESG 相关规划、目标、制度及重大事项，为董事会提供 ESG 战略相关咨询建议，负责检查 ESG 工作落地执行情况；ESG 管理领导小组负责统筹公司及所属子公司相关部门开展 ESG 行动实践。2023 年，公司董事会继续指导和推动管理层、经营层健全 ESG 管理体系，研究推进《申万宏源 ESG 管理提升行动方案 2.0》，进一步提升公司 ESG 管理水平。

**加强 ESG 重点领域行动实践。**2023 年，公司结合国家宏观政策、行业相关政策、资本市场 ESG 关注点、公司发展实际，对利益相关方开展调研，以明确公司可持续发展重点领域，最终总结出 25 项实质性议题，并筛选出服务国家战略与支持实体经济、客户权益保障、应对气候变化等 13 项高实质性议题。报告期内，公司将可持续发展重点领域融入公司 ESG 管理提升行动方案，明确以“打造可持续运营”为基石，以“服务国家战略与支持实体经济”“提供高质量金融服务”“赋能绿色低碳发展”为三大支柱的 ESG 行动实践框架，并在公司运营及业务实践中，以 ESG 实质性议题为抓手，聚焦可持续发展重点领域，持续推动落实相关行动实践。

**切实提升公司 ESG 绩效。**董事会对公司 ESG 战略目标具有决策权和监督权。公司已围绕员工雇佣及培训、能源及碳排放管理、水资源及废弃物管理等多项议题，建立管理指标与目标，并依托信息化系统建立起 ESG 绩效管理体系，实现线上统一填报与分析，定期追踪目标实现进度。2023 年，公司修订完善《申万宏源关于进一步提升服务国家战略能力的行动方案》，围绕“服务国家科技自强”“支持区域重大发展战略”“服务绿色发展战略”“发展普惠金融”等方面制定管理目标与指标，并采取定量的评价体系，建立起对应考核体制、指标动态监测机制和工作信息跟踪统计机制，切实提升公司 ESG 绩效。

本报告详尽披露公司 2023 年可持续发展暨 ESG 工作的进展与成效，于 2024 年 3 月 21 日经董事会战略与 ESG 委员会审议通过，于 2024 年 3 月 28 日经董事会审议通过。



## 关于申万宏源集团

### 公司概况

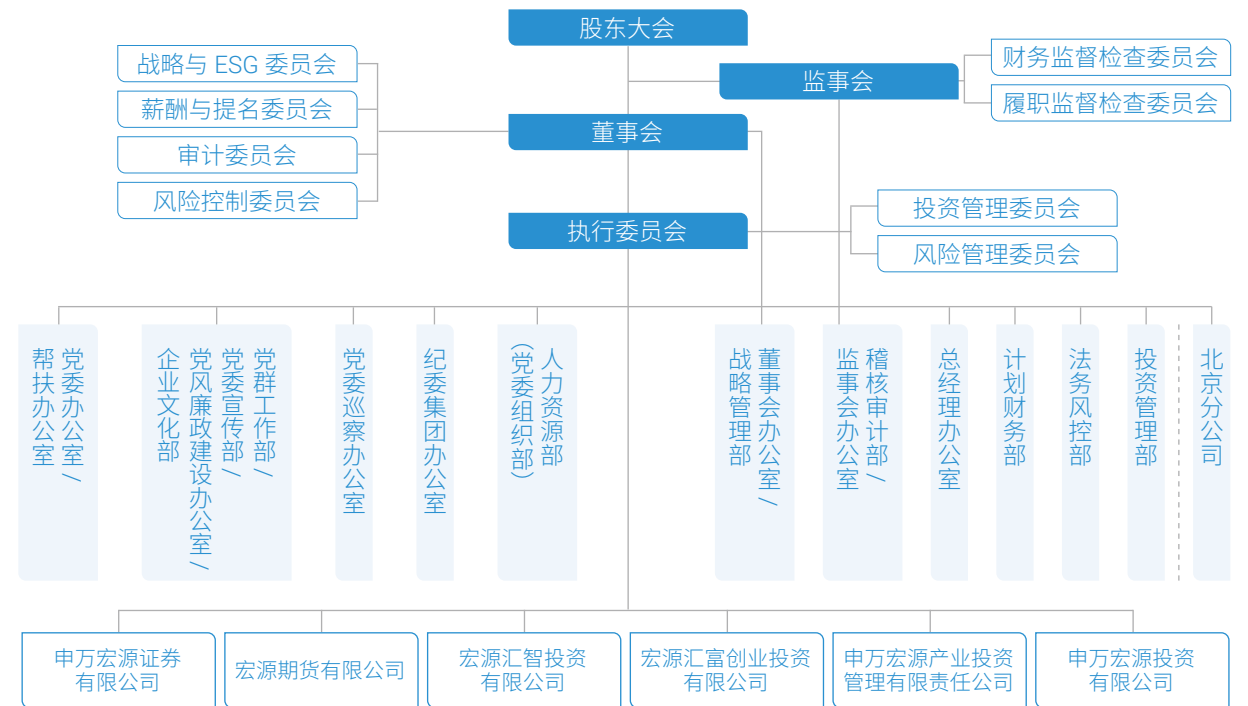
申万宏源集团股份有限公司（以下简称“公司”“申万宏源”“申万宏源集团”）是中央汇金投资有限责任公司控股的投资控股集团，由原申银万国证券股份有限公司与原宏源证券股份有限公司于 2015 年 1 月合并而成。公司始终坚持把可持续发展融入自身发展理念和发展实践之中，依法合规经营，积极为股东、客户创造价值，帮助员工实现自我价值，努力践行为实体经济服务的崇高使命，积极打造“有信仰、敢担当”的国有一流投资控股集团。

### 公司基本信息

|   |            |   |
|---|------------|---|
|    | 公司名称       | 申万宏源集团股份有限公司  |
|    | 英文名称       | Shenwan Hongyuan Group Co., Ltd.                    |
|   | 总部地址       | 北京市西城区太平桥大街 19 号<br>新疆乌鲁木齐市高新区北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 |
|  | 全资 / 控股子公司 | 申万宏源证券、宏源期货、宏源汇智、宏源汇富、申万宏源产业投资、申万宏源投资等              |
|  | 股票代码       | 000166（深交所）；6806（香港联交所）                             |



### 公司治理架构图



截至 2023 年末，公司及所属证券类子公司共设立证券分公司 54 家；证券营业部 298 家，分布于 21 个省、4 个直辖市、4 个自治区的 127 个城市，在长三角和新疆地区营业部数量占据行业优势，其中，上海地区证券营业部 61 家，新疆地区证券营业部 42 家，其他地区证券营业部 195 家。

### 公司业务

公司充分利用“投资控股集团 + 证券子公司”的双层架构优势，不断巩固和提升证券业务行业地位，并围绕证券业务加强投资业务布局，打造综合金融服务闭环，持续构建以资本市场为依托的投资与金融服务全产业链，为客户提供多元化的金融产品及服务。

| 企业金融                                      |   | 个人金融   | 机构服务及交易                      | 投资管理                           |
|---|---|--|------------------------------|--------------------------------|
| <b>投资银行</b><br>• 股权融资<br>• 债权融资<br>• 财务顾问 | <b>本金投资</b><br>• 股权投资<br>• 债权投资<br>• 其他投资 | • 证券经纪与期货经纪<br>• 融资融券<br>• 股票质押式融资<br>• 金融产品销售 | • 主经纪商服务<br>• 研究咨询<br>• 自营交易 | • 资产管理<br>• 公募基金管理<br>• 私募基金管理 |

## ESG 治理与管理

### ESG 治理架构

公司建立“董事会-董事会战略与 ESG 委员会-ESG 管理领导小组”三层 ESG 管理架构，从治理、管理到执行自上而下高效运作，以实际行动推动 ESG 管理目标实现。

#### 申万宏源 ESG 治理架构

##### 董事会

公司 ESG 管理的最高决策机构，依规履行 ESG 治理职能，持续完善治理架构，推动公司不断提升 ESG 治理能力和水平。

##### 董事会战略与 ESG 委员会

向董事会提供 ESG 战略相关咨询建议，监督和评估公司对 ESG 战略的执行情况及目标完成进度，监督公司加强与投资者、监管机构以及其他利益相关方沟通，为公司 ESG 管理的持续改进提供咨询建议。

##### ESG 管理领导小组

负责统筹部署并执行公司 ESG 相关工作，带领公司各部门及子公司落实公司 ESG 发展战略，以 ESG 理念指导公司治理，提升公司可持续发展能力。

2023 年，公司召开董事会战略与 ESG 委员会会议，审议了《申万宏源集团股份有限公司 2022 年度社会责任报告 / 环境、社会及管治报告》，并听取《申万宏源 2022 年服务国家战略工作情况汇报》。公司董事会审议通过《申万宏源集团股份有限公司 2022 年度社会责任报告 / 环境、社会及管治报告》，并于 2023 年 3 月 30 日依规对外披露，以高质量信息披露促进 ESG 管理提升。

### ESG 管理提升行动方案

公司积极践行 ESG 理念，坚决履行好作为大型国有金融企业的责任和资本市场“看门人”角色。公司董事会继续指导和推动经营层，对标国家“十四五”规划，积极关注各项议题，将 ESG 管理、气候议题管理纳入《申万宏源 2021-2025 年发展规划纲要》，并持续完善服务“双碳”目标的工作机制，助力丰富资本市场绿色生态发展，切实在公司发展中全面、系统、准确落实“十四五”时期我国发展的主要目标、战略任务及可持续发展的各项要求。同时，公司积极服务重大区域协调发展、“碳达峰、碳中和”等国家战略，全面落实金融工作任务，强化普惠金融、绿色金融理念，提升服务实体经济能力。

2023 年，在前期充分的政策分析、同业调研及内部讨论的基础上，公司研究推进《申万宏源 ESG 管理提升行动方案 2.0》，推动 ESG 管理迈入新的发展阶段。ESG 管理提升行动方案由三层构成，即通过“一大基石”和“三大支柱”来支持公司整体 ESG 愿景的实现。公司以“打造可持续运营”为基石，以“服务国家战略与支持实体经济”“提供高质量金融服务”“赋能绿色低碳发展”为三大支柱，在筑牢公司可持续发展基石的基础上，依托专业金融服务，扩大申万宏源金融服务对外部的积极影响，以实现公司“简单金融 成就梦想”的愿景，满足国家、社会、客户、股东和员工等利益相关方的期望。

#### 申万宏源 ESG 管理提升行动方案框架



## 利益相关方沟通及实质性议题分析

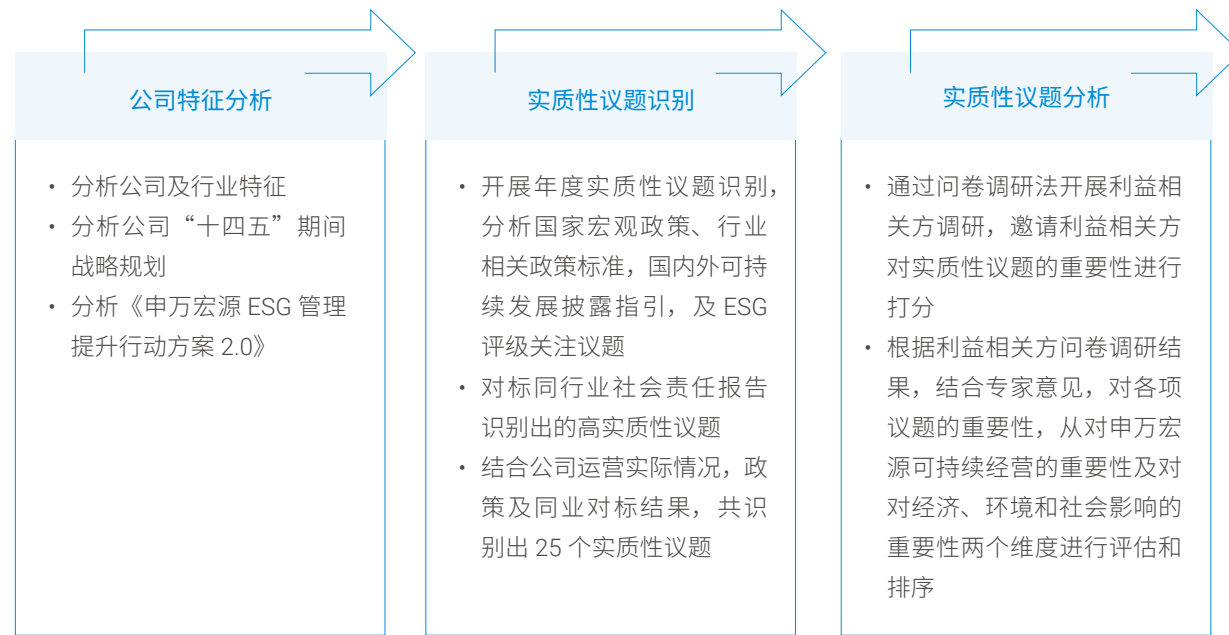
### 利益相关方沟通

利益相关方的需求与期望是公司研究推进 ESG 管理提升行动方案、开展 ESG 管理与信息披露的核心考量因素。2023 年，公司聚焦股东及债权人、政府及监管机构、客户、员工、供应商及合作伙伴、社区代表与公益组织六大利益相关方，积极开展沟通与调研，并把各利益相关方的诉求纳入运营和决策过程中，努力为各方创造可持续的综合价值。

| 关键利益相关方 | <br>股东及债权人   | <br>政府及监管机构                                   | <br>客户   | <br>员工                                | <br>供应商及合作伙伴          | <br>社区代表与公益组织<br>(媒体、合作高校、行业组织、社会组织)                                       |
|---------|---|--|---|--|--|---|
| 关注的议题   | <ul style="list-style-type: none"> <li>加强公司治理</li> <li>股东及债权人权益保障</li> <li>全面风险管理</li> <li>ESG 风险管理</li> <li>合规内控管理</li> <li>保护知识产权</li> <li>商业道德</li> </ul>              | <ul style="list-style-type: none"> <li>服务国家战略与支持实体经济</li> <li>助力乡村振兴</li> <li>社区沟通与支持</li> <li>合规内控管理</li> <li>商业道德</li> </ul> | <ul style="list-style-type: none"> <li>服务国家战略与支持实体经济</li> <li>助推资本市场改革发展</li> <li>金融科技赋能</li> <li>践行责任投资</li> <li>提供优质产品及服务</li> <li>强化数据安全与隐私保护</li> </ul> | <ul style="list-style-type: none"> <li>加强员工关怀与福利</li> <li>员工培训与发展</li> <li>人才吸引与保留</li> <li>保障员工健康与安全</li> </ul>         | <ul style="list-style-type: none"> <li>保护知识产权</li> <li>商业道德</li> <li>责任采购</li> </ul>                     | <ul style="list-style-type: none"> <li>助推资本市场改革发展</li> <li>践行责任投资</li> <li>发展绿色金融</li> <li>应对气候变化</li> <li>促进绿色运营</li> <li>助力乡村振兴</li> <li>社区沟通与支持</li> </ul> |
| 沟通方式与渠道 | <ul style="list-style-type: none"> <li>股东大会</li> <li>公司治理机制建设</li> <li>信息披露及投资者沟通</li> <li>路演和调研</li> <li>完善风险管理体系建设</li> <li>对客户开展 ESG 尽职调查</li> <li>商业道德制度建设</li> </ul> | <ul style="list-style-type: none"> <li>开展信息披露</li> <li>政策解读与执行</li> <li>参与政府调研活动</li> </ul>                                    | <ul style="list-style-type: none"> <li>客户服务及投诉处理机制</li> <li>投资者教育基地建设</li> <li>发布客户隐私保护政策</li> <li>发布负责任投资策略</li> <li>开展客户满意度调查</li> </ul>                  | <ul style="list-style-type: none"> <li>员工招聘机制</li> <li>员工培训体系</li> <li>薪酬福利体系</li> <li>职工代表大会</li> <li>各类文化活动</li> </ul> | <ul style="list-style-type: none"> <li>日常沟通</li> <li>行业合作交流</li> <li>招投标活动</li> <li>反商业贿赂制度建设</li> </ul> | <ul style="list-style-type: none"> <li>参与政府调研及行业研究</li> <li>乡村振兴项目</li> <li>绿色低碳运营</li> <li>创新绿色金融产品</li> <li>在运营地所在社区开展志愿活动</li> </ul>                       |

## 实质性议题分析

### 申万宏源实质性议题分析流程



2023 年，公司结合国家宏观政策、行业相关政策、资本市场 ESG 关注点、公司发展实际等方面，参考利益相关方调研、行业专家判断等，开展实质性议题识别与分析。较 2022 年度，实质性议题主要变动如下：

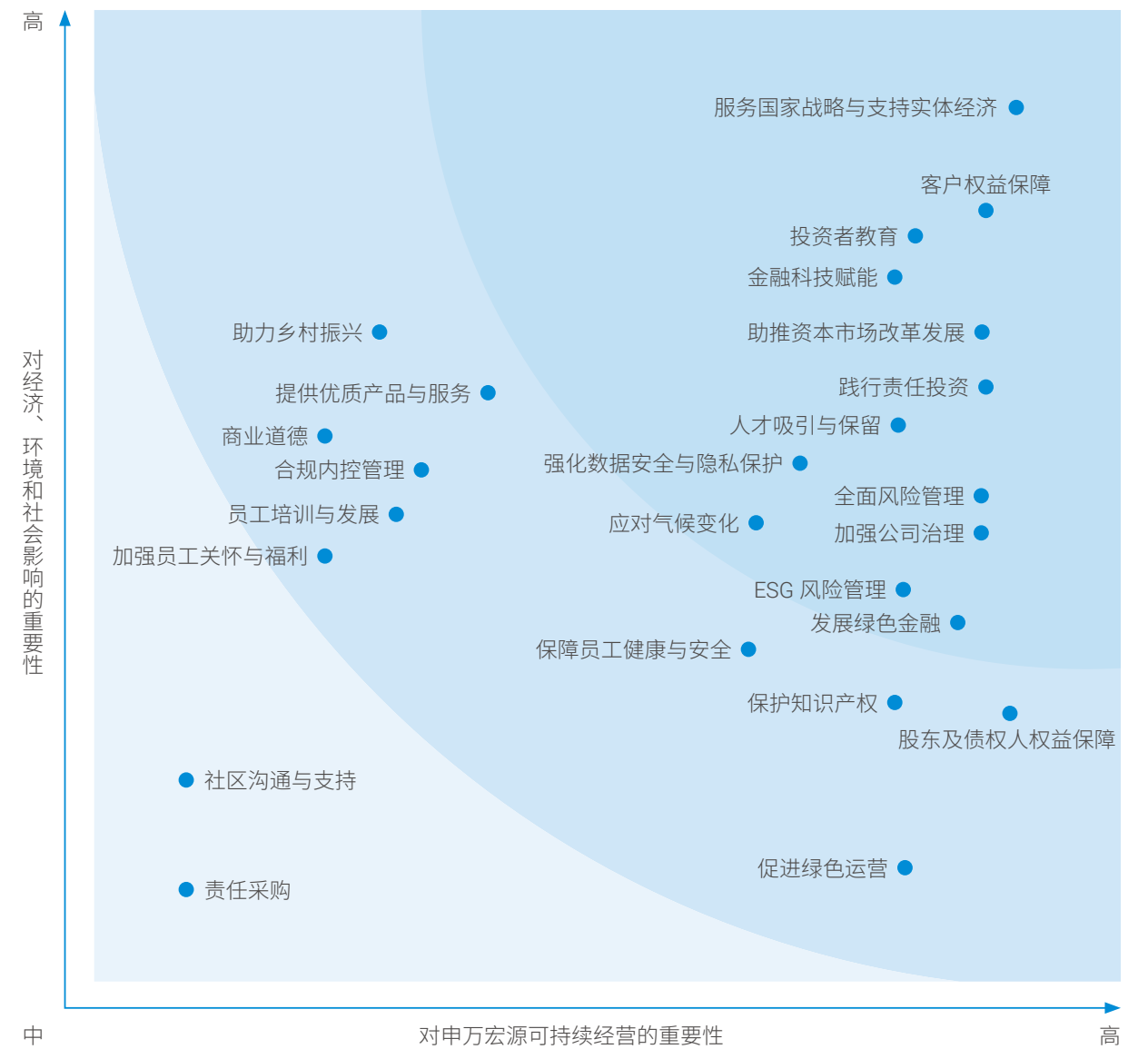
#### 落实中央金融工作会议精神，整合新增议题

公司将“支持区域协调发展”“发展普惠金融”整合至“服务国家战略与支持实体经济”议题，新增“助推资本市场改革发展”议题，并将“乡村振兴与公益慈善”拆分为“助力乡村振兴”及“社区沟通与支持”两个议题。

#### 满足监管要求，回应资本市场关注重点

公司将“股东及债权人权益保障”从“公司治理”议题中拆分出来，新增“ESG 风险管理”议题，整合“助力‘双碳’目标”至“应对气候变化议题”，回应 MSCI 等外部评级机构的关注点。

### 申万宏源实质性议题矩阵



# 可持续发展篇

## 实践与影响

- 强化担当，支持服务国家战略
- 稳中求进，提供高质量金融服务
- 唯实求新，培育可持续发展生态
- 以人为本，建设一流人才队伍





# 强化担当，支持服务国家战略

中央金融工作会议指出，高质量发展是全面建设社会主义现代化国家的首要任务，要以金融高质量发展助力强国建设和民族复兴。

作为“有信仰、敢担当”的国有金融企业，公司严格落实国家关于加快建设金融强国、推动金融高质量发展的总体部署要求，聚焦重大战略、重点领域和薄弱环节，落实服务国家战略与支持实体经济，持续深化金融改革，积极支持区域发展，做好“五篇大文章”，当好服务实体经济的主力军和维护金融稳定的压舱石。

### 本章重点议题

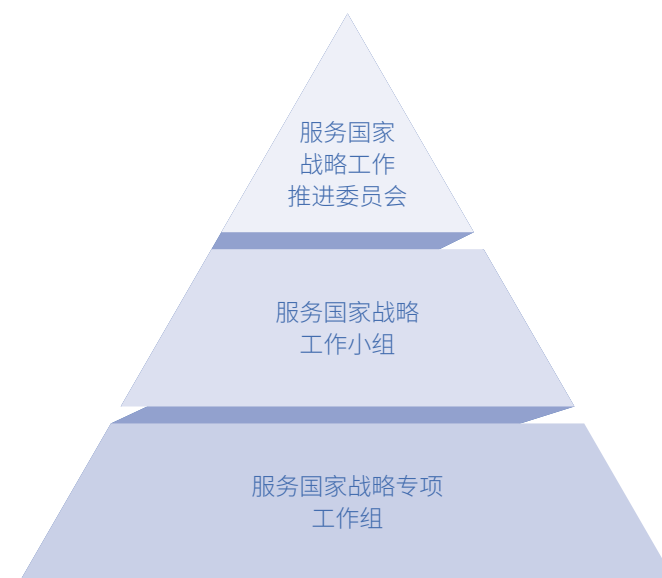
- 服务国家战略与支持实体经济
- 助推资本市场改革发展
- 发展绿色金融
- 金融科技赋能



2023 年，公司修订完善《申万宏源关于进一步提升服务国家战略能力的行动方案》，为进一步提升服务国家战略、服务实体经济能力指明方向和路径，明确要落实“创新、协调、绿色、开放、共享”的发展理念；并制定形成《申万宏源 2023 年度服务国家战略工作计划》，压实责任链条，切实推动服务国家战略融入公司经营管理的各方面各环节。

此外，为更好地服务国家战略、服务实体经济，公司建立了“传达学习——部署落实——追踪问效——考核评价——监督问责”的闭环管理机制，形成“服务国家战略工作推进委员会——服务国家战略工作小组——服务国家战略专项工作组”的三级管理模式，为进一步提升服务国家战略能力提供更加坚实有力的保障。

### 申万宏源“服务国家战略”管理架构



## 服务“五篇大文章”

### 深化科技金融

公司坚决贯彻落实中央金融工作会议要求，积极做好“科技金融”大文章，持续提升投行、投资及投研对科技创新的综合服务能力，以服务科技创新企业为抓手，通过支持科创企业融资，布局创新产业投资等方式，加快培育科技创新型产业、战略性新兴产业发展壮大，实现创新驱动发展。

#### 申万宏源 2023 年度做好科技金融重点实践



#### 支持科创企业融资

- 通过股权融资、债权融资、财务顾问等金融服务，为各类科技创新型、战略型新兴产业提供融资支持。
- 2023 年，公司助力华丰科技、光云科技、安集微电子、润本生物等企业进行股权融资，并助力电建股份、广晟控股等企业成功发行科技创新债券。



#### 布局创新产业投资

- 通过直接股权投资及债权投资、设立产业投资基金等方式，支持“专精特新”企业、“卡脖子”领域、战略新兴产业、前沿科技企业发展，引导更多境内外长期资金流入科技创新领域。
- 2023 年，公司聚焦新能源、新材料、智能制造等领域，完成对积塔半导体、金雷股份、华瑞微等多个具有科创属性企业的股权投资，并设立烟台国丰申万航天投资基金、新能源产业基金等多个科创基金。

#### 2023 年度，公司深化“科技金融”亮点绩效：

在服务国家科技自强方面，截至 2023 年末，公司通过自有资金或管理资管产品投资相关企业 / 项目资金 383.72 亿元；2023 年，共计完成 16 单科创企业相关股权融资项目，融资规模共计 122 亿元，助力发行科创债共计 33 只，承销规模 111.09 亿元。

#### 申万宏源 2023 年度科技金融亮点案例

##### 助力华丰科技上交所科创板上市

2023 年 6 月，申万宏源承销保荐助力四川华丰科技股份有限公司（简称“华丰科技”）成功在上交所科创板上市，帮助华丰科技成为中国科技城绵阳首家科创板上市公司。该项目中，宏源汇富管理的申万长虹基金投资 5,000 万元，同时带动申万创新投投资直投 3,000 万元，申万宏源承销保荐独家承销发行，是申万宏源服务核心战略客户、践行“投资 + 投行”战略的又一硕果。

##### 助力杭可科技发行科创板首单 GDR

2023 年 2 月，香港公司作为联席全球协调人助力浙江杭可科技股份有限公司成功发行全球存托凭证（“GDR”）并在瑞士证券交易所挂牌上市。此项目为上交所科创板首单 GDR 项目，是 A 股上市公司积极融入国际资本市场的典型案例，也是公司利用国际金融市场为科创企业提供融资服务的有力实践。

##### 设立烟台国丰申万航天投资基金，助力航天强国建设

2023 年 11 月，申万投资发起设立烟台国丰申万航天投资基金，基金总规模 20 亿元，助力烟台市打造中国首个百亿级商业航天高科技产业集群。该基金通过市场化运作方式，精准投资航天产业链上下游企业，推动烟台市商业航天高科技产业集群式发展。

##### 投资积塔半导体，服务国家科技自强战略

2023 年，宏源汇富通过申宏汇创四期及五期基金投资上海积塔半导体有限公司（简称“积塔半导体”）。积塔半导体是一家专注于模拟电路工艺和功率器件工艺的领先晶圆代工厂，产品广泛应用于新能源汽车及绿色能源等行业。此次投资是公司践行服务国家科技自强战略，助力现代化产业体系建设的又一典型实践。

### 发展绿色金融

公司积极落实绿色发展理念，将绿色金融纳入公司发展战略，于 2023 年修订完善《申万宏源关于进一步提升服务国家战略能力的行动方案》，明确要构建市场导向的绿色金融创新服务体系，持续丰富绿色金融服务内涵。公司设立“支持传统产业节能降碳升级、绿色低碳产业发展，完善 ESG 投资，助力‘碳达峰、碳中和’，加快发展方式绿色转型”的发展目标，采取定量的评价体系，明确将“绿色发展领域企业 / 项目支持融资、投资金额”纳入相关业务单位及子公司考核范畴，促进提升绿色金融业务规模，并建立起对应考核体制、指标动态监测机制和工作信息跟踪统计机制，全方位推动落实绿色金融业务管理体系建设。

2023 年，在绿色金融具体实践过程中，公司相关业务部门及子公司结合业务特征，运用多元化金融手段，推进开展绿色融资、绿色投资及碳金融业务，引导资金流向绿色低碳产业，助力绿色低碳转型发展。此外，公司持续加强绿色金融研究，以促进自身及行业绿色金融发展。

## 2023 年度申万宏源绿色金融亮点实践

### 绿色融资

- 深挖“双碳”产业链布局，积极参与绿色债券发行、绿色股权融资，多途径满足绿色低碳企业融资需求。
- 针对绿色债券融资业务，发布《关于进一步调增服务国家战略项目考核收入的通知》及《固定收益融资总部固定收益证券项目立项标准》，进一步提高绿色债券在内部考核占比，明确为绿色债券项目提供绿色通道政策支持。
- 在股权融资方面，助力明阳电气、南王环保、天宏锂电等绿色产业企业成功上市，共计募集资金 39.63 亿元；在债权融资方面，发行绿色债、碳中和债、可持续挂钩债券共计 21 只，总发行规模 1,597.50 亿元；申万宏源资管发行绿色资产证券化产品 3 只，规模 69.32 亿元。

### 绿色投资

- 主动践行 ESG 发展理念，将污染、排放、能耗等环境友好度指标纳入投资决策因素，逐步扩大绿色投资比例，支持传统产业节能降碳升级、绿色低碳技术创新和产业发展。
- 通过自有资金及资管资金开展绿色股权及绿色债权投资。截至 2023 年末，公司绿色股权及绿色债券投资规模为 197.71 亿元。
- 持续推动绿色金融产品、转型金融产品创新。申万宏源证券推出 3 只挂钩“中债 - 申万宏源 ESG 绿色信用债精选指数”产品。申万菱信设立低碳化赛道相关产品共计 6 只，合计管理规模 28.86 亿元。申万宏源资管设立“美好生活碳中和精选集合资产管理计划”主题投资产品规模 615 万元，重点布局新能源、新能源车、新材料等碳中和相关重点产业链。

### 碳金融

- 以碳排放权自营交易业务为抓手，积极拓展碳交易业务。
- 2023 年，申万宏源证券获批自营参与碳排放权交易资格，依托该业务资质，申万宏源证券参与广州碳排放权交易所组织开展的中国核证自愿减排量（CCER）项目等碳金融相关项目。

### 绿色研究

- 充分发挥好智库作用，加强“碳达峰、碳中和”的政策研究和理论研究，并积极参与 ESG 评价体系编制。
- 2023 年，申万研究所发布“双碳”相关研究报告 23 篇，发布 ESG 系列研究报告 12 篇，并发布《绿色金融正当时 迈向扩容大时代——2022 年绿色金融年度报告》，重点提出绿色金融领域 2023 年度十大发展趋势；组建“中国特色 ESG 研究团队”，参与构建央企 ESG 评价体系。
- 申万研究所 ESG 团队获得第 21 届新财富“最佳 ESG 研究机构”第一名。



### 助力华电新能源发行绿色可续期公司债券暨气候债券

2023 年 9 月，由申万宏源证券参与主承销的“华电新能源集团股份有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行绿色可续期公司债券（第一期）（品种一）”成功发行，发行规模 20 亿元，以满足华电新能源绿色产业领域业务发展需要。本期绿色债券获国际气候债券组织（CBI）气候债券认证，是公司助力“双碳”目标的一次重要探索。



### 通过投资绿色中期票据支持绿色低碳发展

2023 年，申万宏源证券通过自有资金投资华能澜沧江水电股份有限公司 2023 年度第十六、十七期绿色中期票据。该项目对应募投项目能够实现二氧化碳减排量为 73.98 万吨 / 年、节约标准煤为 40.99 万吨 / 年、二氧化硫减排量为 113.15 吨 / 年、氮氧化物减排量为 181.3 吨 / 年、烟尘减排量为 23.18 吨 / 年。



### 落地全国最大规模碳中和 CMBS

2023 年，宏源汇智与申万宏源资管协同联动，助力中国金茂成功发行“金茂申万 - 上海金茂大厦 - 鑫悦绿色资产支持专项计划（碳中和）”。该产品总储架规模达 100 亿元，首发单期规模为 30 亿元，创造了全国最大规模的储架碳中和商业抵押支持证券（CMBS）等多个纪录，对促进绿色建筑技术发展、绿色金融市场发展均具有重要意义。



### 落地首个农业类 CCER 项目

申万宏源证券携手外部合作方及武安市益源牧业签署了智能养猪场粪便沼气 CCER 项目合作协议，共同研究推进项目减排量注册签发等工作。此次项目为公司在获得证监会发放的参与碳排放权交易资格后签约的首个 CCER 机制项目，标志着公司在践行国家“双碳”战略方面再次迈出了坚实的一步。



## 发展普惠金融

公司高度重视普惠金融，由公司董事会战略与 ESG 委员会负责指导并监督包括普惠金融在内的 ESG 相关事宜，相关业务部门及子公司通过设立普惠金融总部、服务普惠金融工作组等方式推进普惠金融相关业务开展。

2023 年，公司积极提升普惠金融服务能力，在扩大金融服务覆盖面的同时，综合运用多样化资本市场工具和创新型融资手段，通过为中小微企业提供资金支持、强化风险管理、开展普惠宣讲等方式，持续拓展普惠金融服务广度和深度。

### 2023 年度申万宏源发展普惠金融重点实践

|               |  |
|---------------|--|
| <p>提供资金支持</p> | <ul style="list-style-type: none"> <li>持续推进新三板、北交所业务，服务中小微企业融资需求，并针对经营困难的中小微企业开展减费让利工作，减免持续督导年费，支持中小微企业发展。</li> <li>通过直接股权投资、设立产业投资基金、投资资产支持专项计划等方式，助力小微企业发展壮大。</li> </ul> |
| <p>助力风险管理</p> | <ul style="list-style-type: none"> <li>充分利用期货期权工具，通过开展“保险+期货”、基差贸易及仓单服务等，帮助中小微企业的生产经营提供价格风险管理，并针对中小微企业期货交易减免手续费。</li> </ul>  |
| <p>开展普惠宣讲</p> | <ul style="list-style-type: none"> <li>在全国各地进行普惠宣讲，与各地政府部门、中小企业协会等深度合作，面向中小微企业围绕全面注册制、上市条件、新三板挂牌、并购重组等资本市场政策开展宣讲。</li> </ul>   |

### 公司“发展普惠金融”亮点绩效：

- 2023 年，公司完成北交所 IPO 承销家数 6 家，行业排名第 1；新三板定向发行及挂牌 53 次，募集资金 11.14 亿元，均排名行业第 2。
- 截至 2023 年末，公司新三板挂牌企业持续督导 570 家，行业排名第 2；累计推荐挂牌企业 849 家，累计为挂牌企业提供定向发行服务 917 次，累计为挂牌企业进行股权融资共 371.29 亿元，均排名行业第 1。北交所开板至今（含精选层转板）累计完成家数 21 家，累计募集资金 40.00 亿元，均排名行业第 2。
- 为 10 家中小企业提供融资服务，融资规模共计 30.98 亿元；为 76 家经营困难的中小企业减免持续督导年费，合计减免 549.30 万元。
- 发行普惠金融类债券 20 只，总发行规模 866.39 亿元。
- 截至 2023 年末，公司通过自有资金或管理的资管产品投资中小微企业等普惠金融领域金额为 775.20 亿元。



### 助力久正工学新三板挂牌

2023 年 2 月，申万宏源承销保荐助力南通市久正人体工学股份有限公司（简称“久正工学”）成功在全国中小企业股份转让系统挂牌。久正工学是一家专业从事人体工学家具产品设计、研发、生产与销售的高新技术企业，已入选工信部公布的第四批国家级专精特新“小巨人”企业名单。久正工学的成功挂牌，是申万宏源承销保荐服务优质中小企业、支持中小微企业做优做强的典型实践。



### 助力上海银行 100 亿元小微金融债成功发行

2023 年 10 月，由申万宏源证券主承销的“上海银行股份有限公司 2023 年第一期小型微型企业贷款专项金融债券”成功发行，发行规模 100 亿元。本期债券募集资金专项用于发放小型微型企业贷款，加大对小型微型企业信贷支持力度，推动小型微型企业稳健、健康发展。



### 投资单一资金信托，保障小微企业经营周转

2023 年 7 月，宏源汇智投资国民信托天玑 36-9 号单一资金信托（中投保小微及时贷信托投资项目 2 期）1 亿元。该项目通过阶段性贷款的形式，为小微客户提供周转资金，有效降低小微企业的融资成本。



## 助力养老金融

积极布局养老金融业务，既是金融机构响应国家政策导向、服务社会民生需求的必然之举，也是实现自身业务转型升级的重要途径。申万宏源以服务养老金融为抓手，为养老、社保等机构客户提供多元化的资产配置服务，积极创设更为丰富的养老金融产品，鼓励投资者关注和加大养老投资，掌握更为丰富的养老金融知识。

申万宏源 2022 年 12 月起开展个人养老金业务。自展业以来，公司积极开展相关业务培训，产出相关营销材料包括海报、单页、营销手册、视频等百余篇。基于个人养老金基金销售业务的强投教属性，公司采取线上线下相结合的方式开展投资者教育，并推出养老系列课程《小诸葛养老课堂》。通过在公司网站、移动客户端等终端开立养老专区、不定期举办客户活动、宣传品发放等形式，宣传推广养老金投资理念、个人养老金制度，加强投资者对个人养老金制度的理解。



《小诸葛养老课堂》养老系列课程

申万宏源研究团队重视养老金融研究，长期紧密跟踪个人养老金相关动态，深入解读中国个人养老金的发展模式并提出建议，撰写养老金融研究系列报告及点评共 23 篇，内容覆盖了海外个人养老金业务；国内保险养老产品、银行理财养老产品、公募养老 FOF 的比较、国内个人养老金业务开展的展望和建议；定投模式对养老投资模式的影响等方面。



### 申万菱信立足专业投资，服务国家第三支柱养老体系建设

申万菱信立足专业投资，切实发挥投资及产品供给功能，积极服务国家第三支柱养老体系建设。

申万菱信推动公司研发布局不同持有期限和配置策略的养老 FOF 产品，满足不同渠道需求。2023 年，申万菱信在稳健养老和养老目标 2040 产品基础上，新增布局养老目标 2045 个人养老 FOF 产品，年内业绩排名同组别第一名。

申万菱信立足主责主业，切实提升配置投资能力。2023 年，基于前期 KAP 建设应用的良好成果，3 只养老产品业绩名列前茅。在 2023 “东方财富风云榜”中，荣获“年度营销创新基金公司”及“年度优秀养老投教服务”两大奖项。

## 加强数字金融

公司积极贯彻落实中央金融工作会议关于做好“数字金融”的要求，制定形成“12349”金融科技规划，明确提出要全面转型数字化、深入推进平台化、积极部署智能化，进一步增强金融科技应用能力，实现金融与科技深度融合，重点推动云计算、大数据、人工智能、移动互联网等创新技术在客户服务、证券投资、量化交易、风险管理等领域的创新与应用，以实现客户服务提质增效、业务创新灵活高效、经营管理协同提效的赋能目标。

### 申万宏源“12349”金融科技规划

- 1 以一张金融科技五年规划为蓝图
- 2 以交易 + 数据为双轮驱动
- 3 以数字化、平台化、智能化三大能力建设为核心
- 4 以“基础设施、数据治理、体制机制及人才队伍、金融科技生态体系”四大基础支撑为保障
- 9 赋能公司财富管理、投资银行、投资业务、机构业务、自营做市、资产管理、国际化、运营风控、内部管理等九大业务及管理领域

为了有效落实公司金融科技规划目标，全面支撑和赋能公司各项业务发展，公司不断夯实数字金融基础设施建设，优化公司数字化体制机制，加大金融科技研发投入及研发人才引进。2023 年，公司编制完成《申万宏源集团及子公司信息系统一体化规划建设工作方案》，并启动信息技术制度体系和流程完善工作，编制信息技术制度图谱，发布《软件研发管理办法》《架构评审管理细则》《上云策略指引》等制度规范。

- 新增引进 72 名研发人才，已建成一支 321 人的金融科技研发团队。
- 2023 年，公司在金融科技相关专利申请 3 件，专利授权 1 件。

2023 年，公司积极落实金融科技子战略，完成金融科技子战略执行中期评估，进一步优化完善顶层设计，并通过优化平台建设、提升管理效能、完善数据治理等方面，持续推进金融科技布局。

2023 年度申万宏源“推进金融科技布局”亮点实践



2023 年，公司持续推动数字化、智能化研发成果转化，高效响应各金融业务需求，推进科技赋能财富管理业务、机构业务、投行业务等八大金融业务发展，以具有竞争力的数字金融服务为抓手，促进业务提质增效。

2023 年度申万宏源“科技赋能业务”亮点成果







### 申财有道 APP 成功上线

2023年,公司完成申财有道项目一期的整体开发、测试和上线工作。申财有道APP基于移动开发平台自研,实现了“以客户为中心”及数字化、国际化、智能化的建设目标。公司在开展项目研发时,对APP视觉、交互贴合客户需求进行全新设计;立足国际化布局,在实现港股实时行情接入的同时,将美股、全球指数等纳入规划;通过决策辅助、智能交易、智能资讯等提供全市场证券投资服务;通过智能定投、基金投顾、资产配置、账户分析等提供专业的财富管理服务;通过客户行为分析、客户分级、标签,利用大数据、云计算和机器学习等科技手段,实现对用户“千人千面”的个性化服务。

2023年,公司积极参与行业、监管部门以及上级主管部门金融科技相关课题及创新试点,荣获34个科技奖项,其中9个省部级奖项,8个地市级奖项,11个行业级奖项,6个媒体级奖项。具体奖项如下(部分):

- “基于云原生架构的新一代数据仓库平台”获得中国人民银行金融科技发展奖二等奖。
- “5G消息证券服务新渠道项目”获科创中国金融科技创新大赛三等奖。
- “申万宏源e家”APP获全国总工会“2023年互联网+工会普惠服务优秀平台——创新型平台”。
- “申万宏源在敏态研发体系方面的探索和实践”获得中国国际服务贸易交易会创新案例。



## 深化金融改革

深化金融改革有助于加强和完善现代金融监管,强化金融稳定保障体系。2023年,公司坚持金融国企站位,积极发挥金融专业优势,基于申万宏源特色“新型智库”,通过强化宏观政策内参服务、为金融监管提供决策支持、推进地方政府金融改革等方式,助力深化金融体制改革,促进金融市场健康有序发展。

### 强化宏观政策内参服务

- 持续为政府机构提供宏观政策研究服务,2023年,申万研究所为全国政协、发改委外资司、国务院发展研究中心等机构共计提供12篇研究报告。

### 为金融监管提供决策支持

- 基于申万宏源特色“新型智库”,积极参与证监会、交易所、证券业协会等机构主持的课题研究,为金融监管部门提供决策支持,助力加强和完善金融监管制度,构建适应现代金融市场特点的监管体系。
- 2023年,公司为证监会提供包括“境内外证券行业竞争格局研究”“资本市场助力经济常态化增长”等研究支持;为上交所提供“全面注册制正式来临,网下申购影响几何?——关于全面注册制配套规则正式稿的深度解读”等专题研究分析;参与证券业协会多项课题研究。

### 推进地方政府金融改革

- 积极响应各地金融体制改革需求,为各地政府提供研究支持,助力推动地方政府金融改革。
- 2023年,公司围绕经济活力提振、经济金融市场稳定、商贸服务主体培育等专题向上海国资委等政府机构提供研究支持;聚焦数字贸易、绿电供给、碳关税等主题开展研究,助力烟台地区发展;通过提供多篇高质量研究报告,加大对新疆、海南等重点区域地方政府服务。



## 支持区域 发展

### 支持区域重大战略

促进区域协调发展是推动高质量发展的重要支撑，也是实现共同富裕的内在要求。公司坚持区域聚焦，不断深化在京津冀、长三角、粤港澳、大西南、新疆、华中等重点区域的前瞻布局和资源投入，成立区域工作委员会，与地区政府签订战略合作协议，并通过股权融资、债券融资、设立私募股权基金等方式，进一步增强区域经济服务能力，不断提高金融服务质效，助力国家重大区域社会经济发展。

- 2023 年，公司累计为重点区域相关企业提供 114.48 亿元的股权融资服务。



### 提供综合金融服务，全面助力粤港澳大湾区发展

公司高度重视粤港澳大湾区业务发展，已在大湾区布局超过 200 人专业投行团队，协同广东分公司、深圳分公司等属地机构全力深耕大湾区综合金融服务。2020 年至 2023 年末，公司在广东地区已完成 11 单 IPO 项目，为广东地区 20 家企业提供 216.47 亿股权融资承销服务，完成 9 单新三板挂牌项目，在深圳、珠海、佛山组建三只私募股权基金，全面致力于提高广东省优质企业直接融资比例。

2023 年，申万宏源承销保荐作为主办券商，成功助力广东企业天佑物流股份有限公司在全国中小企业股份转让系统挂牌，是公司支持粤港澳大湾区发展的又一有力实践。

2023 年完成总部位于广州市的润本股份沪市主板 IPO 项目，募集资金总额为 10.55 亿元，助力优质国货品牌发展。

2023 年完成明阳电气创业板 IPO 项目，募集资金总额为 29.76 亿元。阳明电气是国内研发制造输配电及控制设备的骨干企业，广东省新能源电气装备领军企业。



### 成功落地首笔挂钩“CFETS 长三角区域债券指数”互换交易

2023 年，公司达成了市场首笔挂钩“CFETS 长三角区域债券指数”（以下简称“长三角指数”）的互换交易。“长三角指数”是全国银行间同业拆借中心为贯彻长三角一体化发展战略发布的指数。

公司通过开展挂钩“长三角指数”的互换交易，将场外衍生品与长三角一体化发展战略相结合，有效引导资金助力长三角区域一体化发展，为长三角区域内相关地方政府和实体企业拓宽融资渠道作出积极贡献。



### 设立私募股权基金，支持区域经济发展

公司通过联合地区当地政府、企业设立私募股权基金，引导外部资金支持区域经济发展，助力区域产业结构转型升级。

#### 深耕大西南

- 公司持续加大大西南地区业务开拓力度，在区域内累计发起设立及管理私募股权基金 15 支，基金规模 140 余亿元，累计完成股权投资近 50 亿元。
- 2023 年，公司分别与成都产投集团和重庆渝富投资合作，发起设立了成都申宏创融先进制造产业投资基金和四川申虹富渝新兴产业投资基金，规模合计 15 亿元，进一步丰富了投资支持工具，撬动外部资金提升服务大西南能级。

#### 推进长三角一体化发展

- 公司与浙江湖州吴兴国有资本投资发展有限公司合作发起设立湖州吴兴申湖鑫业股权投资基金，基金规模 4.5 亿元，将主要投资于新材料、新能源、集成电路、新能源汽车、智能装备制造。

#### 助力华中区域发展

- 公司与武汉高科集团合作发起设立了武汉市高科申万宏源基础设施投资基金，基金规模 3.95 亿元。基金的底层资产为武汉光谷生物城医疗器械园区的物业资产，已入驻武汉华康世纪医疗股份有限公司、湖北省创新转化医学研究院有限公司等生物医药企业。通过基金投资上述物业资产，有效支持园区内生物医药创新企业的研发和生产。

## 支持“一带一路”建设

2023 年，公司认真贯彻落实党中央、国务院关于高质量共建“一带一路”的要求，深耕新疆支持“陆上丝绸之路核心区”建设，加强融资支持和项目投资，积极探索创新服务手段，促进地区资金融通，并持续加强“一带一路”相关研究，为“一带一路”高质量发展作出新贡献。

- 2023 年，公司助力发行“一带一路”相关债券共计 48 只，发行规模 1,183.9 亿元。

## 申万宏源高质量共建“一带一路”主要亮点实践

### 支持新疆建设

- 强化新疆布局优势，支持新疆企业进入资本市场。创新“保险+期货”等业务模式，支持新疆传统产业、企业加强风险管理。
- 2023 年，承销保荐助力新疆宝地矿业股份有限公司在上交所主板成功上市，支持中基健康产业股份有限公司并购重组；申万宏源西部证券支持新疆投资发展集团等国有企业开展债券融资项目 24 个，融资规模超 140 亿元，在疆新三板持续督导 8 家企业，并积极推动与新疆股权交易中心等当地机构搭建“专精特新”专板工作。

### 加强“一带一路”融资支持

- 在股权融资方面，鼓励服务“一带一路”建设相关的跨境融资、跨境并购项目承接，促进“一带一路”地区资金融通；在债权融资方面，积极承揽“一带一路”相关债券及熊猫债等业务，同时加强与境外子公司的一体化联动，提高沿线重要节点的金融支持作用。
- 2022-2023 年来，申万宏源证券陆续为重庆临空开发投资集团有限公司（简称“重庆临空投公司”）在深交所、上交所承销三期累计 30 亿元“一带一路”专项公司债券。重庆临空投公司是积极推动重庆市“一带一路”倡议的核心企业。

### 深入开展“一带一路”项目投资

- 加强与“一带一路”核心节点城市的政府平台或重点企业的合作，加强重点领域、重点项目支持力度，服务实体经济参与“一带一路”投资建设及在沿线国家布局。
- 2023 年，申万创新投聚焦智能驾驶、智能选矿等领域，参与易控智驾、好朋友科技股权投资项目；申万投资在投“一带一路”地区股权项目 10 个，为相关企业提供资金支持合计 2.49 亿元。

### 积极探索“一带一路”创新服务手段

- 加强内部业务协同，积极拓展托管服务、大宗交易、大宗商品套期保值服务等多元化金融服务。
- 加快发展跨境财富管理业务，帮助“一带一路”国家的客户拓宽全球资产配置渠道、提高跨境投资的安全性。
- 发挥衍生品及期货业务优势，提供期货和商品场外期权套期保值等金融风险管理方案。
- 积极与境外机构开展战略合作，加大对“一带一路”机构投资者的服务力度。

## 主动加强“一带一路”相关研究

- 强化“一带一路”基础研究，积极发挥“专家智库”力量，为“一带一路”多元金融、海外投资、并购项目提供智力支持。
- 2023 年 10 月，申万研究所发布“一带一路”白皮书《十年“带路”，百年重塑》，详细解读共建“一带一路”对于各产业的发展机遇及对全球产业链产生的重塑性影响。



### 申万宏源举办“申万宏源·2023 新疆能源发展暨一带一路资本论坛”

2023 年 7 月，申万宏源在乌鲁木齐举办“申万宏源·2023 新疆能源发展暨一带一路资本论坛”，邀请来自能源产业和投资界约 300 人参加。

此次论坛重点围绕新疆能源发展战略、新疆能源产业的优势和机遇、新疆能源市场投资机会、探讨新一轮电力体制改革、新能源发展、碳交易、碳金融等话题展开讨论交流，得到新疆自治区金融局、发改委的大力支持。



申万宏源·2023 新疆能源发展暨“一带一路”资本论坛



# 稳中求进， 提供高质量金融服务

金融强国的发展目标对金融业的专业能力、基础功能和服务能力都提出了更高要求。要加快建设金融强国，需要全面加强金融监管，完善金融体制，优化金融服务，防范化解风险。

2023 年，公司不断提升金融服务的效率与水平，持续提高客户服务质量，坚决打好防范化解重大金融风险攻坚战，并持续深化投资者教育。

## 本章重点议题

- 提供优质产品与服务
- 保护投资者权益
- 投资者教育



## 优化金融服务

公司依据“以客户为中心”的经营理念，在为政府、企业及个人客户提供专业化、个性化的金融产品的同时，持续建立健全客户服务体系，并不断强化客户服务能力，提升客户服务质效。

公司已针对不同类型客户开展分级分类管理，建立大客户服务体系，并针对投资机构、政企客户、零售客户实行分类精细化管理。

### ○ 2023 年度申万宏源“提升客户服务水平”重点实践

| 分类分级管理         | 主要内容   |
|----------------|--|
| 大客户（战略客户、核心客户） | <ul style="list-style-type: none"> <li>持续完善大客户服务体系，针对战略客户实施“1+1+1+X”客户经理负责制，即对每个战略客户委派一名首席客户经理、一名战略客户经理、一名客户关系经理，并根据客户综合需要委派若干专业产品经理，组成综合金融服务团队，共同为战略客户提供综合金融服务。</li> <li>建立“融进学堂”品牌的大客户经理培训体系，旨在通过专业培训体系持续培养大客户经理服务队伍，重点提升大客户专业服务能力。</li> </ul>                                       |
| 分类精细化管理        | <p>针对投资机构客户</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>搭建机构理财平台，进一步优化机构投资者在资产配置、投资顾问等方面的使用体验。</li> <li>开展 40 余场中大型会议活动、3 场大型联合调研、10 余场中小型联合调研，组织 17 个团组分析师赴海外路演，从不同行业和领域增加了服务客户活动的频次。</li> <li>制定《机构客户总部核心客户销售服务管理细则》及《机构客户总部客户分类分级服务规程》，指定销售服务人员对口核心客户，确保对机构客户的诉求时时、事事有回应。</li> </ul> |
|                | <p>针对政企客户</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>建立集团公司与申万宏源证券客户分类分级管理体系，打造“以客户为中心”的综合金融服务体系，发挥“研究+投资+投行”专业优势，为客户提供全方位综合金融服务。</li> </ul>   |
|                | <p>针对零售客户</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>提供优质产品及服务，成功举办首届申万宏源 ETF 大赛，参赛客户超万人，参赛员工超千人。精心策划并推出了“ETF 周周报”与“ETF 高手养成记”两个品牌栏目，全程以周播形式共计输出高质量直播内容近 30 场，单场有效观看最高的人数达到 11 万 / 次，累计服务客户超 100 万。</li> <li>积极落实北交所深化改革措施，有效促进北交所经纪业务高速发展。</li> <li>积极探索将人工智能应用于零售客户服务。</li> </ul>    |



辽宁省人民政府与申万宏源证券签署战略合作协议



申万宏源“融进学堂”



申万宏源证券与新疆银行签署战略合作协议

此外，公司认真做好客户沟通与反馈工作，充分畅通客户沟通渠道，不断完善客户投诉管理机制，切实解决客户实际问题，提升客户满意度。

### 客户沟通渠道

- 设立客户服务热线 95523、网络客服、电子邮箱、分支机构网点等线上线下沟通渠道，直接受理客户投诉事宜。
- 投教基地设立“信访投诉接待日”“纠纷调解室”等沟通平台。

### 客户投诉机制

- 制定发布《投资者投诉处理工作指引》等相关制度，建立投资者投诉分级处理机制，规范投诉处理流程。
- 设立投资者投诉处理专项跨部门工作小组，负责指导客户投诉处理相关工作。

在客户满意度调查方面，公司建立了全面、完善的客户满意度调查体系，围绕公司整体服务、客户经理服务等方面，通过 APP 端、PC 端、微信端等渠道开展客户满意度调查。2023 年度，公司客户满意度调查结果为公司整体服务达到“满意”及“非常满意”占比 88.64%，客户满意度调查范围为接受存量客户回访的客户，后续公司将通过强化数字金融、产品供给、融资方式、服务梯度建设和考核体系引导，打造以投顾能力和品牌建设为核心竞争力的财富管理体系，进一步提升客户满意度。

## 助力防范化解金融风险

金融事关国家经济和发展安全。公司作为国有金融机构，始终坚持扛稳压实防范化解重大风险的政治责任，按照党中央确立的“稳定大局、统筹协调、分类施策、精准拆弹”的基本方针，坚决打好防范化解重大金融风险攻坚战，积极稳妥处置金融风险，把创新意识和防范风险机制建设结合起来，注重稳健经营，不断增强公司发展韧性。

### 申万宏源助力防范化解金融风险亮点实践

#### 筑牢内部风险管理防线

- 持续强化内部自我约束，牢牢把握防范化解重大风险的战略主动，在经营管理中紧盯宏观形势及市场动态，不断健全风险识别、评估、监测、预警体系，提高防范化解金融风险的预见能力、应对能力、处置能力，有效管控重点领域风险，守住不发生重大风险底线（具体风险管理内容详见“公司治理议题-全面风险管理”小节）。

#### 防范化解金融业务风险

- 积极履行好资本市场“看门人”重要职责，将合规稳健经营融入客户服务工作，不断筑牢防范资本市场欺诈造假行为的屏障，助力资本市场生态和投资者保护环境全面改善（具体投资者保护详细内容请见“保护投资者权益”及“社会议题-客户权益保障”小节）。
- 运用期货及场外衍生品工具，为企业以及各类投资者提供风险管理手段和风险缓释工具，助力地区产业发展和保价稳供，保障客户资产与资金安全。



### 宏源期货多措并举，积极服务客户风险管理

2023 年，宏源期货充分发挥期货衍生品专业优势，利用套期保值工具、场外期权、含权基差贸易等金融工具，积极服务客户风险管理。

- 利用套期保值工具，有效防范风险：宏源期货抓住工业硅品种上市机遇，为特变电工、天合光能等新能源龙头企业提供套期保值方案和业务培训，帮助企业较好地规避风险。
- 利用场外期权为企业提供服务：为大豆产业客户提供看涨、看跌期权，香草期权组合等场外期权策略，共计达成 10 笔场外期权策略合作；为某粮油加工企业提供累购期权服务，帮助企业锁定成本并增加套保综合收入。
- 通过含权基差贸易提供风险管理服务：为中国精对苯二甲酸（PTA）生产企业提供价格风险管理服务，并通过含权贸易名义为沥青生产企业提供风险管理服务。





### 申万智富利用金融工具为新型农业主体及涉农中小微企业提供价格风险保护

2023 年，申银万国智富投资有限公司（简称“申万智富”）作为申万期货的风险子公司，利用期货的价格发现和套保功能，通过期货、期权等衍生品工具为新型农业主体及涉农中小微企业的生产经营提供价格风险保护。申万智富引导大豆收购企业通过一口价、基差后点价、期权点价等多种定价方式，收购农户大豆，累计大豆购销量达到 12.2 万吨，购销金额达 6.56 亿元，是公司充分响应国家服务实体经济，防范化解金融风险的有力举措。

## 保障投资者权益

保护中小投资者合法权益既是资本市场人民性的重要体现，也是资本市场持续健康稳定发展的重要基础。公司高度重视投资者权益保护工作，建立起“总分协同、线上线下结合、公司与外部组织联动”的投资者教育工作模式，并依托上海国家级投教基地形成“1+N”（即 1 家国家级投教基地、N 家省级投教基地、全国分支机构投教小站）投资者保护矩阵。

2023 年，公司通过落实开展多样丰富的投资者教育主题活动、持续推进“1+N”投教基地建设运营、推动投资者教育纳入国民教育体系、创新投资者教育传播渠道、制作投资者教育原创作品等方式，输出投资者“用得上”的知识、开展“记得住”的活动，以高质量投教工作筑牢投资者合法权益保护防线。

### 申万宏源 2023 年度投资者教育重点实践

#### 开展投资者教育主题活动

- 围绕“全面注册制”“防范非法金融活动”等资本市场重大改革及监管关注，针对个人和家庭举办专项投教活动 2,494 场，累计覆盖中小投资者 4,989,324 人次。
- 围绕上交所“拥抱注册制 共享高质量”、深交所“踔厉奋发新征程，投教服务再出发”、北交所“北交所走进投资者”等主题，开展专项投教活动共计 216 场，覆盖投资者 141,564 人次。

#### 推进投教基地建设运营

- 已初步形成统一管理、各有特色的“1+N”实体投教基地矩阵，并主动结合地域文化推进投资者教育工作。
- 在实体投教基地中借助人脸识别、语音交互、互动触控、演示投影等智能化科技手段，将复杂的金融知识简单化、趣味化，引导参观者积极参与集玩、学、测于一体的场景化互动体验。
- 探索建设元宇宙投教基地，将数字金融的元素与虚拟 IP 相结合打造申万宏源“小诸葛”投教虚拟人形象，打造更加智能、精准的投教互动体验。

#### 推动投资者教育纳入国民教育体系

- 会同市场知名财商教育机构，编撰形成面向中小学生的“如果财富是一座山”及“金钱王国的秘密”财商教育课程，组织开展 15 场投资者教育进中小学活动，向累计 1,071 名中小学生学习金融知识入门普及。
- 与复旦大学、上海海洋大学、新疆大学等 68 所高校建立合作关系，组织开展 259 场投资者教育进高校活动，累计覆盖高校学生超 31,000 人次，并通过与高校合作开展理论与实务课程，提升高校学生投资理财素养。

#### 创新投资者教育传播渠道

- 借助新媒体渠道创新投资者教育模式，建立“申万宏源证券投教基地”抖音号，进一步满足年轻投资者对于投教知识获取需求。
- 2023 年，在抖音号投放富有感染力和趣味性的创新型投教作品近 150 件，累计点击量超 1,900 万人次。

#### 制作投资者教育原创作品

- 与时俱进搭建内容体系，紧跟市场热点与投资者关注话题，推出一系列倡导理性投资、价值投资、长期投资的创意视频。
- 截至 2023 年末，共产出 687 件原创投教作品，累计覆盖投资者 38,672,134 人次。

投教基地走进上市公司风语筑



金钱王国的秘密财商教育课程

新疆乌鲁木齐省级投教基地



拥抱全面注册制投教产品



### 科技赋能创新多元化投教模式

秉承“以科技打造简单金融、创新赋能智慧投教”的理念，公司依托“智慧金融”与“全民投教”相结合的科技手段，打造高度场景化的投资者教育、提供千人千面的个性化服务。

- 在投教基地中，客户画像区借助语音识别技术，将投资者的投资偏好、交易习惯等要素信息录入智能化系统，并据此生成量身定制的投资者分类画像报告，同时引导投资者前往投教基地的相应区域学习所需要的投教知识。
- 探索建设元宇宙投教基地，提供声光电、玩学测相结合的沉浸式投教体验及提供线上普惠型投教服务，让投资者可以足不出户实现 VR 浏览参观。
- 在全国范围内推广电子投教园地，集中展示分支机构投教活动风采、发布优秀投教作品，提升优秀投教作品的触达点和覆盖面，促进专业投教资讯全面下沉至更大范围的中小投资者。



电子投教园地“投教小站”



元宇宙投教基地

#### 2023 年，公司投资者教育工作获得多项荣誉：

- 上海国家级投教基地获评中国证券监督管理委员会 2022-2023 年度全国证券期货投资者教育基地考核“优秀”评级。
- “515 全国投资者保护宣传日”联合行动优秀投教作品展播中，《全面注册制系列之“这个杀手不太冷”》荣获证券时报颁布的优秀策划创意奖。
- 《投资奇遇记之读懂上市公司报告》《金融名侦探系列》《教父之打新风云》《金融大富翁之基金定投》等投教作品参与第一财经“秒懂金融”评选活动，分别获得金奖、最佳投教节目奖、人气奖。
- 获得中证中小投资者服务中心评选的 2023 “股东来了”投资者权益知识竞赛最佳承办奖。

# 唯实求新， 培育可持续发展生态

近年来随着气候、环境和生态问题外部性效应的加速显现，全球关于可持续发展的共识不断增强。

公司积极培育可持续发展生态，建立气候变化管理框架，积极应对气候变化，推进开展责任投资实践，并大力落实乡村振兴战略，助力巩固脱贫攻坚成果和乡村振兴工作有效落地，全方位多层次地推动着经济社会朝着绿色低碳、可持续的方向发展。

#### 本章重点议题

- 应对气候变化
- 践行责任投资
- 助力乡村振兴





# 应对气候变化

## 气候变化管理体系

公司坚决贯彻国家关于实现“碳达峰、碳中和”目标和应对气候变化工作的战略部署，参照《国际财务报告可持续披露准则第 2 号——气候相关披露》(IFRS S2) 的披露框架与建议，建立“治理—战略—风险管理—指标与目标”的气候变化管理框架，积极应对气候变化。

### 申万宏源气候变化管理体系

#### 治理

- 公司董事会为最高决策机构，对包含“应对气候变化”议题在内的 ESG 战略目标、规划和重大事项具有决策权。
- 董事会战略与 ESG 委员会负责研究包含“应对气候变化”议题在内的 ESG 相关规划、目标、制度及重大事项，并向董事会提供咨询建议，对相关工作执行情况进行监督检查。
- 申万宏源证券建立环境和气候风险管理体系，明确其董事会承担公司环境和气候风险管理的最终责任，执行委员会及 ESG 委员会承担环境和气候风险管理的主要责任。三道防线执行层面，各业务单位承担环境和气候风险一线管控责任，风险管理部门是环境和气候风险管理牵头部门，审计部门负责将环境和气候风险管理纳入内部全面风险管理审计范畴。

#### 战略

- 结合公司运营及金融业务开展情况，识别气候变化带来的主要风险与机遇，评估其对公司运营及业务的潜在财务影响。
- 将 ESG 管理、应对气候变化等议题纳入《申万宏源 2021-2025 年发展规划纲要》，明确要完善服务“双碳”目标的工作机制，助力丰富资本市场绿色生态发展。
- 构建“碳”金融服务体系，通过发行低碳债券、支持绿色企业 IPO、投资低碳产业等金融手段推动气候变化管理及“双碳”实践与业务相结合。

#### 风险管理

- 根据 IFRS S2 框架，识别、评估出对于运营及业务具有实质性影响的 4 项转型风险和 2 项物理风险。
- 逐步将气候相关风险纳入全面风险管理体系，将气候变化作为公司 ESG 风险管理框架中的重点议题，并在业务风险管理全流程中考虑气候相关因素。2023 年度，申万宏源证券制定《申万宏源证券有限公司环境及气候风险管理办法（试行）》，针对相关业务环境和气候风险管理建立“风险识别与评估—风险监测与预警—风险应对与报告”的风险管理流程。

#### 指标与目标

- 借助 ESG 信息化管理系统，每年度实现碳排放总量、人均碳排放量、单位面积碳排放量等气候指标的线上统一填报、整合和分析，并根据每年度气候指标的变化趋势，识别公司在气候管理方面的潜在风险点，及时采取应对措施。
- 针对“服务绿色发展”设立“绿色发展领域企业 / 项目支持融资、投资金额”的定量考核指标，建立对应考核体系，每季度相关业务单位及子公司开展绿色低碳业务的完成情况。

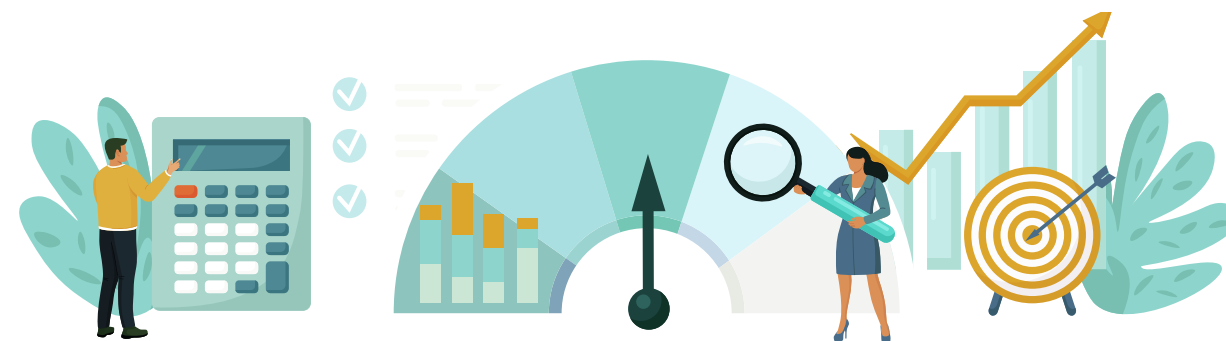
## 气候相关风险与机遇

为了更好地应对气候变化带来的风险，把握气候变化相关机遇，公司将气候变化议题纳入《申万宏源 ESG 管理提升行动方案 2.0》。公司于 2023 年度建立了气候相关风险管理流程，开展气候变化风险识别与评估工作，综合考虑宏观政策、同业对标分析，并结合公司内外部专家建议，识别对于公司运营及业务具有实质性影响的风险类型，并评估相关风险带来的潜在影响。

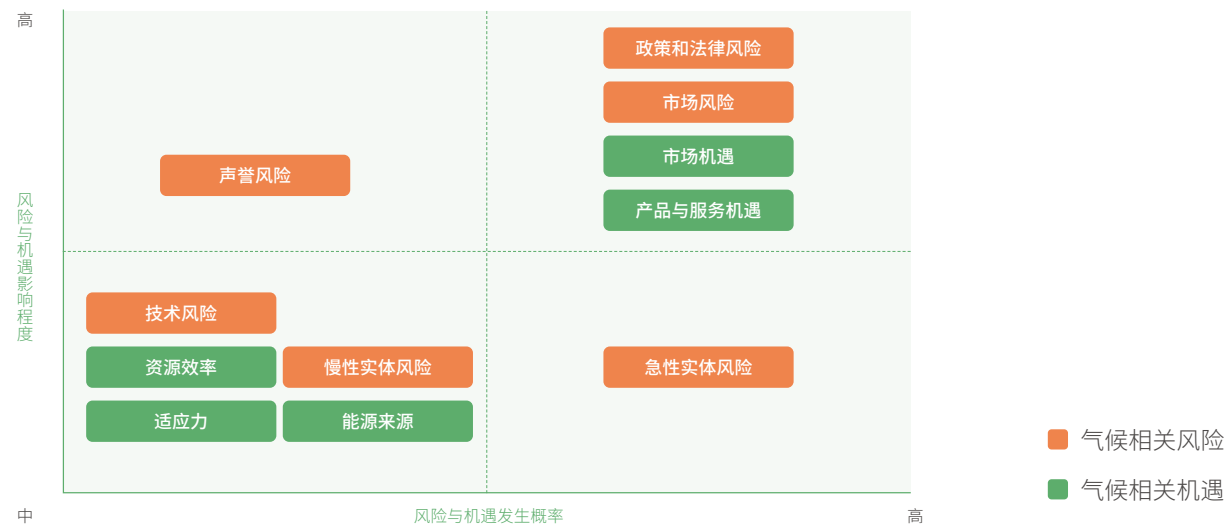
### 申万宏源气候相关风险管理流程



2023 年，公司开展气候相关风险识别、评估、分析工作，参考外部权威机构对气候风险的划分和定义，对气候变化相关风险和机遇进行梳理，形成公司气候相关风险及机遇实质性分析矩阵，确认政策和法律风险、市场风险，以及市场机遇、产品与服务机遇为公司高实质性气候相关风险和机遇。



申万宏源气候相关风险与机遇实质性分析矩阵



高实质性气候风险和机遇潜在财务影响分析

| 风险和机遇   | 具体描述   | 潜在财务影响                       | 影响范围 <sup>1</sup> |
|---------|--|------------------------------|-------------------|
| 政策和法律风险 | <ul style="list-style-type: none"> <li>随着我国“双碳”战略持续推进，对金融企业开展气候相关信息披露以及可持续金融产品的推出提出更加严格的要求。</li> <li>随着国家“两剩一高”等产业环保政策出台，一旦未来相关政策趋严，被投企业或客户可能因无法满足政策和监管要求而影响业务资质，或面临违规、处罚或诉讼等事件。</li> </ul>              | 运营成本增加<br>营业收入降低<br>投资组合价值降低 | 短、中、长期            |
| 市场风险    | <ul style="list-style-type: none"> <li>低碳经济转型将影响市场的供需结构，造成高碳产品及服务需求下降、棕色资产搁浅、发行人违约等风险，导致客户偿债能力下降或被投企业经营状况恶化，对公司金融业务产生影响。</li> </ul>  | 营业收入降低<br>投资组合价值降低           | 短、中、长期            |
| 市场机遇    | <ul style="list-style-type: none"> <li>随着绿色金融等相关政策及标准的出台，我国绿色金融已迎来新一轮发展机遇，公司顺应绿色金融市场发展趋势，及时加大绿色金融的顶层设计、相关投融资业务、碳金融业务布局，有利于增加绿色金融方面业务产生的收益。</li> </ul>  | 营业收入增加<br>投资组合价值升高           | 短、中期              |
| 产品与服务机遇 | <ul style="list-style-type: none"> <li>针对气候投融资及碳金融，我国已出台《关于开展气候投融资试点工作的通知》《碳排放权交易管理暂行条例》等相关政策，气候相关投融资及碳金融业务获得更大有序的发展空间，若公司把握住气候相关产品与服务机遇，积极开展气候相关研究咨询及投融资业务、利用公司资质参与碳交易，将会为公司绿色金融业务带来更大的发展机遇。</li> </ul> | 营业收入增加<br>投资组合价值增加           | 短、中期              |

<sup>1</sup> 注：短期为 0-3 年，中期为 3-5 年，长期为 5-10 年

气候相关战略与行动

针对识别的气候相关风险与机遇，公司从绿色运营及绿色金融业务出发，积极制定气候相关战略与行动，进一步应对气候相关风险，更好地抓住气候相关机遇。

制定绿色金融战略

- 将应对气候变化等议题纳入《申万宏源关于进一步提升服务国家战略能力的行动方案》，并在考核指标中针对“服务绿色发展”设立量化指标及发展目标，持续推进落实绿色金融业务实践（具体内容详见“发展绿色金融”小节），逐步提升绿色金融业务规模。

构建碳金融综合服务体系

- 聚焦“研究、产品、融资、投资、交易、跨境、风控”等维度，构建碳金融综合服务体系，研究制定服务“碳达峰、碳中和”国家战略行动方案。
- 依托公司自营参与碳排放权交易资质，以碳排放权自营交易业务为抓手，积极拓展碳交易业务，推进形成具有申万特色的碳金融业务模式，以市场机制应对气候变化。

建立健全气候风险管理体系

- 持续建立健全气候变化风险与机遇管理体系，2023 年度，公司制定《环境及气候风险管理办法（试行）》，建立气候相关风险和机遇的管理流程，要求相关业务单位密切关注被投资企业、客户的气候相关风险管理，推动将气候相关因素纳入投融资业务风险管理流程。
- 持续密切跟踪环境 / 气候相关政策趋势，加强“双碳”战略下的风险分析研判、预警等工作，督促相关单位做好业务风险防范。2023 年，公司开展“碳达峰、碳中和”政策梳理及专题研究，形成《双碳政策进展及影响》报告，并面向一线风险管理人员开展“碳达峰、碳中和”政策的专题培训，切实防范“碳达峰、碳中和”政策实施过程中可能带来的业务风险。

推行绿色低碳运营

- 积极开展绿色低碳办公实践，未来计划推进绿色清洁能源替换及能源应用数字化改造等措施。
- 制定应急处理规范，做好极端天气事件妥善应对处理。



## 践行责任投资

公司积极践行责任投资理念，将环境、社会、公司治理（ESG）等相关因素纳入投资决策考量中，致力于在获得投资回报同时，提升投资行为的环境及社会效益，推动社会经济可持续、高质量发展。

公司各投资业务部门及子公司在投资业务中充分落实责任投资相关要求，将责任投资理念纳入相关制度规范制定中，设立专门岗位负责管理 ESG 相关事宜，并通过针对投研人员开展 ESG 相关培训，切实提升投研人员责任投资相关能力。

在责任投资策略应用方面，公司持续推动相关业务条线及子公司在固定收益投资、权益类投资、私募股权投资等业务中充分应用筛选策略、ESG 整合策略、主题投资策略、影响力投资策略及积极所有权策略，落实投资标的 ESG 风险管理。例如，申万宏源资管将责任投资纳入《申万宏源证券资产管理有限公司服务国家战略行动方案（2023 年度）》中，明确各投资部门要研究制定 ESG 投资策略，在投资流程中适当加入 ESG 相关考量因素，分阶段、逐步开展 ESG 投资。2023 年度，公司资管规模（资产管理业务）中应用责任投资策略规模为 68.80 亿元，占相应总资产规模比重为 2.22%。

### 申万宏源责任投资策略应用

| 责任投资策略   | 权益类投资 | 固定收益类投资 | 私募股权投资 |
|----------|-------|---------|--------|
| 筛选策略     | √     | √       | √      |
| ESG 整合策略 | √     | √       | -      |
| 主题投资策略   | √     | √       | √      |
| 影响力投资策略  | -     | √       | -      |
| 积极所有权    | √     | -       | -      |

在自有资金固定收益投资业务中，申万宏源证券在信用研究团队设立专门岗位负责管理和协调 ESG 相关事项，并将责任投资相关实践纳入行业投资研究团队职责范畴。具体操作中，由信用研究团队负责将 ESG 纳入信用分析框架，进行行业和标的准入及投后管理，投资团队选择符合部门 ESG 投资策略的标的进行投资，同时完成公司对于 ESG 投资的相关考核要求。



### 申万宏源证券将 ESG 评估纳入信用评级体系

在自有资金固定收益投资业务中，信用研究团队在基本面投研框架中同时融入 ESG 的评估，并将 ESG 评分纳入估值模型和投资决策考量，在投前及投后流程中持续跟踪。一旦某一主体 ESG 评分过低，会相应对这个主体在信用入库环节进行限制或者额度管理，帮助提升投资决策。

ESG 评估主要关注环境、社会、治理三个层面，同时会结合行业性质，选取与 ESG 政策相关的指标构成 ESG 政策强度因子。在议题评估层面，结合行业业务特征，各行业在 ESG 议题的评估权重各不相同，以体现对企业经营具有实质性影响为原则。例如申万宏源证券作为非银金融机构更加注重社会层面的产品责任和劳工管理，在环境维度的污染物管理、环境管理、生物多样性管理等政策的强度指标值较低，但在制造业企业中，环境维度的考量强度就会显著增加。

此外，在自有资金固定收益具体投资实践中，针对煤炭、非常规石油及天然气等高 ESG 风险领域的投资，相关业务部门进一步制定展业限制规定，明确只有符合《产业结构调整指导目录（2019 年本）》《石化产业规划布局方案》等相关产业政策，在安全生产、环境保护、能源消耗等方面符合相关标准和要求才可获得展业许可。

申万菱信作为联合国责任投资原则（UN PRI）的签署方，致力于遵循 PRI 要求，将责任投资理念全方位整合至其投研体系，制定《ESG 投资管理办法》，搭建了责任投资管理架构，在其 ESG 委员会下设立 ESG 工作组，负责推进 ESG 具体工作的落地执行，并制定“六位一体”的 ESG 投资流程。



### 申万菱信“六位一体”ESG 投资流程

- 可持续性策略制定：通过确立可持续投资策略和相关准则，排除那些不符合 ESG 标准的行业和个股。
- 行业和个股分析：在权益投资中，重要的 ESG 因素被纳入行业研究和个股选择过程中。结合自建的 ESG 模型及第三方数据库，行业分析师与 ESG 团队协作深入研究公司治理、环境和社会相关问题，综合考虑 ESG 因素对公司财务和估值的可能影响。
- 组合管理：ESG 团队每季度监控投资组合的 ESG 风险暴露和评级变化，向基金经理报告，基金经理据此调整组合权重。
- 风险管理：关注整体组合的 ESG 状况和风险暴露，开展 ESG 风险监控，监控 ESG 评级的变化及任何 ESG 争议事件。
- 公司沟通：积极与上市公司就其 ESG 风险和机会进行沟通，分析 ESG 相关问题，并提供建议、跟踪和报告。
- 定期跟踪和报告：申万菱信每年向客户和 PRI 报告，展示其在责任投资方面的年度进展。

开展 ESG 投资专题培训

2023 年 12 月，申万宏源证券 FICC 信用研究团队为部门 170 人进行 ESG 投资研究培训，培训主体涵盖 ESG 功能、影响、实践等多方面内容。相关 ESG 研究成果还与投资顾问业务多家客户进行了路演交流，覆盖客户超 100 人次。



ESG 投资研究培训

## 助力乡村振兴

作为一家“有信仰 敢担当”的国有金融企业，公司积极贯彻落实国家乡村振兴战略，设立了帮扶工作领导小组、帮扶工作小组和帮扶办公室的组织架构，制定了《申万宏源定点帮扶挂职管理办法》《申万宏源定点帮扶资金和项目管理办法》《申万宏源消费帮扶管理办法》等制度规范，以确保巩固脱贫攻坚成果和乡村振兴工作有效落地。

2023 年，公司对原有“1+2+N”帮扶模式作进一步升级，形成“1+2+3+4+N”乡村振兴模式。在具体实践中，公司以产业、金融、教育和消费帮扶为重心，全方位助力甘肃省会宁县、新疆麦盖提县等帮扶地区乡村振兴工作。

### “1+2+3+4+N”乡村振兴模式

- 1** 制定一个“五年战略规划”。
- 2** 着力两个“重点工程”，包括“巩固脱贫攻坚成果工程”和“推进乡村五大振兴工程”。
- 3** 用好“公司合力、伙伴协同和公益基金会助力”这三支力量。
- 4** 坚持四项原则，即“实地调研精准帮扶、产业兴则乡村兴、发挥资本市场优势、增强群众内生动力”。
- N** 开展公益帮扶工作的类型多、项目多，党建、金融、产业、教育、生态等多种类型，助学、助老、助残、助医、助困等百余个公益项目。

作为定点帮扶甘肃省会宁县的牵头负责单位，公司积极做好会宁地区帮扶工作，通过开展防返贫综合险、教育帮扶及医疗帮扶项目，进一步巩固脱贫攻坚成果，并充分落实“会宁方案”乡村五大振兴目标，旨在促进乡村全面振兴。

### 2023 年度助力会宁县“巩固脱贫攻坚成果”重点实践

| 主要方面       | 主要内容  |
|------------|---|
| 开展防返贫综合险项目 | 投入 660 万元在会宁开展防返贫综合险项目，实现建档立卡户、边缘户等三类户全覆盖，保障人数超过 17 万人。全年防返贫险办理案件 2,075 件，理赔总额超 600 万元。                           |
| 继续加大教育帮扶力度 | 联合中金公司援助 320 万元建设会宁县第十一幼儿园、会宁一中实验教室建设；投入 90 万元在会宁县实施开展“大手牵小手”、“申万宏源班”等项目；组织开展优秀学生北京、上海研学活动；投入 64 万元开展高中生免费早餐鸡蛋项目。 |
| 聚焦帮扶医疗事业建设 | 投入 400 万元用于乡镇卫生院业务楼建设、医疗设备及药品采购；联合开展天使工程-乡村医疗服务能力提升项目，为 52 名乡村医生提供数字化巡诊包及赋能培训，并在 3 个行政村建设“健康小屋”。                  |

2023 年度助力会宁县“促进乡村全面振兴”重点实践

| 主要方面 | 主要内容  |
|------|---|
| 产业振兴 | 继续推进肉羊产业基地建设项目，完成西瓜产业抗旱应急水源工程，创设中投·会宁产业发展循环金项目，并扶持产业配套设施建设。2023 年度合计投入 1,559 万元，带动就业 1,165 人次，帮助增收超 1,000 万元。 |
| 生态振兴 | 合计投入 250 万元用于种植碳汇生态林，并积极助力会宁县开展碳汇权益开发工作，助推全县生态建设的同时，保障农民获得相对稳定的收益。  |
| 人才振兴 | 合计投入 50 万元用于会宁县人才振兴，对现任及新任领导干部，新录用公务员、选调生共计 1,925 人开展深度培训，培训乡村振兴带头人 1,080 人次，培训专业技术人才数 4,752 人次。              |
| 文化振兴 | 合计投入 30 万元，打造乡村特色文旅“青江驿·艺村落”品牌项目，并开展会宁地区农副产品艺术化深加工探索。   |
| 组织振兴 | 合计投入 100 万元，建设完成数字会宁基层服务平台，实现全县一盘棋的网格化组织管理模式。   |

在推进新疆地区帮扶工作方面，2023 年，公司在巴楚县、吉木乃县、麦盖提县、特克斯县等多个县市开展示范村建设、设立“申万宏源教育基金”、成立“申万宏源英也尔村——医路有我”基金、开展“农产品+保险+期货”等多个帮扶项目，进一步助力新疆帮扶地区巩固了脱贫成果，推进乡村振兴有序衔接，为新疆乡村经济发展和人民生活幸福做出积极贡献。

宏源期货全方位助力新疆乡村振兴

2023 年，宏源期货在新疆地区与吉木乃县、麦盖提县、哈巴河县、巴楚县、伽师县签署帮扶合作协议，建立定点帮扶长效机制，开展红枣棉花“保险+期货”项目、投入帮扶资金提升当地基础建设水平、支持创业就业帮扶项目、帮助困难居民缴纳养老保险、购买特色农产品等。

在吉木乃县布尔合斯太村的帮扶工作中，宏源期货投入多项帮扶资金，助力当地村阵地改造，提升当地基础建设水平；支持当地农牧产业，帮助扩大养殖规模及改善养殖条件；支持当地社区创业就业帮扶项目、百姓共享城市客厅建设等，进一步完善社区服务功能。



宏源期货助力托普铁热克镇文明路社区乡村振兴捐赠仪式

“全生命周期”风险管理，助力边疆红枣产业升级

2023 年，申万期货以“保险+期货”为基础，创新打造“保险+期货+订单+银行+场外期权”模式，引入银行、收购企业、申万宏源证券等多主体参与，为枣农提供“全生命周期”风险管理服务。

在为新疆麦盖提县红枣提供价格保险的基础上，公司引入麦盖提农信社提供农贷贷款解决枣农“种枣难”问题、引入收购企业订单解决枣农“卖枣难”问题、赠送看涨期权解决枣农“卖好价难”问题，全面助力当地红枣产业升级。



麦盖提红枣“保险+期货”项目签约仪式



甘肃会宁县乡村振兴座谈会



申万宏源麦盖提工作座谈会

此外，公司注重加强乡村振兴相关主题研究与行业交流，通过开展帮扶地区实地调研、撰写区域经济报告等方式，为落实乡村振兴战略贡献资本市场更多智慧与方案。

目前，申万研究所已发布《发挥生态优势 探索碳汇交易乡村振兴新模式》《做强梨果主业 挖掘生态价值 探索数字赋能》等系列调研成果。公司在担任“资本市场公益联盟”第一届轮值主席单位期间，组织开展了“第一届中国资本市场公益论坛”、发起成立第一只乡村振兴基金——库布其基金等系列扎实举措，汇聚资本市场公益力量，共建浓厚帮扶文化，共助乡村振兴。



- 2023 年，公司在定点帮扶和受灾地区共投入帮扶资金 4,346.1 万元，其中甘肃会宁地区投入 3,620 万元，新疆地区投入 570 万元，其他地区投入 156.1 万元。
- 2023 年，公司共计发行服务乡村振兴债券共计 11 只，总规模 275.5 亿元。

公司 2023 年度乡村振兴及帮扶工作亮点成果：

- 获得“新华网-2023 全国乡村振兴优秀案例”
- 获得“中国妇女发展基金会-2023 年度女性公益贡献单位”
- 获得“中国乡村振兴发展大会-全国乡村振兴优秀案例”
- 获得“中国城乡金融报-金融服务乡村振兴卓越案例”
- 获得“2023 年资本市场公益联盟-乡村振兴先进集体”
- 获得“第十三届公益节-2023 年度乡村振兴贡献奖”
- 宏源期货获得《中国农村信用合作报》颁发的“金融服务全面推进乡村振兴宣传调研基地”“2023 年度农村金融系统新闻宣传报道先进单位”“2023 年度优秀作品评选优秀奖”
- 申万期货获得《期货日报》《证券时报》颁发的“最佳乡村振兴服务及社会责任公益奖”
- 申万期货获得证券之星颁发的 2023 年资本力量“年度乡村振兴先锋奖”



申万宏源荣获新华网“2023 年乡村振兴优秀案例”



申万宏源获得“中国妇女发展基金会-2023 年度女性公益贡献单位”称号



申万期货获得“最佳乡村振兴服务及社会责任公益奖”



申万期货获得“年度乡村振兴先锋奖”

# 以人为本，建设一流人才队伍

党的二十大报告指出，人才是第一资源，要全面提高人才自主培养质量，着力造就拔尖创新人才，聚天下英才而用之。公司致力于以更加高效的举措吸引人才，以更加广阔的胸怀培养人才，以更加有温度的政策保障人才。

2023 年，公司秉承“德才兼备、任人唯贤、人尽其才”的用人理念，结合公司人才队伍建设发展战略，完善人才引进、推进分类人才培养体系，不断把各方面优秀人才集聚到公司的发展进程中。

本章重点议题

- 人才吸引与保留
- 保障员工健康与安全
- 加强员工关怀与福利



## 强化人才引进

公司坚持把人才作为发展之基、创新之源，秉承“德才兼备、任人唯贤、人尽其才”的用人理念，不断完善人才战略布局，打造公正平等、竞争择优的制度环境，以建立一支素质优良、德才兼备的人才队伍。

2023 年，公司基于战略布局、经营管理目标、人才培养使用要求和各单位实际需求，紧密结合《申万宏源 2021—2025 年干部人才队伍建设子战略》，积极推进人力资源管理“三个工程”，即投研领军人才工程、综合金融服务人才工程、“汇创”人才培养工程，以进一步加强人才队伍建设的统筹规划和顶层设计，建立适应公司发展需要的“募投管退”全链条和综合化金融服务专业人才队伍。

公司围绕战略方向，以各业务条线发展、转型、创新需求为导向，加大对投资银行、衍生品、投资交易、机构销售、金融科技等重点条线的成熟人才引进，在夯实公司发展提供人才保障的同时，切实履行稳就业、惠民生的社会责任。

同时，公司注重年轻人才的引进，通过前瞻性规划人才布局，加强重点院校招聘宣传及校企合作，进一步提升公司对应届生人才的吸引力，持续深化品牌影响力。

### 申万宏源 2023 年吸引人才重点活动及成果

| 类型   | 重点活动  |
|------|---|
| 招聘宣传 | <p>举办申万宏源 2024 届校园招聘“云”宣讲会，吸引北大、清华、复旦等 10 所国内知名院校近 600 余名学生参加。</p> <p>举办 2024 届暑期实习开营仪式，此次活动在京沪两地现场和线上云端同步举行，包括领导致辞、暑期实习项目介绍、团队主题活动、茶话会、司史馆参观等环节，进一步增强了校招粘性。</p>                    |
| 校企合作 | <p>实地拜访复旦大学、上海交通大学、南京大学、浙江大学、武汉大学等知名高校及院系，签订相关实习基地协议。</p> <p>联合浙江大学经济学院举办“HR 总监面对面”活动，为学生提供 1 对 1 的职业生涯辅导，并举办关于“重拾职业生涯规划”的主题讲座。</p> <p>与上海交通大学上海高级金融学院开展券商量化自营系列课程，约 180 余人次参训。</p> |

2023 年，公司结合就业市场形势与岗位编制管控要求，稳步推进年度社招及校招工作。公司持续关注多元化员工的招聘引进工作，在招聘过程中考虑员工多元化因素以完善公司员工性别结构、民族结构等。同时，公司广纳具有信息技术、数学、法律、财务等不同专业背景优秀人才，落实多元化人才吸引政策。

- 申万宏源证券荣获上海交通大学安泰经济与管理学院“最受欢迎用人单位”、北京大学汇丰商学院“示范实习基地”、以及 2023 中国典范雇主“HR 管理团队典范”和“2023 中国典范雇主”等荣誉称号。

## 赋能员工发展

公司不断完善人才培养体系，系统有效开展各类培训与培养工作，旨在为公司高质量发展提供坚强思想政治保证和人才智力支撑。为建设“学习型”组织，公司坚持分层分类开展公司层面重点培训，重点聚焦政治能力建设、管理能力建设、业务能力建设，实现全面赋能员工素养。

公司不断扩大培训生态圈，目前公司实施开展的人才培训项目，包括“星耀计划”“启明计划”“晨星计划”。申万宏源证券的培训体系主要包括“航”系培养计划和“申万宏源大讲堂”，其中“航”系培养计划包括领航计划、远航计划和启航计划；“申万宏源大讲堂”体系目前已经形成“4+2+N”综合性业务赋能平台的定位。

### 申万宏源人才培养体系

| 面向群体        | 项目名称                      | 培训内容  |
|-------------|---------------------------|---|
| 干部及党员       | 党的二十大精神集中轮训班<br>党的二十大精神专题 | <ul style="list-style-type: none"> <li>学习贯彻党的二十大精神为主线，强化政治理论学习</li> </ul>   |
| 中高层管理人员     | “星耀计划”<br>“领航计划”          | <ul style="list-style-type: none"> <li>理想信念及领导力提升培训</li> <li>“世界一流国际大讲堂”系列培训</li> <li>宏观经济形势解读</li> <li>中组部、中央金融工委以及中投公司等上级单位组织的各类选调课程</li> </ul>   |
| 核心业务骨干及专业人才 | “启明计划”<br>“远航计划”          | <ul style="list-style-type: none"> <li>依托专业机构，开展估值建模实操技能培训</li> <li>新聘及挂职人员能力提升专题培训</li> <li>针对营业部管理人员的“卓越管理特训营”</li> <li>针对公司内训师队伍的“内训师星火训练营”</li> <li>针对各业务条线的财富星训练营、综合金融业务、开门红专题业务等精品培训</li> </ul> |
| 新入职员工       | “晨星计划”<br>“启航计划”          | <ul style="list-style-type: none"> <li>面向 2023 年校招及社招新员工进行线下集中培训，内容涵盖廉洁从业、合规风控等应知应会制度</li> <li>2023 届校园招聘新员工新生特训营</li> <li>针对 2020/21 届新员工的“青年成长训练营”</li> </ul>                                       |
| 全体员工        | “申万宏源大讲堂”                 | <ul style="list-style-type: none"> <li>“4+2+N”：4 大线上主题包括“业务助推器”“管理加油站”“最佳实践营”“外滩研学堂”；2 个系列栏目包括“高管面对面”和“全面发展新阶段系列论坛”；N 个线下精品班次</li> </ul>  |



申万宏源 2023 年度联合外部机构开展员工培训

| 培训主题           | 外部合作机构     | 培训项目类型    | 培训介绍  |
|----------------|------------|-----------|---|
| 中国大连高级经理学院专题培训 | 中国大连高级经理学院 | 中高层管理人员培训 | 培训围绕“加快建设世界一流企业”“深化国资国企改革”“建设现代化产业体系”“领导力提升与履职能力培训”四大模块共 27 个主题开展 |
| 估值建模专题培训       | 诚讯金融       | 业务培训      | 聚焦内部投资线条员工，开展估值建模投资实操技能培训   |
| 风险管理专项培训       | 天弈风险管理论坛   | 业务培训      | 聚焦企业风险管理、风险防范、实践与案例剖析等内容  |

“启航计划”夯实人才发展基石

申万宏源对新员工实施“项目体系+课程体系+导师体系+实践体系+考核体系”五位一体全方位的培养，累计参训学员共 400 余人。围绕新员工入职、入行、入司、入岗四个主题，分阶段、分条线对校园招聘新员工进行系统性、针对性的培养。项目采用“线上+现场/直播”形式，其中线上依托学习园地线上平台运营，贯彻分层分类培训体系，设置差异化课程；现场/直播集中面授部分以凝聚文化理念共识和全业务链知识学习为主。



申万宏源证券“启航计划”新生特训营

“远航计划”锻造复合型管理人才

2023 年度 6 至 7 月，公司针对分支机构营业部副总，为提升一线管理人员管理能力和综合素养，开展政治素养、战略视野、通用管理能力、营销能力提升、金融科技素养等方面的课程，同时开展主题研讨等实践活动，促进各营业部管理人员之间的交流协作及管理水平。训练营分三期共 179 名学员顺利结业，得到分公司营业部的高度认可。



申万宏源证券“卓越管理特训营”培英班

为“六大区域”大客户经理举办服务能力提升专题培训

为提升“六大区域”大客户经理专业服务能力，公司举办“申万宏源大讲堂·融进学堂”之大客户经理专题培训。课程设计贯彻“以客户服务中心”的理念，设置了“财富客户的开拓与服务”“银行与机构客户的开拓与服务”“上市公司与企业集团客户的开拓与服务”“政企客户的开拓与服务”“大客户开发与营销实战”等培训模块，主要面向京津冀、长三角、粤港澳、大西南、新疆、华中“六大区域”分公司及辖内营业部负责人、综合金融岗位员工及业务骨干。



“申万宏源大讲堂·融进学堂”

自 2023 年 9 月以来，公司已面向六大区域近 750 名学员成功开展六期专题培训，不仅是公司构建客户服务体系的一个重要举措，也为系统性提升客户经理专业能力打下坚实的基础。



## 深化员工关怀

公司坚持以人为本的理念，关注员工诉求，致力于为员工打造有温度的职场。公司不断增进员工福祉，建立了一系列员工关怀计划，通过保障健康医疗福利、帮扶困难员工、定期开展文体活动来提升员工满意度和敬业度。

公司属于金融企业，职业安全和健康危害因素较少。公司严格遵守《中华人民共和国劳动法》《中华人民共和国职业病防治法》《工伤保险条例》等法律法规要求，竭力保障工作场所安全，保护员工健康及其相关权益。

### 申万宏源员工关怀措施

#### 保障身心健康

- 为员工提供定期体检，并进一步优化“员工体检”服务项目，强化心脑血管疾病筛查；通过商业保险的形式为员工办理补充医疗保险。
- 构建“平台+队伍+联动机制”的生命急救体系，打造“健康申万宏源”品牌。2023 年公司成立“民生保障专项工作组”，制定《2023 年民生保障整体工作计划》和《关爱生命健康专项工作方案》；搭建“急救响应平台”，在办公运营场所配备 AED 设备 20 台，将所有设备统一接入并制作“急救二维码”180 个，构建黄金 4 分钟救援机制；组建“申援侠”急救志愿者队伍，组织开展急救培训 15 次、急救实战演练 8 次，加强急救队伍实操能力。
- 完善“健康小屋”建设，升级健康自助检测仪，配置含有血氧仪、血压计等检测仪的“流动检测站”，并在药品配备上，调整药品配置种类，配备包括保心丸、速效救心丸等急救药品在内的“急救小药包”。
- 公司持续开展“汇创论坛”主题培训，召开 2023 年补充医疗保险专题宣讲、举办“与心灵相约、与健康同行”心理健康讲座；并依托“健康大讲堂”关注员工身心健康，邀请领域专家开展守护呼吸健康、员工心理关怀等健康讲座 5 次，开展线下心理按摩舒缓讲座 2 次，缓解员工心理压力。

#### 帮困慰问员工

- 进一步修订完善《工会经费收支管理办法实施细则》，细化“五必问”“五必访”标准。
- 通过日常关心慰问、上门探访方式开展日常帮扶慰问，通过“帮困送温暖”专项活动、“职工大病互助基金”对重点人群开展专项帮扶；2023 年，公司对 142 名因病致困的在职职工，发放帮困补助金共 26.75 万元，协助上海市金融工会帮困慰问 112 人，发放慰问金 33.6 万元，并为罹患重大疾病的职工提供互助帮困，支出金额 258 万余元。

#### 强化女性关怀

- 持续推进“爱心妈咪小屋”建设，不断完善哺乳用品等配备，为孕期、哺乳期员工营造舒适贴心的工作环境。
- 为女性员工提供生育津贴。

#### 平衡工作生活

- 深化公司文体社团管理，并持续推动社团壮大，开展丰富多彩的线上线下文体活动，满足员工个性化文化需求。
- 开展“弘扬文化倡正气 奋楫笃行树新风”健步行活动，组织启动仪式暨 2023 年申万宏源城市定向赛·文化之旅上海站活动。
- 举办“弈棋守初心 争当排头兵”申万宏源智力运动会，开展线上初赛及线下决赛，设置五大比赛项目。
- 开展为期一周的“文体社团嘉年华”活动，近 30 个公司社团进行展示及招新。
- 开展“金兔贺岁送祝福”新春活动、“芳华绽放”三八妇女节活动、“舞动童心 拥抱未来”六一亲子舞蹈活动等节日活动。
- 开展“云上运动会”之仰卧起坐大赛、“云上健身房”之瑜伽主题季等线上活动。



“申援侠”急救志愿者培训



“申援侠”急救志愿队成立

公司持续推进民主管理，建立了以职工代表大会为基本形式的民主管理制度，通过召开职代会、工代会，按时、按程序组织职工参与企业管理，听取公司经营管理的报告，审议事关职工切身利益的事项。2023 年，公司共召开 2 次职代会，听取职工代表意见，积极维护职工和公司合法权益。公司正式员工加入公司工会比例为 100%。

2023 年 11 月，公司对全体员工开展补充福利满意度调查，员工满意度达 92.84%，呈逐年上升趋势。根据员工在满意度调查问卷中反馈的主要问题，公司将持续优化改进补充医疗保险和年金方案。

# ESG 篇

## 管理与绩效

- 公司治理议题
- 社会议题
- 环境议题



## 公司治理议题

### 加强党的全面领导

公司坚持党对金融工作的集中统一领导，以政治建设为统领，把学习贯彻习近平新时代中国特色社会主义思想作为重大政治任务抓紧抓实，始终同以习近平同志为核心的党中央保持高度一致，确保党中央决策部署在公司系统落地生根。公司持续推动党的领导与公司治理有机融合，完善《公司章程》和议事内容清单，强化对重大经营管理事项的政治把关，深入践行金融工作的政治性、人民性，坚定不移走好中国特色金融发展之路。

### 公司治理

公司严格遵循《公司法》《证券法》《上市公司治理准则》等法律法规，建立了规范、完备、稳健的法人治理结构；以《公司章程》为基础，制定《股东大会议事规则》《董事会议事规则》《监事会议事规则》以及董事会下属各专门委员会工作细则，严格遵照规章制度规范运作，持续提升公司治理水平。

公司制定《董事会成员多元化政策》，从性别、年龄、文化及教育背景、地区、专业经验、技能、知识和服务任期多个方面考虑董事会成员多元化。公司董事由性别和年龄阶段不同的成员组成，拥有经济、金融、会计、管理、法律等多领域的专业背景。截至 2023 年末，公司董事会共有董事 11 位，其中执行董事 2 名，非执行董事 5 名，独立非执行董事 4 名；女性董事 2 名，占董事会总人数的 18.18%。

2023 年，公司根据外部监管规定和公司实际情况，修订完善《内幕信息知情人登记管理制度》《董事会审计委员会工作细则》。公司积极贯彻落实《国务院办公厅关于上市公司独立董事制度改革的意见》，结合证监会及深交所等监管部门最新制度要求，研究修订公司相关制度，为更好地发挥独立董事在规范运作、治理效能提升等方面的积极作用提供保障。



- 2023 年，公司在中国上市公司协会最佳实践系列评选中荣获“上市公司董事会最佳实践案例”“上市公司董办最佳实践案例”“上市公司董事会秘书履职评价”5A 级。
- 在第十八届中国上市公司董事会“金圆桌奖”暨第四届中国上市公司董秘好助手评选中获得“公司治理特别贡献奖”“最具创新力董秘”。

公司按照“真监实督、全面覆盖、协同协作、专业提升”的工作方针，扎实推进监事会各项工作，制定《监事会职工监事履职办法》，对职工监事的产生、职责、履职保障等方面作了规定。公司监事会共召开 4 次监事会会议，审议通过 8 项议案。

公司第五届监事会共有 5 位监事，其中职工监事 2 人；女性监事占监事会总人数的 100%。公司监事多数具备风险管理专业经验，并且持续做好风险管理专业知识的学习，积极参加监管机构、交易所以及上市公司协会等举办的相关培训。



- 公司监事会履职材料《聚焦主责主业 把准职能定位 为促进公司高质量发展保驾护航》被收录于 2023 年 2 月中国上市公司协会编著的《上市公司监事会最佳实践案例（第二版）》。

### 股东及债权人权益保障

#### 信息披露

公司严格遵循中国证监会《上市公司信息披露管理办法》等相关要求，制定《信息披露管理制度》《投资者关系管理制度》《年报信息披露重大差错责任追究制度》《信息披露报告事项指引》《保密管理办法》等规章制度，以持续提高信息披露质量，保障投资者，尤其是中小投资者的知情权和其他合法权益，促进投资者关系管理精细度和有效性提升。2023 年，公司修订《内幕信息知情人登记管理制度》，以进一步强化内幕信息知情人登记管理要求，有效防范内幕交易等证券违法违规行为，维护信息披露的公平原则，保护广大投资者的合法权益。

2023 年，公司共完成四份定期报告及 300 余则 A 股、H 股临时报告、电子表格与展示文件的编制与披露工作。公司重大事项的信息披露真实、准确、完整、及时、公平。



- 公司连续八年保持深交所信息披露 A 类评价。

#### 投资者沟通

公司严格遵照相关法律法规和公司《投资者关系管理制度》要求，秉持“尊重投资者、敬畏投资者、保护投资者”的理念，规范、高效开展投资者关系管理工作。公司通过公司网站、投资者热线、电子邮件、深交所互动易等便捷沟通平台接受投资者咨询，认真听取投资者意见和建议。

2023 年，公司举办 2 次业绩说明会，参加新疆辖区上市公司 2023 年投资者网上集体接待日活动 1 次，其中年度业绩说明会首次采用视频直播与文字互动结合方式召开，公司董事长、总经理、独立董事、财务总监及证券公司各经营管理条线等 10 位领导参会，基于市场角度对公司年度业绩展开分析解读，内容涵盖战略规划、重点业务发展、金融科技、ESG 等领域，回复率保持 100%，充分为投资者释疑解惑，向资本市场传递高质量发展信心。公司回复深交所“互动易”平台提问 32 次，回复率 100%。公司服务中证中小投资者服务中心及公司中小股东现场出席股东大会，协助其行使表决权，参与公司治理。公司主动加强与市场沟通力度，积极参与券商策略会，接待投资者调研，有效传递公司价值、提升投资者对公司的价值认同。



### 投资者回报

公司高度重视投资者回报，通过持续、稳定分红提升投资者获得感。公司综合考虑股东回报和业务发展需要，以截至 2022 年 12 月 31 日 A 股和 H 股总股本 25,039,944,560 股为基数，于 2023 年 8 月向股权登记日登记在册的 A 股和 H 股股东共计派发现金股利人民币 7.51 亿元。

公司到期债券均足额兑付本息，未到期的其他债券均按时足额付息，有效保障债权人利益。

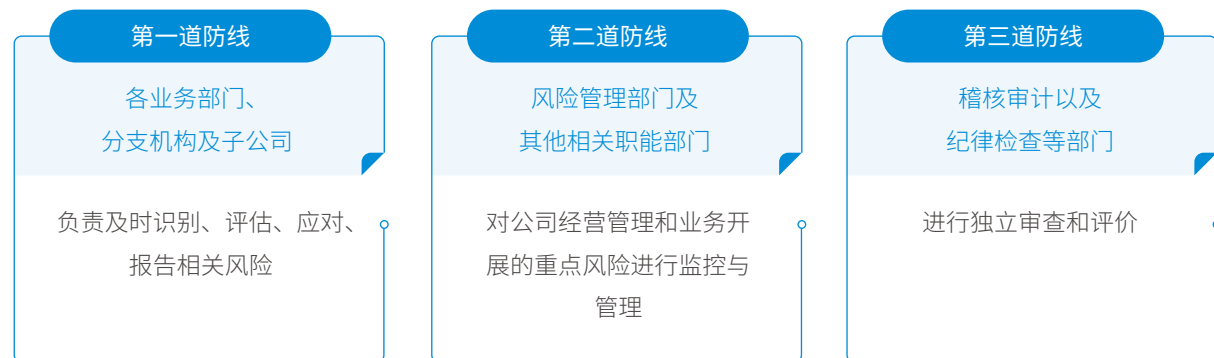
### 全面风险管理

公司不断完善“全员、全方位、全过程、全覆盖”的集团化、穿透式风险管理体系，搭建了多层次的风险管理组织架构以及“三道防线”机制以强化一线风险责任意识，加强前端风险控制，有力地推动了全员风险意识形成，做到风险管理责任到位。公司充分考虑董事会成员的经验、背景，目前，公司一名非执行董事、一名独立非执行董事及一名监事具备法律和风险管理相关教育背景和丰富的从业经验。

#### 申万宏源风险管理组织架构



#### 申万宏源风险管理三道防线机制



公司建立以《风险管理制度》为基本制度，以市场、信用、流动性、操作、声誉等各类专业风险管理办法及业务层面的操作规程和具体风险管理制度等为配套规则的风险管理制度体系，以加强公司全面风险管理工作。公司现有风险管理及问责管理制度共计 42 项，2023 年公司完成制定或修订风险管理相关制度共计 14 项，包括风险管理制度、风险偏好、风险容忍度、风险管理委员会履职、风险排查、利益冲突管理以及问责管理等制度，进一步完善“风险偏好 - 风险容忍度 - 风险限额”指标体系，细化风险管理操作事宜。

#### 申万宏源风险管控措施

- 市场风险**
  - 建立了量化风险指标评估体系，对风控指标进行动态监控和分级预警；强化对宏观经济形势的分析和研判，加强压力测试，识别市场风险因素变化对损益的潜在影响等。
- 信用风险**
  - 建立统一的内部信用评级管理机制，做实以实控人为主体的同一客户集中度管理，强化行业区域集中度管控，建立负面信息监测系统，对全市场负面舆情信息进行 7\*24 实时监控，从准入管理、同一客户集中度管理、负面清单等多维度管控信用风险。
- 流动性风险**
  - 对流动性风险状况进行动态监控预警；开展流动性风险压力测试和流动性风险应急演练，增强公司应对流动性危机的能力。
- 操作风险**
  - 持续开展操作风险评估；加强操作风险事件原因分析；加强对重大经营和业务活动的操作控制，对关键环节建立经办复核机制，降低操作风险事件。
- 声誉风险**
  - 建立完善声誉风险制度和异常事件报送机制，实施 7\*24 小时的舆情监测，对公司舆情进行分级分类管理，不断提升舆情预警和管理水平。

## 申万宏源 2023 年度风险管理重点举措

### 夯实风险排查

- 公司制定《风险排查与预警工作规程》，进一步规范公司风险排查工作，每年对业务单位风险管理体系建设情况、业务运作情况进行风险排查，不定期对重点领域开展专项排查。
- 2023 年，组织开展专项风险排查 20 余次，包括双岗询价机制、案件风险、地方投融资平台风险、中小金融机构风险、流动性风险、信用风险等。

### 贯穿业务产品

- 公司修订《风险管理制度》将风险管理工作贯穿业务事前、事中、事后各环节，覆盖公司的各类业务，包括经纪、融资类、自营、资管、投行等业务。

### 建立绩效考核

- 建立涵盖风险管理有效性的全员绩效考核体系；建立健全经济资本管理机制，逐步推行以风险调整后的收益为导向的资产配置及绩效评价机制。
- 公司将风险管理工作纳入对各部门、各分支机构、各子公司的绩效考核内容，对各部门、各分支机构、各子公司的奖惩和员工的薪酬待遇与风险管理考核结果挂钩。

### 推进审计检查

- 公司每年聘请外部第三方审计机构对公司开展财务审计，审计范围涵盖公司风险管理工作等。
- 申万宏源证券定期开展全面风险管理专项审计，对公司全面风险管理工作的充分性和有效性进行独立、客观地审查和评价。

### 开展相关培训

- 举办“危机应对与舆情管理”培训，以提升干部员工对突发舆情的处置能力，从舆情应对、应急管理到新闻发布、全媒体传播，全面提升互联网时代的公司危机应对能力。
- 举办“基于宽基指数的研究体系、风控机制与投资选择”等风险管理主题培训，加强业务人员风险管理能力。

## ESG 风险管理

为充分管理、防范金融业务端的 ESG 风险，公司逐步建立健全 ESG 风险管理体系，将 ESG 因素纳入业务风险管理的各个环节，确保业务持续有效运行。

### 申万宏源 ESG 风险管理举措

#### 严控风险准入

- 对存在高 ESG 风险的项目（包括不限于农业、生物多样性、能源使用、采矿、石油与天然气等行业）等，除非做出合理解释说明且相关负面因素已经消除的，否则不予立项；针对处于煤炭行业的发行人，如存在违反相关政策要求新增煤炭产能项目、未按照相关政策要求化解煤炭过剩产能项目、存在不安全生产 / 违法违规建设 / 劣质煤等相关项目不予承接。
- 申万研究所形成《碳中和下的行业风险分析》报告，分析政策对宏观经济、行业、重点企业的影响，重点提示火电、煤炭、有色金属、石油化工等传统高碳行业在绿色低碳转型的过程中或将面临的升级改造转型压力，并将企业盈利能力和信用资质弱化风险较高的企业纳入公司负面清单，同步调整其内部评级、可投资规模等。
- 对各行业信用风险进行展望分析，将种植业、渔业、林业、造纸、水泥、普钢等高 ESG 行业的信用风险展望设置为“审慎”或“回避”，并运用于公司的内部评级中。
- 针对承担信用风险的业务，如股票质押式回购交易、约定购回式证券交易、融资融券等融资类业务，对于主体存在违法违规、受到监管严重处罚、诚信问题等情况的，依据具体情况纳入负面清单关注类或限制类。

#### 开展 ESG 尽职调查

- 制定《环境和气候风险管理办法》，明确针对投融资业务面临的环境和气候风险管控流程，各业务单位应根据业务风险特征，将环境和气候风险相关内容纳入尽职调查范围，并充分评估和监测该业务面临的环境和气候风险水平。

#### 风险触发上报

- 各业务单位严格执行相关管理制度及流程要求，确保风险监测的有效运用。若相关业务发生环境和气候风险事件，相关单位严格按照公司《风险事件报告工作指引》有关规定履行报告程序。

公司制定《风险事件报告工作指引》，将 ESG 风险事件纳入风险事件评定，初步建立了 ESG 尽职调查体系，密切跟踪包括环境和气候风险在内的政策趋势，持续深化对被投企业及各类业务合作客户的尽职调查工作要求。

## 申万宏源尽职调查 ESG 关注重点



## 股票质押纾困业务

须对涉及的纾困对象、资金投向以及标的证券所在上市公司是否符合国家战略和产业政策、环境维度中的环境保护政策、社会维度中的产业议题等进行尽调。



## 债券承销业务

须对项目取得有关主管部门批准的情况（可研批复、土地、规划、环评、稳评等）、环境维度中的环境管理议题、治理维度中发行人及其控股股东诚信情况等尽调。



## 股票 IPO 业务

须对发行人社会维度中安全生产情况，环境维度中环境保护，治理维度中公司治理与独立性、投资者保护等方面进行尽调。

## 申万宏源证券在债券融资项目中开展尽职调查

在债券规模 21 亿元的某企业债融资项目中，申万宏源证券项目组作为债券发行人，对募投项目在环境、社会、治理方面的重要材料进行了调研。在环境合规方面，项目组取得了募投项目在当地发展和改革局备案的企业投资项目备案表，自然资源和规划局出具的建设项目用地预审与选址意见书、建设工程规划许可证、建设用地规划许可证等。同时，项目组对该企业高管进行了访谈，对企业进行了资信和反洗钱等公司治理的情况核查，对募投项目进行了实地环境的查看并收集了相关照片，申万宏源证券对以上内容出具了详细的评估报告，未发现严重的问题或风险，同意项目申报。

## 合规管理

## 合规内控

公司倡导主动合规、合规创造价值、合规从管理层做起、合规人人有责、合规是公司生存基础等合规文化理念，合规管理遵循全面性、合规独立性以及全员主动合规的原则。

公司制定《法律事务管理办法》《规章制度管理办法》《合同管理办法》等制度，作为公司业务开展的基本规范与底线要求，明确违规相关纪律处分。公司建立了由“董事会、监事会、执行委员会、合规总监、合规部门、各部门和分支机构和子公司”组成的合规管理组织体系。

## 申万宏源 2023 年度合规管理重点工作

## 制度新增

- 2023 年制定《员工违规行为责任追究办法（试行）》，以加强公司内部管理，规范员工违规行为责任追究工作。
- 制定《全员绩效考核评价中合规与风险管理履职情况的考核实施方案》，将员工廉洁从业、合规执业、诚信执业、反洗钱履职情况，纳入员工绩效考核。

## 制度修订

- 修订《合规专项考核办法》及考核评分表，优化评价规则和具体扣分标准等。

## 能力建设

- 公司开展新疆证监局《全面注册制下上市公司高质量发展主题培训》。
- 2023 年 3 月，申万宏源证券在上海证券交易所会员之家举办 2023 年度合规管理专题培训，与会人员围绕合规管理工作经验和做法、存在的问题和难点、应对举措和建议等进行了深入讨论。

2023 年，公司合规工作有序开展，未发生重大合规风险事件，整体合规状况持续保持良好。

## 知识产权保护

公司严格遵守《中华人民共和国商标法》《中华人民共和国专利法》《中华人民共和国著作权法》《互联网信息服务管理办法》等法律法规，制定《品牌管理办法》《互联网渠道信息发布运营管理规程》等管理规范，以明确知识产权归属和保护条款，落实自身、客户及第三方合作机构的知识产权保护。

## 商业道德

## 反腐败

公司构建党委统一领导、党政齐抓共管、纪委专责监督、职能部门组织协调、各单位各负其责的廉洁风险防控工作体系，董事会承担廉洁风险管理的最终责任，执行委员会是公司落实廉洁从业管理职责的第一责任主体。同时，公司建立健全业务部门、职能部门、审计部门三道防线，不断完善廉洁风险防控组织体系。

公司遵守《中华人民共和国监察法》及证券期货经营机构、上市公司有关廉洁从业的监管规定，制定《廉洁从业管理制度》《员工廉洁从业和规范执业指引》《防范利益冲突管理办法》等制度，进一步规范公司员工行为，促进员工廉洁合规从业，防范公司与员工之间的利益冲突；禁止包括回扣在内的任何形式的贪污贿赂行为。



### 申万宏源廉洁风险防控组织体系

| 层级    | 组织名称                      | 职责   |
|-------|---------------------------|--|
| 第一道防线 | 各单位                       | 承担本单位廉洁从业风险防控责任，负责本单位廉洁从业日常监督、检查、教育和报告等管理工作。 |
| 第二道防线 | 法务风控、投资管理、计划财务、人力资源部等职能部门 | 承担监测、检查等廉洁风险排查和防控职责。                         |
| 第三道防线 | 巡察、审计部门                   | 承担廉洁风险防控工作的监督职责，负责将各单位及工作人员廉洁从业情况纳入巡察和审计范围。  |

### 申万宏源廉洁从业建设重点举措

#### 专项风险排查

- 修订《廉洁风险防控手册》，聚焦重点领域和关键环节，围绕权力运行风险点和监督管理薄弱点查找公司经营中存在的廉洁风险点，并进行风险等级评估，逐一明确操作性强、具体管用的风险防控措施。
- 多次开展案件风险、廉洁风险专项排查，并建立了廉洁风险点梳理排查机制，定期分析评估公司及子公司廉洁风险点风险等级以及防控措施的健全性、有效性。

#### 廉洁文化建设

- 在新员工入职、员工晋升时，及时向其传达规范执业、廉洁从业要求。
- 2023 年 8 月，采用“面对面”的形式开展“零距离旁听庭审，沉浸式警示教育”廉政教育活动，选取具有典型教育意义的职务犯罪案件以案说纪，以增强公司党员干部的纪法观念和廉洁自律意识，培养了纪检干部的工作素养和履职能力。
- 制定涵盖 14 类问题、180 项负面行为的落实中央八项规定精神负面行为手册，规范管理规定和处分依据，明确底线、红线。
- 2023 年 10 月，采用现场会议 + 视频会议方式召开警示教育大会，面向全体员工（包括劳务派遣员工）通报执纪监督中发现的典型问题。

#### 推进监督防控

- 推动纪检监察、巡察监督、组织人事监督、合规风控监督、财会监督、审计监督等各类监督相互衔接、有效协同，准确揭示廉洁风险隐患，及时发现问题，一体整改落实。
- 公司制定《员工违规行为责任追究办法》《责任追究贯通协同机制的实施细则》《容错纠错机制的实施办法》，推动责任追究规范化，鼓励员工廉洁自律、担当作为。

2023 年，公司未发生针对公司或员工的已完结的贪污诉讼案件，亦未发生利益冲突事件。

### 反洗钱

公司持续加强反洗钱工作，根据中国人民银行发布的《法人金融机构洗钱和恐怖融资风险管理指引》，制定《洗钱和恐怖融资风险管理制度》《洗钱和恐怖融资风险管理办法》《客户和业务洗钱和恐怖融资风险评估操作规程（2023 年修订）》，按照“风险为本”原则，全面识别和评估自身面临的洗钱风险，采取与风险相适应的政策和程序，将洗钱风险管理工作落实到公司内部控制制度和日常业务运作中。

### 申万宏源反洗钱工作主要举措

#### 客户反洗钱尽职调查

- 在建立业务关系时、业务关系存续期间均进行客户尽调。申万宏源证券对于面对面客户和非面对面新建业务关系客户采取相同的尽调标准：面对面客户由营业部柜台人员进行尽调，非面对面客户由客服中心通过视频见证形式进行尽调。

#### 搜查与监测程序

- 配备专业技术人员进行系统维护工作，根据反洗钱法律法规将监控名单区分为外国政要（PEP）、黑名单及涉黑涉恶三类。其中黑名单类包括制裁、涉恐、红通等反洗钱法律法规要求纳入监控的名单范畴。公司建立开户环节名单实时监控及反洗钱系统存量客户回溯监控，及时更新名单库，并同步到公司相关系统。

#### 明确文件保存时限

- 制定《洗钱和恐怖融资风险管理办法》明确了如客户身份资料及交易记录涉及正在被反洗钱调查的可疑交易活动，应当将相关客户身份资料及交易记录保存至反洗钱调查工作结束。

#### 开展反洗钱独立评估监测

- 申万宏源证券于 2022 年底完成了本机构洗钱风险自评估。2023 年，申万宏源证券组织做好自评估结果后续运用。根据年度洗钱风险自评估情况，下发了《关于做好洗钱风险自评估结果运用的通知》，组织做好高风险领域管控，并补强内控薄弱环节。

公司高度重视反洗钱培训宣传教育工作，2023 年开展以“点滴行动，助力反洗钱”为主题的反洗钱宣传月活动，采取营业部现场宣传、社区宣传、微信公众号宣传等多种宣传形式，共发放宣传手册 4,700 余份、宣传折页 1 万余份、自制宣传品 600 余份，向重点客户发送宣传短信 270 万余条、微信 23 万余条，制作微动漫或短视频 30 余个。通过宣传“最新洗钱案的特征”“洗钱犯罪的过程”“洗钱犯罪的侦查过程”等内容，呼吁所有的投资者及时了解洗钱犯罪案例，努力提升公众反洗钱意识和能力。此外，申万宏源证券共举办 8 次反洗钱培训，培训内容涉及政策解读、形势分析、执法检查、可疑交易监测分析等多个方面，共 2,000 余人次参加培训。

2023 年，公司在反洗钱方面未发生重大违法违规事件。

### 检举者保护

公司制定《信访工作管理办法》《纪检信访举报工作管理办法（试行）》《纪检信访举报受理办理工作办法（试行）》等制度，以规范公司纪检信访举报相关工作机构的职责和管理机制，维护信访举报人的合法权益和信访举报工作秩序。

为确保检举渠道的通畅、有效，公司积极做好检举者保护工作。《纪检信访举报受理办理工作办法（试行）》明确规定纪检部门工作人员应“遵守保密制度，不得泄露信访举报人的姓名及信访举报事项的内容、受理与处理情况，不得泄露、扩散信访举报人要求保密及可能对信访举报人权益造成损害的内容。”“任何部门（单位）和个人不得以任何理由压制、歧视、刁难信访人，严禁打击报复信访人”。

### 反不正当竞争

公司针对防范不正当竞争行为制定了较为完善的管理制度体系，包括但不限于《金融营销宣传管理办法》《证券经纪业务管理办法》《投资者权益保护工作管理办法》等，明确投资者享有的知情权、自主选择权、公平交易权等相关权利，在金融营销宣传、证券经纪业务条线列举了不得以损害公平竞争的方式开展金融营销宣传、不得采用诋毁其他证券公司等不正当竞争方式招揽投资者等相关禁止行为并明确管控措施。

2023 年，公司未发生因不正当竞争行为或违反反垄断法而导致的诉讼事件。

## 社会议题

### 客户权益保障

#### 负责任营销

公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》《证券经纪业务管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《公开募集证券投资基金宣传推介材料管理暂行规定》《私募投资基金募集行为管理办法》等法律法规及规章制度，制定并完善了《证券经纪业务管理办法》《代销金融产品管理办法（2023 年修订）》《公募基金销售业务管理办法》《金融营销宣传管理办法》《分支机构证券经纪业务营销人员执业行为管理规程（2023 年修订）》等制度。

公司明确要求金融产品的营销推介应当坚持长期投资理念和客观、正式、准确的原则，严格制定金融产品营销宣传材料审核规则，建立了管理人、金融产品、投资经理等多维度审核体系，并集中统一管理金融产品销售，将营销宣传的合规执业情况纳入员工的日常考核中，持续规范公司代销金融产品销售及服务。

2023 年，公司未发现任何产品和服务的信息及标识违规事件，亦无市场营销相关违规事件。

#### 适当性管理

公司严格遵守《证券期货投资者适当性管理办法》《证券经营机构投资者适当性管理实施指引（试行）》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》等外部规定，制定并完善了《投资者适当性管理办法（2023 年修订）》《公开募集基础设施证券投资基金（REITs）投资者适当性管理及投资者教育工作实施细则》《可转换公司债券投资者适当性管理和投资者教育工作实施细则》《客户回访工作管理规程（2023 年修订）》《投资者投诉处理工作指引》《分支机构投诉处理典型案例》等内部制度及实施细则，推进开展投资者适当性管理实践，确保遵循风险匹配和审慎合规原则，向投资者销售与其风险识别能力和风险承受能力相匹配的金融产品与服务，引导客户理性投资，切实保障投资者权益。



## 强化数据安全与隐私保护

公司严格遵守《中华人民共和国网络安全法》《中华人民共和国数据安全法》《中华人民共和国个人信息保护法》等法律法规，开展数据安全与隐私保护相关工作，制定《数据安全管理办法》，2023 年新制定《网络和信息安全保护管理办法（试行）》《隐私政策》《投资者信息保护工作管理办法（试行）》等制度，以防范网络和信息安全风险，保障公司信息系统安全、稳定运行。

依据中国证券业协会《证券公司网络和信息安全三年提升计划（2023-2025）》，公司成立网络和信息安全三年提升计划的领导小组和工作小组，保障各项工作有序开展，落实提升计划工作目标要求。

### 申万宏源数据安全与隐私保护管理体系

| 维度       | 架构  |
|----------|---|
| 网络和信息安全  | <ul style="list-style-type: none"> <li>建立“党委-执行委员会-信息技术治理委员会-信息技术部门/信息技术保障总部/信息技术开发总部-各职能部门”的组织架构</li> <li>设立首席信息官负责公司网络安全归口管理工作</li> </ul> |
| 数据安全     | <ul style="list-style-type: none"> <li>建立“数据治理领导小组-数据治理工作组-信息技术部门-各业务部门”的组织架构</li> </ul>  |
| 投资者信息    | <ul style="list-style-type: none"> <li>建立“执行委员会和投资者权益保护委员会-投资者信息保护专项工作小组-各职能部门”的组织架构</li> </ul>   |
| 突发事件应急处置 | <ul style="list-style-type: none"> <li>建立由“技术应急指挥分中心-突发事件应急处置组”作为领导机构，“突发事件应急处置组”和“应急防范协调小组”作为工作机构的组织架构</li> </ul>                          |

### 申万宏源数据安全举措

- 建立信息安全管理体系，并通过 ISO27001 国际信息安全管理体系标准认证。
- 定期开展内部审计，并每年邀请外部有资质的第三方对公司信息安全管理体系进行外部认证审核。
- 积极开展信息安全宣传和培训，组织网络安全知识竞赛和钓鱼邮件攻击演练，提高全体员工信息安全意识，并要求员工签署关于信息保密的承诺书。
- 对外包人员就工作规范进行必要的宣教和培训，并签署驻点承诺书，以加强信息安全管理以及保密管理。
- 将网络安全管理工作纳入年度部门和个人考核评价中，开展网络安全考核，并将结果运用作为安全生产、经营绩效、任期绩效考核的参考依据。
- 严格做好供应商及合作伙伴的数据保护工作，将数据安全保障相关条款纳入全体供应商合同中。



### 申万宏源证券积极开展信息安全应急演练

2023 年，申万宏源证券积极参与证券期货业第十三次网络安全联合应急演练，在新疆证监局的督导下，成功完成指定演练场景。申万宏源证券全年完成 18 次实战应急演练，按照应急计划每半年开展 1 次桌面演练与培训，多次修订应急预案和应急计划，以提升公司业务连续性。

公司致力于恪守权责一致原则、目的明确原则、选择同意原则、最小必要原则、确保安全原则、主体参与原则、公开透明原则，规范在业务开展的各个环节对个人信息及数据的管理。

### 申万宏源客户隐私保护管理措施

#### 收集客户信息

- 公司最大限度地减少数据收集和保留，已在隐私协议中承诺在规定使用时间之后删除数据，不向第三方收集个人数据（法律要求的除外）。

#### 赋予客户权限

- 客户可以通过 APP、PC 端软件、网站等在线渠道登录账户，在相关界面访问个人信息；也可以前往开户所属的申万宏源证券营业网点、拨打客服热线 95523 查询个人信息。
- 客户可以根据页面提示自助修改个人信息。
- 客户有权删除自身手机号相关的各项数据，可以在业务办理修改自身的非关键信息。

#### 敏感数据保护

- 公司通过网络隔离、用户认证、数据加密、数据备份、数据销毁、恶意代码防范和非法入侵监测等安全保障措施，保护投资者信息存储和传输安全，防范信息遗失、毁损、泄露或者被篡改。

#### 处理客户信息

- 公司只会向第三方提供委托服务所必要的个人信息，且不会将此信息用于其他任何目的。与第三方签署严格的保密协定，要求第三方仅按照公司要求保护客户个人信息。



### 系统漏洞分析与应对措施

- 主动措施：新系统上线前须经过信息安全部安全测试检查，包括但不限于渗透测试、基础环境安全检查和相应等级的基本防护要求检查等，检查完成后应出具安全检查报告。不符合安全要求及时整改，直至通过安全测试后方可上线。
- 被动措施：将个人信息安全事件纳入其信息技术突发事件应急处置预案统一处置。如不幸发生个人信息安全事件，公司将按照法律法规的要求，采取合理方式及时排查投资者信息泄露途径、评估影响范围，采取合理可行的整改措施，及时处置风险隐患，并按照规定向有关部门报告。

### 产品服务保护

- 采取脱敏、去标识化等方式对用户的信息进行综合统计、分析加工，以便为客户提供更加准确、流畅及便捷的服务，或帮助其评估、改善或设计服务及运营活动。
- 按照《信息安全管理体系（ISMS）系统开发安全管理规定》，加强和规范信息技术保障总部系统的设计、开发、测试、上线阶段的安全管理，有效防范来自应用层的威胁和攻击，确保应用系统安全稳定运行。

2023 年，公司未发现违反客户隐私或遗失客户资料的事件，亦未接获经证实的相关投诉。

## 员工权益与福利

### 合规招聘及雇佣

公司严格遵守《中华人民共和国劳动法》《中华人民共和国劳动合同法》《中华人民共和国外国人管理条例》等相关法律法规，对员工招聘及解雇、平等机会、多元化、反骚扰，以及工作时数、假期以及其他待遇及福利等方面进行明确规定，杜绝童工及强制劳工，切实保障员工的基本权益。



### 申万宏源招聘工作体系

- 基本原则**：公平公正、能岗匹配、先内后外、注重实效。
- 招聘流程**：信息发布、简历筛选、综合测试、面试、背景调查、录用审批。
- 招聘计划**：根据《申万宏源 2021—2025 年干部人才队伍建设子战略》，组织各条线制定年度招聘计划，主动访谈和沟通重要条线的人才配置需求，结合对现有人力资源的盘点情况、组织结构、人员流动预测，为全年高质量招聘奠定基础。
- 招聘渠道**：媒体广告、招聘网站、猎头公司、内部推荐、校园招聘、专场招聘会等。

### 申万宏源员工招聘及雇佣管理措施

- 招聘**：
  - 《招聘调配管理办法》《招聘管理细则》等。
- 解聘**：
  - 《离职管理办法（试行）》《入职与离职管理细则（2022 年修订）》等。
- 平等就业**：
  - 强调招聘过程中公平公正基本原则，明确提出要秉持公平、公正的价值理念，塑造能够确保公平竞争的选拔环境，设计能够确保公正选拔的程序。
- 促进多元化**：
  - 《外籍员工管理细则（试行）》，实行更加开放的人才政策，以更广阔视野用好全球人才资源。
  - 员工录用不受种族、信仰、性别、国籍、民族、年龄、婚姻状况等因素的影响。

2023 年，公司在员工雇佣及劳工准则方面未发生已确认的违法违规事件，也未发生雇用童工和强制劳动情况。

### 保障员工权益

公司严格遵守《中华人民共和国劳动法》《中华人民共和国劳动合同法》《职工带薪年休假条例》《国有金融企业工资决定机制实施细则》等法律法规和相关规定，制定《考勤与假期管理办法（2021 年修订）》《薪酬管理制度（试行）》《工资总额管理办法》等内部规章制度。

公司建立了企业年金管理体系，2023 年修订了《企业年金管理委员会议事规则》，明确了年金管理委员会委员的组成与变更事宜，进一步规范了管委会议事程序，有助于充分发挥年金管委会作用，提升企业年金管理质效。

公司根据发展战略，按照市场化原则，以保障与激励相结合的薪酬分配制度为核心，建立了覆盖全体员工的内具公平和外具竞争力的薪酬体系，激励员工不断提升工作绩效，吸引和保留公司所需的优秀人才。同时，公司为员工提供了多元化的福利保障项目，旨在全面提升员工的企业归属感、幸福感，增强公司凝聚力。

#### 申万宏源员工权益保障措施

##### 工时与休假

- 实行每日八小时，每周四十小时的标准工时制度。
- 特殊职位经相关劳动行政部门审批后，实行综合计算工时工作制或不定时工作制。
- 员工参加工作时间满一定期限后，可享受对应期限的带薪年假，并按国家规定享受各类假期，包括法定节假日、年休假、病假、婚假、生育假等。

##### 薪酬

- 薪酬包括基本薪酬、年度绩效薪酬、津贴补贴、福利等，覆盖所有全职劳动合同制员工。
- 其中，基本薪酬中的月度绩效工资体现基本薪酬的激励和约束功能。
- 年度绩效薪酬是以公司整体效益为基础，以员工绩效考核结果为依据的激励型收入。

##### 薪酬与福利

- 法定福利：依法为员工提供社会保险、住房公积金等法定福利。
- 非法定福利：为员工提供补充商业保险、缴纳企业年金、定期体检、员工餐厅，以及交通和通讯补贴等，覆盖全体所有全职劳动合同制员工。

##### 职场骚扰

- 坚决抵制职场骚扰有关违规行为，对职场歧视采取零容忍态度，将其纳入员工违规行为管理，明确相关事件的申诉上报机制及采取的追责举措，坚决抵制有关违规行为。

### 员工考核与晋升

#### 绩效考核

为形成人尽其才的发展生态，公司建立了全员绩效考核评价体系，以定期检视、评价全员绩效水平，为全员绩效改进提供必要的跟踪、辅导。

#### 申万宏源绩效考核管理体系



公司制定《全员绩效考核评价办法》，包括制订方案、确认目标、准备考核数据、定期开展评价、确定考核结果与反馈、考核结果运用、开展绩效辅导等七大流程，形成完整的考核评价反馈的闭环。

全员绩效考核包括关键绩效考核和年度综合考核评价。其中，关键绩效考核以月度 / 季度 / 半年度为周期开展，以目标引导、绩效跟踪为主要目的，主要运用关键绩效评价法，对考评对象的过程性、关键性绩效表现进行阶段性考核；年度综合考核评价以年度为周期开展，以综合评价、绩效改进为主要目的，主要运用综合评价、360 度评估等方法，对考评对象的结果性、综合性表现进行年度考核评价。在考核结果确认后，各单位采用一定的形式向员工反馈考核结果，对于绩效表现较差的员工，各单位需开展绩效辅导，各单位也可根据管理实际针对性开展绩效辅导。如员工对本人考核结果以及职位评定结果有异议的，可在一定的时限内向本单位进行申诉，如果员工对本单位处理结果不满意的，可以向人力资源部门进行二次申诉。

## 发展晋升

公司充分尊重每位个体的自我定位和发展诉求，搭建了管理和专业并行的双通道职位体系，让“有为者有位”。

公司搭建以能力为核心的 MD 职级体系，为想干事、能干事、干成事的员工创造“能者上”的机会与环境。2023 年，公司修订了《职位管理办法（试行）补充规定》及《专业通道议事规则》，坚持公平公正、绩效导向，旨在充分激发干部员工潜力，全面提升公司干部员工队伍战斗力。

为鼓励员工利用业余时间提升岗位执业技能，公司制定《员工资格考试管理细则》，对取得职业资格、职业技能等级、高等继续教育类证书予以适当补贴，覆盖范围包括全体与公司正式签订劳动合同的员工。2023 年，已有 212 人次获得基金从业资格、期货从业资格、投资顾问资格、经济师、会计师、法律职业资格、特许金融分析师（CFA）、金融风险管理师（FRM）、硕士学位等技能认证和学历认证，共补贴金额 21.92 万元。

公司制定《导师管理实施细则》制度，明确各单位必须为新入司员工安排符合要求的带导师，并结合新员工特点制定针对性、个性化带教计划。新员工每季度对自己的培训 / 学习 / 工作情况进行总结，导师根据其工作日常表现和总结内容进行考评打分。

### FICC 事业部推出应届生带教计划全方位提高员工专业技能

为了更好地进行青年引领、人才培养，申万宏源证券 FICC 事业部设置了完善的带导师机制，即由部门资深业务骨干对新进员工进行定向业务指导。同时，部门内部开展“青年说经验分享”活动，不定期由部门先进典型为青年员工讲解职业规划、工作经验和指导建议，为青年员工树立优秀榜样；每周开展专题业务培训和合规业务培训，全方位提高员工专业技能，在整个部门内营造了互帮互助和持续学习的良好氛围，为青年员工快速成长提供了优秀的师资和充足的资源。

## 责任采购

公司严格遵循《中华人民共和国招标投标法》《国有金融企业集中采购管理暂行规定》等法律法规，修订了《集中采购管理办法》《集中采购评审小组议事规则》等制度，形成权责分明的采购组织体系、规范的采购管理程序、清晰透明的采购流程。

公司秉持“公开、公平、公正、竞争、效益、效率”的采购原则，通过规范公司采购人员行为、保证采购信息公开透明、要求供应商遵守反腐败相关合同条款并制定反腐败政策、畅通投诉举报路径等方式，落实采购环节廉洁管理，防范腐败滋生。公司于官网公开发布《供应商反腐败管理声明》，以提升供应商管理水平。

### 申万宏源供应商反腐败管理举措

#### 建立健全供应商反腐败管理体系

- 建立权责分明采购组织体系：形成多部门联动采购机制，公司审计部门负责采购事务相关审计监督检查工作，落实公司采购行为的反腐败及廉洁监督工作。
- 合规开展企业采购：采取公开招标、邀请招标、竞争性磋商、询价、单一来源采购等合规的方式开展企业采购。
- 形成规范采购流程：遵循公开、公平、公正、竞争、效益和效率的采购原则，形成规范采购程序及采购流程。

#### 落实供应商反腐败管理措施

- 规范采购相关人员的行为：要求采购相关工作人员不接受投标人馈赠、不得参加投标人宴请等活动，与投标人有利害关系或亲属关系需遵守回避原则。
- 采购信息公开透明：依法公示集中采购信息
- 要求供应商遵守反腐败条款：在供应商合同中纳入反商业贿赂等重要条款，要求所有供应商严格遵守相关法律法规并制定内部反腐败政策，并对供应商反腐败条款的执行情况和采购活动的合规性进行审计。

#### 做好供应链反腐败监督举报

- 建立监督、举报与处理机制，严防供应链贪污腐败事件发生。
- 在公司实施的招标等集中采购活动中，投标商及相关方认为有任何违法违规问题的，可按规定向公司纪检部门进行投诉举报。
- 针对采购活动中的腐败、贪污、贿赂等任何违规违纪行为，公司按照相关规定进行问责处理，构成犯罪的，依法追究刑事责任。

公司持续推进责任采购，优先采购节能环保产品，并将供应商 ESG 责任相关要求融入供应商管理过程，关注供应商在环境保护、劳工健康安全、公益活动等 ESG 方面的表现。



## 社区沟通与支持

### 社会公益

公司始终坚持为社会、民生和环境做出贡献与回馈，在积极发展普惠金融、开展员工公益、助力乡村振兴等工作的基础上，成立民生保障工作小组，助力经营所在地的社区发展，积极组织并参与各项公益慈善活动。

- 香港公司与当地非盈利组织合作，为柴湾长者邻舍中心开展软陶制作课程“同陶乐聚”活动，送上对护老者的温暖及关爱。护老者通过为时八周，每周一次的课程学习，创造出美观的软陶作品，促进建立良好的邻舍关系。
  - 申万菱信对会宁县科创中学开展帮扶捐赠活动，党总支号召公司全体员工以自愿募捐方式筹集帮扶款，累计筹集了帮扶款近 4.5 万元。与当地政府沟通后，向当地科创中学捐赠帮扶款用于购置学校教学急需用品，并建立了“申万菱信文印室”。
  - 宏源期货启动“心向暖阳·衣往情深”冬衣捐助活动，向贫困地区捐赠御寒外套，实现闲置资源的合理化配置与循环使用。
- .....

### 资助青年教师参加培训活动

2023 年 8 月，申万研究所资助会宁县 5 位优秀教师，来沪参加上海汇添富公益基金会举办的 2023 “河流·孩子”乡村优秀青年教师培训。此次培训活动，给会宁青年教师代表与研究所搭建了交流平台，充分展现了研究所对教师“优计划”的重视、对会宁青年教师成长的关心和培养。



“河流·孩子”乡村优秀青年教师培训



捐赠证书



香港公司 2023 年荣获商界展关怀 Caring Company 10 年 + 证书

### 志愿者活动

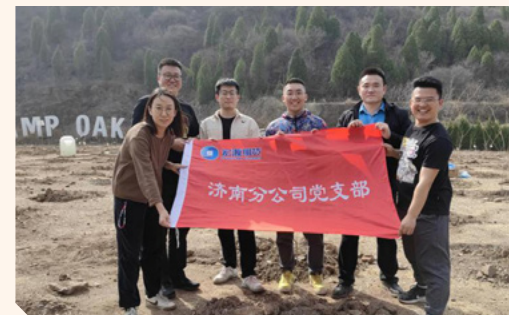
公司及各子公司鼓励员工参与志愿活动，以亲身参与的方式助力运营地所在社区的发展，帮助有需要的人解决实际困难。申万宏源公益基金会成立志愿者队伍，组织和动员员工和热心公益事业的社会各界人士参与基金会的志愿活动。申万研究所建立“青年突击队”积极组织并参与各种公益活动项目，旨在为社区和环境做出积极贡献。



申万研究所组织参加无偿献血志愿服务



申万研究所协助残疾人健身操服务



宏源期货参与义务植树活动



申万研究所开展敬老助老服务活动



申万研究所支持灾后重建工作

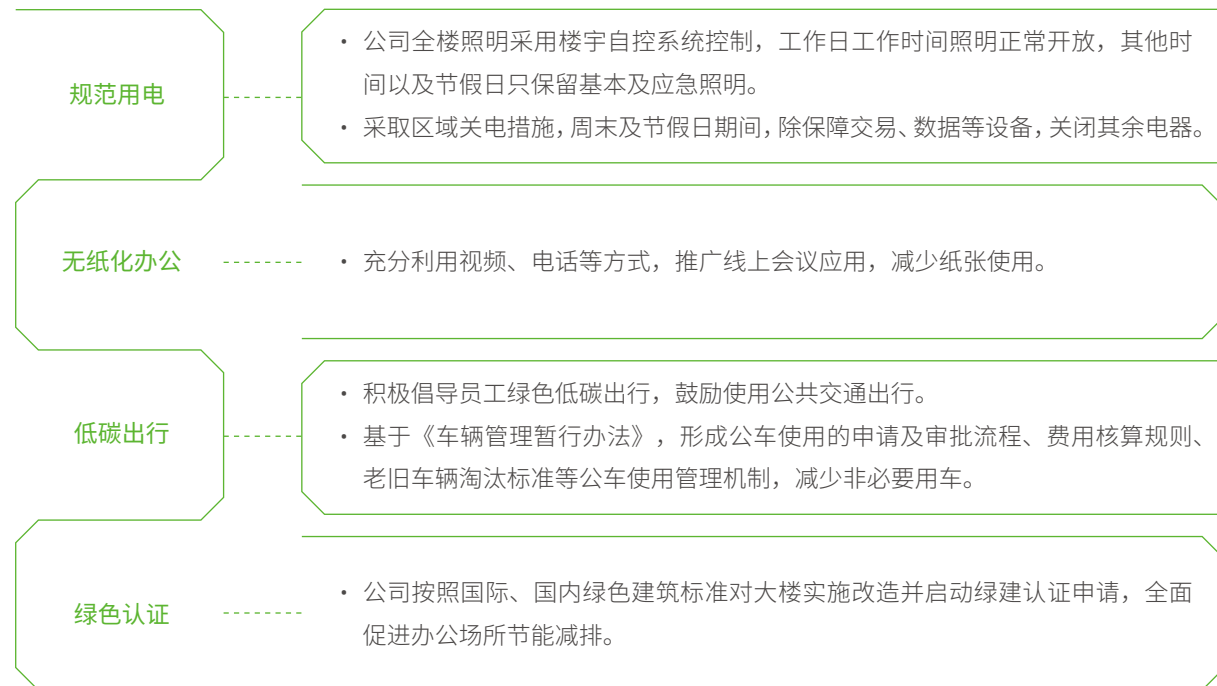


# 环境议题

## 能源及碳排放管理

公司在日常运营过程中涉及主要能源包括天然气、公务用车耗油以及外购电力等。公司遵守《中华人民共和国环境保护法》《中华人民共和国节约能源法》等法律法规。

### 申万宏源节能减排举措



### 香港公司制定能源使用管理目标

香港公司已制定 2025 年电力消耗目标约为 756,630 千瓦时。为实现 2025 年节能减排目标，香港公司持续监控各办公室的电力消耗的动态变化，并将每季度的数据发送至各级负责人，以加强落实各项办公室环保措施。香港公司各办公场所使用高效能的办公设备，并已在新办公室安装节能系统，如运动感应照明装置，以提高能源使用效益。

2023 年，公司未因环保违规事件遭受处罚，也未接到任何环境申诉事件。

## 水资源管理

公司水资源消耗主要为办公过程中的生活用水，主要用水来源为市政用水。公司遵守《中华人民共和国环境保护法》等法律法规，严格规范办公过程中水资源管理，开展节水宣教与激励，并配置节水器具，避免水资源浪费。

为进一步强化水资源管理，公司将加强水资源的节约利用及管理，持续完善耗水量的定期监测、统计及分析机制，在年度报告中披露耗水量及密度数据，努力控制耗水量及密度数据在较低水平。

## 废弃物管理

公司为金融公司，废弃物主要为办公运营中产生的厨余垃圾、硒鼓墨盒、办公用纸等无害废弃物，以及废旧电脑等有害废弃物。

在减少废弃物产生方面，公司坚持推广无纸化会议，利用电子屏幕、会议 APP 显示会议材料，最大限度减少纸质打印；积极倡导节约用纸，个人电脑网络打印默认设置为黑白、双面打印，提倡使用电子材料，减少办公用纸的使用与废弃。在废弃物处理方面，对于办公及生活垃圾，由公司物业统一收集后清运；对于废旧电脑、硒鼓墨盒等有害废弃物，公司定期委托有资质的第三方公司进行处置。

### 香港公司制定废弃物管理目标

香港公司制定 2025 年消耗纸张目标约 7,620 千克。2023 年，香港公司已在每个办公室设置废纸回收箱，以鼓励同事进行回收，转废为材，同时供应商定期对废纸进行收集。另外，香港公司推动分类回收以促进减废，在办公室放置胶樽及铝罐回收箱，再交到大厦管理处作统一处理。

为进一步强化废弃物管理，公司承诺将完善无害及有害废弃物的识别、统计、减量等方面的管理体系，将无害及有害废弃物产生量控制在较低水平。



2023 年，香港公司荣获香港环境运动委员会授予的“香港绿色机构认证减废证书”

香港绿色机构认证减废证书



## ESG 量化指标绩效表

### 经济绩效指标表

| 指标            | 单位 | 2022年         | 2023年         |
|---------------|----|---------------|---------------|
| 营业收入          | 万元 | 2,060,964.46  | 2,150,066.87  |
| 归属于上市公司股东的净利润 | 万元 | 278,906.79    | 460,634.02    |
| 资产总额          | 万元 | 61,311,702.45 | 63,543,741.81 |
| 基本每股收益        | 元  | 0.11          | 0.18          |

### 公司治理绩效表

#### 反腐败绩效指标表

| 指标             | 单位   | 2022年  | 2023年  |
|----------------|------|--------|--------|
| 反腐败培训次数        | 次    | 10     | 11     |
| 参与反腐败相关培训员工人数  | 人    | 11,204 | 11,807 |
| 员工人均接受反腐败培训小时数 | 小时/人 | 2      | 4      |
| 参与反腐败相关培训董事人数  | 人    | 9      | 5      |
| 董事人均接受反腐败培训小时数 | 小时/人 | 6      | 6      |

### 社会绩效表

#### 员工雇佣绩效指标表

| 指标                  | 单位 | 2022年  | 2023年  |
|---------------------|----|--------|--------|
| 员工总数 <sup>1</sup>   | 人  | 11,204 | 11,804 |
| 按性别划分               |    |        |        |
| 男性                  | 人  | 6,001  | 6,339  |
| 女性                  | 人  | 5,203  | 5,465  |
| 按雇佣类型划分             |    |        |        |
| 全职劳动合同制             | 人  | 11,198 | 11,440 |
| 全职劳务派遣              | 人  | 6      | —      |
| 其他雇佣形式 <sup>2</sup> | 人  | —      | 364    |
| 按年龄组别划分             |    |        |        |
| < 30 岁              | 人  | 2,666  | 2,562  |
| 30 至 50 岁           | 人  | 7,366  | 7,732  |
| > 50 岁              | 人  | 1,172  | 1,510  |
| 按地区划分               |    |        |        |
| 中国大陆                | 人  | 10,843 | 11,396 |
| 港澳台及境外              | 人  | 361    | 408    |
| 劳动合同覆盖率             | %  | 100    | 100    |
| 劳工歧视事件数             | 件  | 0      | 0      |

| 指标                 | 单位 | 2022年 | 2023年 |
|--------------------|----|-------|-------|
| 员工流失率 <sup>3</sup> | %  | 9.27  | 7.50  |
| 按性别划分              |    |       |       |
| 男性                 | %  | 9.97  | 8.01  |
| 女性                 | %  | 8.48  | 6.92  |
| 按年龄组别划分            |    |       |       |
| < 30 岁             | %  | 10.77 | 9.48  |
| 30 至 50 岁          | %  | 8.38  | 5.98  |
| > 50 岁             | %  | 11.52 | 11.99 |
| 按地区划分              |    |       |       |
| 中国大陆               | %  | 8.41  | 6.97  |
| 港澳台及境外             | %  | 35.18 | 22.55 |
| 新进员工总数             | 人  | 1,767 | 1,167 |
| 按性别划分              |    |       |       |
| 新进男性员工数            | 人  | 939   | 651   |
| 新进女性员工数            | 人  | 828   | 516   |
| 按年龄组划分             |    |       |       |
| 30 岁以下新进员工数        | 人  | 940   | 750   |
| 30 岁至 50 岁的新进员工数   | 人  | 821   | 414   |
| 50 岁以上新进员工数        | 人  | 6     | 3     |
| 按地区划分              |    |       |       |
| 新进大陆员工数            | 人  | 1,674 | 1,111 |
| 新进港澳台及海外员工数        | 人  | 93    | 56    |
| 少数民族员工人数           | 人  | 486   | 460   |
| 残疾人员工人数            | 人  | 29    | 29    |

注 1、2：2022 年度，员工总数为全职劳动合同制和全职劳务派遣制员工数，不包括其他雇佣形式员工，其他雇佣形式员工为经纪人等。2023 年度员工总数统计口径与年报保持一致，包括全职劳动合同制和其他雇佣形式，其他雇佣形式员工为经纪人。

注 3：【计算方法】各类别员工流失率 = 年内该类别员工流失人数 / 年末该类别员工人数。

#### 员工雇佣绩效指标表 - 分表<sup>1</sup>

| 指标                 | 单位 | 2022年 | 2023年 |
|--------------------|----|-------|-------|
| 员工总数（不含申万宏源证券公司）   | 人  | 7,927 | 7,925 |
| 女性员工人数（不含申万宏源证券公司） | 人  | —     | 3,746 |
| 新进员工人数（不含申万宏源证券公司） | 人  | —     | 753   |

注 1：本表指标统计口径为除申万宏源证券公司外的申万宏源集团范围内签订有劳动合同的员工总人数。

#### 员工健康与安全绩效指标表

| 指标            | 单位 | 2022年 | 2023年 |
|---------------|----|-------|-------|
| 员工体检覆盖率       | %  | —     | 100   |
| 因工伤关系而死亡的员工数  | 人  | 0     | 0     |
| 因工伤关系而死亡的员工比例 | %  | 0     | 0     |
| 工伤发生次数        | 次  | 0     | 0     |
| 因工伤损失的工作日数    | 天  | 0     | 0     |

员工健康与安全绩效指标表

| 指标                       | 单位    | 2022年  | 2023年    |
|--------------------------|-------|--------|----------|
| 员工培训投入                   | 万元    | 889.84 | 1,760.16 |
| 员工培训覆盖率 <sup>1</sup>     | %     | 100    | 100      |
| 按性别划分                    | 男性    | 53.56  | 53.70    |
|                          | 女性    | 46.44  | 46.30    |
| 按员工类别划分                  | 高级管理层 | 0.24   | 0.22     |
|                          | 中级管理层 | 3.24   | 3.27     |
|                          | 普通员工  | 96.52  | 96.51    |
| 员工接受培训平均小时数 <sup>2</sup> | 小时    | 67.47  | 60.00    |
| 按性别划分                    | 男性    | 65.11  | 57.83    |
|                          | 女性    | 70.20  | 62.51    |
| 按员工类别划分                  | 高级管理层 | 225.83 | 180.43   |
|                          | 中级管理层 | 138.79 | 127.04   |
|                          | 普通员工  | 63.28  | 57.45    |

注1:【计算方法】根据香港联交所《如何编备环境、社会及管治报告 附录三:社会关键绩效指标汇报指引》,各类别员工培训覆盖率 = 接受培训的该类别员工人数 / 接受培训的员工总人数。

注2:【计算方法】各类别员工每年人均接受培训时长 = 该类别员工接受培训的总小时数 / 该类别员工人数。

数据安全及隐私保护绩效表<sup>1</sup>

| 指标                      | 单位 | 2021年 | 2022年 | 2023年 |
|-------------------------|----|-------|-------|-------|
| 经证实的侵犯客户隐私权及遗失客户资料的投诉次数 | 次  | 0     | 0     | 0     |
| 在客户隐私方面发生违法违规事件的总数      | 件  | 0     | 0     | 0     |

注1:【统计口径】申万宏源证券有限公司合并报表范围。

客户服务绩效表<sup>1</sup>

| 指标                         | 单位 | 2022年 | 2023年 |
|----------------------------|----|-------|-------|
| 客户投诉数量                     | 条  | 129   | 163   |
| 投诉处理率                      | %  | 100   | 100   |
| 客户满意度 (PC 端) <sup>2</sup>  | %  | 89.1  | —     |
| 客户满意度 (APP 端) <sup>2</sup> | %  | 82.8  | —     |
| 客户满意度 <sup>2</sup>         | %  | —     | 88.64 |

注1:【统计口径】申万宏源证券有限公司合并报表范围。

注2:2022 年度客户满意度分为 PC 端及 APP 端进行统计,2023 年度客户满意度为合并统计,客户满意度调查范围为接受存量客户回访的客户。

供应商绩效表<sup>1</sup>

| 指标            | 单位 | 2022年 | 2023年 |
|---------------|----|-------|-------|
| 供应商总数         | 家  | —     | 166   |
| 大陆地区的供应商数     | 家  | —     | 159   |
| 港澳台及海外地区的供应商数 | 家  | —     | 7     |

注1:【统计口径】供应商统计口径为集团公司及宏源期货、宏源汇富、宏源汇智,以及申万宏源证券母公司。此处仅统计公司通过集中采购方式合作的供应商数量。

社会公益相关绩效指标表

| 指标                    | 单位 | 2021年    | 2022年    | 2023年    |
|-----------------------|----|----------|----------|----------|
| 总帮扶资金 <sup>1</sup>    | 万元 | 5,023.04 | 5,015.20 | 4,346.10 |
| 员工志愿服务人次 <sup>2</sup> | 人次 | —        | —        | 854      |
| 员工志愿服务总时长             | 小时 | —        | —        | 140      |

注1:总帮扶资金统计口径包括乡村振兴帮扶资金,及其他公益捐赠。

注2:员工志愿服务人次及总时长仅统计公司帮扶办公室数据。

环境绩效表

能源消耗及温室气体排放绩效指标表<sup>1</sup>

| 指标                                 | 单位      | 2022年      | 2023年      |
|------------------------------------|---------|------------|------------|
| 天然气消耗量                             | 立方米     | 119,840.99 | 112,592.00 |
| 人均天然气消耗总量                          | 立方米 / 人 | 10.70      | 9.54       |
| 汽油消耗量 <sup>2</sup>                 | 升       | 63,413.00  | 86,931.59  |
| 耗电总量 <sup>2</sup>                  | 兆瓦时     | 18,067.20  | 23,249.91  |
| 其中,公司总部北京办公大楼耗电量 <sup>3</sup>      | 兆瓦时     | 644.25     | 3,072.74   |
| 人均耗电量                              | 兆瓦时 / 人 | 1.61       | 1.97       |
| 温室气体排放总量 (范围 1+ 范围 2) <sup>4</sup> | 吨二氧化碳当量 | 10,830.21  | 13,776.55  |
| 范围 1 温室气体排放量                       | 吨二氧化碳当量 | 429.90     | 442.90     |
| 范围 2 温室气体排放量                       | 吨二氧化碳当量 | 10,400.31  | 13,333.65  |

| 指标                        | 单位          | 2022年    | 2023年     |
|---------------------------|-------------|----------|-----------|
| 范围 3 温室气体排放量 <sup>5</sup> | 吨二氧化碳当量     | 2,213.07 | 17,286.79 |
| 人均温室气体排放量（范围 1 和范围 2）     | 吨二氧化碳当量 / 人 | 0.97     | 1.17      |

注 1: 【统计口径】2022 年度, 天然气消耗量、汽油消耗量、耗电总量相关指标统计口径为集团公司及合并报表范围内子公司(含总部及下属分支机构, 期货营业部除外)。2023 年度, 相关数据统计口径扩大至合并财务报表口径。汽油消耗量包括中国大陆地区汽油消耗量及香港地区无铅汽油消耗量。部分子公司和分公司的电费计入物业费无法统计, 其能源消耗及温室气体排放数据为估算。

注 2: 2023 年, 公司员工减少居家办公频次, 公司自有公务车汽油消耗及耗电量有所增加。

注 3: 2022 年的数据仅包含集团公司的耗电量, 2023 年的数据包含了总部办公大楼内集团公司及合署办公子公司的耗电量, 故耗电量有所增加。

注 4: 基于公司业务性质, 范围 1 温室气体排放量包括天然气消耗、自有车辆汽油消耗产生的直接温室气体排放, 计算方法参考香港联合交易所《如何编备环境、社会及管治报告附录二: 环境关键绩效指标汇报指引》(2021 年 5 月) 以及世界资源研究所发布的“城市温室气体核算工具 2.0”进行估算; 范围 2 温室气体排放量包括外购电力产生的间接温室气体排放, 计算系数参考生态环境部《关于做好 2023—2025 年发电行业企业温室气体排放报告管理有关工作的通知》及香港联合交易所《如何编备环境、社会及管治报告附录二: 环境关键绩效指标汇报指引》(2021 年 5 月)。

注 5: 2022 年度范围 3 温室气体排放量仅包括员工商务差旅, 根据 Greenhouse Gas Protocol 范围 3 计算工具估算, 统计口径为集团公司及子公司宏源期货、宏源汇智、宏源汇富。2023 年度范围 3 温室气体排放数据包含员工商务差旅及员工通勤类别, 员工商务差旅类别口径扩大至集团公司及子公司申万宏源证券母公司、宏源期货、宏源汇智、宏源汇富, 员工通勤类别口径为合并财务报表口径, 基于员工通勤样本调查估算所得, 数据计算参考《温室气体核算体系: 企业核算与报告标准》《温室气体核算体系: 公司价值链(范围三)核算和上报标准》。

## 水资源消耗绩效指标表<sup>1</sup>

| 指标                | 单位      | 2022年      | 2023年      |
|-------------------|---------|------------|------------|
| 耗水总量 <sup>2</sup> | 吨       | 133,495.84 | 242,471.46 |
| 其中, 北京办公大楼耗水量     | 吨       | 16,571.00  | 18,703.00  |
| 人均耗水量             | 立方米 / 人 | 11.92      | 23.47      |

注 1: 【统计口径】2022 年度耗水量相关指标统计口径为集团公司及合并报表范围内子公司(含总部及下属分支机构, 期货营业部除外), 部分子公司和分公司的水费计入物业费无法统计, 其水资源消耗数据为估算。2023 年度耗水量相关指标统计口径为集团公司及合并报表范围内子公司(含总部及下属分支机构), 部分子公司和分支机构的水费计入物业费无法统计, 其水资源消耗数据为估算。

注 2: 由于 2023 年居家办公减少, 同时申万宏源证券分公司耗水量统计口径更加完整, 因此耗水量有较大幅度上升。

## 废弃物相关绩效指标表<sup>1</sup>

| 指标                  | 单位 | 2022年  | 2023年  |
|---------------------|----|--------|--------|
| 按来源划分的无害废弃物理量: 废纸   | 吨  | 1.26   | 7.03   |
| 按来源划分的无害废弃物理量: 厨余垃圾 | 吨  | 152.00 | 218.80 |
| 按来源划分的无害废弃物理量: 生活垃圾 | 吨  | —      | 6.96   |
| 按来源划分的无害废弃物理量: 硒鼓墨盒 | 吨  | —      | 0.05   |
| 按来源划分的无害废弃物理量: 碳粉盒  | 吨  | —      | 0.64   |

注 1: 【统计口径】2022 年度废弃物相关指标统计口径为集团公司本部及子公司宏源汇富、宏源汇智、宏源期货本部。2023 年度口径扩大至集团公司本部及子公司申万宏源证券本部、宏源汇富、宏源汇智、宏源期货(不含期货营业部)。

## 荣誉及奖项

| 获奖主体       | 颁发机构  | 奖项名称   |
|------------|---|--|
| 申万宏源集团     | 中国上市公司协会  | 2023 中国上市公司董事会最佳实践案例、2023 中国上市公司董办最佳实践案例、“2023 中国上市公司董事会秘书履职评价”5A 级  |
|            | 《董事会》杂志   | 第十八届中国上市公司董事会“金圆桌奖”-“最具创新力董秘”  |
|            | 新财富   | 第六届新财富最佳 IR 港股公司(A+H 股)  |
|            | 证监会   | 2022-2023 年度全国证券期货投资者教育基地“优秀”等级  |
|            | 中国人民银行乌鲁木齐中心支行、自治区地方金融监督管理局                     | “业务创新应用类”奖项  |
| 申万宏源证券     | 中国金融期货交易所                                       | “2022 年度股指期货优秀做市商银奖”、“2022 年度股指期货做市商新品种上市突出贡献奖”“期权新品种做市贡献奖”, 国债期货上市十周年市场贡献奖-国债期货最佳贡献奖(自营类)、国债期货上市十周年市场贡献奖-国债期货领军人物奖  |
|            | 中国期货业协会、中国证券业协会及中国证券投资基金业协会                     | 《基于区块链的多层穿透式监管模型研究及应用实践》项目获得优秀奖  |
|            | 证券时报  | 2023 中国证券业机构经纪商君鼎奖、2023 中国证券业全能投行君鼎奖、2023 中国证券业境外投行君鼎奖、2023 中国证券业资管量化团队君鼎奖、2023 中国证券业资管权益团队君鼎奖、2023 中国证券业产业服务研究所君鼎奖、2023 中国证券业公募权益产品君鼎奖(申万宏源红利成长)、2023 中国证券业投资银行家君鼎奖、2023 中国证券业金牌保荐代表人君鼎奖等九项大奖 |
|            | 中国证券报   | “2023 证券公司金牛奖”五大奖项: 十大金牛证券公司、证券公司文化建设金牛奖、证券行业 ESG 金牛奖、金牛财富管理团队、金牛投资银行团队  |
|            | 每日经济新闻  | “2023 证券公司集合资管计划金牛奖”两大奖项: 一年期股票多头型金牛资管计划: 申万宏源美好生活内需成长集合资产管理计划、一年期混合债券型(二级)金牛资管计划: 申万宏源申利安盈 1 号集合资产管理计划  |
| 北交所、全国股转公司 | “2023 中国证券业上市公司品牌价值榜 TOP30 (排名 9)”以及“最具特色券商母基金” |  |
| 北交所、全国股转公司 | 第二季度证券公司执业质量评价第一名                               |  |



| 获奖主体     | 颁发机构          | 奖项名称   |
|----------|---------------|--|
| 申万期货     | 中国保险资产管理业协会   | 最具潜力期货公司   |
|          | 共青团上海市金融工作委员会 | “奋斗杯”第三届上海市青年技能大赛 - 青年金融业务创新大赛三等奖                                  |
| 申万菱信     | 中国上市公司协会      | 上市公司利用期货市场管理风险最佳实践案例   |
|          | 中国人民银行        | “关键假设平台 KAP” 获央行金融科技发展奖三等奖   |
|          | 中国基金报         | 中国基金报投教联盟合作伙伴<br>申万菱信新能源汽车英华奖公募基金 25 年示范案例                         |
|          | 新华财经          | 基金投顾新锐金谏奖  |
| 申万投资     | 上海股权投资协会      | “PEAS2022 年度股权投资榜单” 2022 「年度最佳母基金」 奖项                              |
|          | 《证券时报》        | 2023 中国创投金鹰奖 “年度卓越 PE 机构”  |
| 申万宏源承销保荐 | WIND          | Wind 最佳投行 - 最佳 A 股股权承销商等 6 项奖项                                     |
|          | 新财富           | 本土最佳投行第 8 名、最具创造力项目等 9 项奖项   |
|          | 上海证券交易所       | 服务国家战略优秀承销商  |
| 申万研究所    | 上海市政府         | 2021-2022 年度上海金融创新奖成果奖提名奖  |
|          | 共青团上海市委       | 2022 年奋斗杯上海市青年金融业务创新大赛三等奖  |
|          | 新财富           | 最佳分析师评选团体奖 - 最佳 ESG 实践研究机构第一名等 25 项奖项                              |
|          | 上海证券报         | 最佳分析师评选 - 最具影响力机构等 2 项奖项   |
|          | 中国证券报         | 金牛奖最佳分析师评选 - 最具人气和影响力研究机构第三名                                       |
|          | 中国金融期货交易所     | 年度优秀会员白金奖等 4 项奖项   |
| 宏源期货     | 上海期货交易所       | 优秀会员奖、天然橡胶“保险 + 期货” 试点项目一等奖、“做市业务钻石奖” 等 5 项奖项<br>“提升期权市场运行质量” 一等奖等 |
|          | 证券时报          | 2023 中国期货业君鼎奖 - 中国期货公司领军人物君鼎奖                                      |
|          | 中国上市公司协会      | “上市公司利用期货市场管理风险” 优秀实践案例和探索实践案例                                     |

## 对标索引表

深圳证券交易所《深圳证券交易所上市公司自律监管指引第 1 号 - 主板上市公司规范运作（2023 年 12 月修订）》索引表

| 条款及披露内容                     | 报告章节   |
|-----------------------------|--|
| 8.1 综述                      | 强化担当，支持服务国家战略<br>稳中求进，提供高质量金融服务<br>唯实求新，培育可持续发展生态<br>以人为本，建设一流人才队伍 |
| 8.2 经营原则                    | 商业道德<br>客户权益保障<br>合规管理   |
| 8.3 社会责任战略规划及工作机制           | ESG 治理与管理  |
| 8.4 社会责任报告披露情况              | 已披露  |
| 8.5 职工权益保障                  | 以人为本，建设一流人才队伍<br>员工权益与福利<br>深化员工关怀                                 |
| 8.6: (一) 遵守环境保护法律法规与行业标准    | 环境议题   |
| 8.6: (二) 环境保护计划             | 环境议题   |
| 8.6: (三) 自然资源使用             | 环境议题   |
| 8.6: (四) 污染物处置              | 废弃物管理  |
| 8.6: (五) 污染防治设施             | 废弃物管理  |
| 8.6: (六) 环境保护相关税费缴纳         | ESG 量化指标绩效表  |
| 8.6: (七) 供应链环境安全            | 不适用  |
| 8.6: (八) 其他环境保护责任           | 环境议题   |
| 8.7: (一) 环境保护方针、目标及成效       | 环境议题   |
| 8.7: (二) 年度资源消耗总量           | ESG 量化指标绩效表  |
| 8.7: (三) 环保投资和环境技术开发        | 环境议题   |
| 8.7: (四) 排放污染物管理            | 废弃物管理<br>ESG 量化指标绩效表   |
| 8.7: (五) 环保设施建设和运行          | 环境议题   |
| 8.7: (六) 废物处理、处置，废弃产品回收综合利用 | 废弃物管理<br>ESG 量化指标绩效表   |
| 8.7: (七) 与环保部门签订的自愿协议       | 不适用  |
| 8.7: (八) 受环保部门奖励情况          | 不适用  |

| 条款及披露内容                     | 报告章节            |
|-----------------------------|-----------------|
| 8.7: (九) 其他自愿披露信息           | 环境议题            |
| 8.8 环保政策实施情况及纠正措施           | 环境议题            |
| 8.9 环境信息披露                  | 不适用             |
| 8.10: (一) 产品安全法律法规与行业标准     | 不适用             |
| 8.10: (二) 生产环境与生产流程         | 不适用             |
| 8.10: (三) 产品质量安全保障机制及事故应急方案 | 不适用             |
| 8.10: (四) 其他生产与产品安全责任       | 不适用             |
| 8.11: (一) 员工管理制度及违规处理措施     | 员工权益与福利         |
| 8.11: (二) 防范职业性危害与配套安全措施    | 深化员工关怀          |
| 8.11: (三) 员工培训              | 赋能员工发展          |
| 8.11: (四) 其他员工权益保护责任        | 员工权益与福利         |
| 8.12 科学伦理规范                 | 稳中求进, 提供高质量金融服务 |
| 8.13 社会责任报告内容               | 已满足要求           |

## 香港联交所《ESG 报告指引》(2023 年 12 月 31 日起生效版) 索引表

| B 部分: 强制披露规定      |                      |                 |                    |
|-------------------|----------------------|-----------------|--------------------|
| 强制披露项             |                      | 报告章节            |                    |
| 管治架构              |                      | ESG 治理与管理       |                    |
| 汇报原则              |                      | 报告编制说明          |                    |
| 汇报范围              |                      | 报告编制说明          |                    |
| C 部分: “不遵守就解释” 条文 |                      |                 |                    |
| 层面、一般披露及关键绩效指标    | 披露章节                 | 层面、一般披露及关键绩效指标  | 披露章节               |
| <b>A. 环境</b>      |                      | B4. 劳工准则        | 员工权益与福利            |
| A1. 排放物           | 废弃物管理<br>ESG 量化指标绩效表 | B4.1            | 员工权益与福利            |
| A1.1              | ESG 量化指标绩效表          | B4.2            | 员工权益与福利            |
| A1.2              | ESG 量化指标绩效表          | 营运惯例            |                    |
| A1.3              | ESG 量化指标绩效表          | B5. 供应链管理       | 责任采购               |
| A1.4              | ESG 量化指标绩效表          | B5.1            | 责任采购               |
| A1.5              | 废弃物管理                | B5.2            | 责任采购               |
| A1.6              | 废弃物管理                | B5.3            | ESG 量化指标绩效表        |
| A2. 资源使用          | 环境议题<br>ESG 量化指标绩效表  | B5.4            | 责任采购               |
| A2.1              | ESG 量化绩效表            | 稳中求进, 提供高质量金融服务 |                    |
| A2.2              | ESG 管理与绩效            | B6. 产品责任        | 客户权益保障             |
| A2.3              | ESG 管理与绩效            | B6.1            | 公司产品仅为金融产品, 不适用该指标 |
| A2.4              | 水资源管理                | B6.2            | 稳中求进, 提供高质量金融服务    |
| A2.5              | 公司产品仅为金融产品, 不适用该指标   | B6.3            | 客户权益保障             |
| A3. 环境及天然资源       | 环境议题                 | B6.4            | 合规管理               |
| A3.1              | 环境议题                 | B6.5            | 公司产品仅为金融产品, 不适用该指标 |
| A4. 气候变化          | 应对气候变化               | B6.5            | 强化数据安全与隐私保护        |
| A4.1              | 应对气候变化               | B7. 反贪污         | 商业道德               |
| <b>B. 社会</b>      |                      | B7.1            | ESG 量化指标绩效表        |
| 雇佣及劳工常规           |                      | B7.2            | 商业道德               |
| B1. 雇佣            | 员工权益与福利              | B7.3            | 商业道德               |
| B1.1              | ESG 量化指标绩效表          | 社区              |                    |
| B1.2              | ESG 量化指标绩效表          | B8. 社区投资        | 社区沟通与支持            |
| B2. 健康与安全         | 深化员工关怀               | B8.1            | 社区沟通与支持            |
| B2.1              | ESG 量化指标绩效表          | ESG 量化指标绩效表     |                    |
| B2.2              | ESG 量化指标绩效表          | B8.2            | 社区沟通与支持            |
| B2.3              | 深化员工关怀               | ESG 量化指标绩效表     |                    |
| B3. 发展及培训         | 赋能员工发展               |                 |                    |
| B3.1              | ESG 量化指标绩效表          |                 |                    |
| B3.2              | ESG 量化指标绩效表          |                 |                    |

## 全球报告倡议组织 (GRI) 《可持续发展报告标准》索引

| 使用声明                 | 申万宏源集团股份有限公司在 2023.1.1-2023.12.31 参照 GRI 标准报告了在此份 GRI 内容索引中引用的信息。 |                           |
|----------------------|---|---------------------------|
| 使用的 GRI 1            | GRI 1: 基础 2021  |                           |
| GRI 标准               | 披露项   | 报告章节                      |
| <b>一般披露</b>          |   |                           |
| GRI 2: 一般披露 2021     | 2-1   | 关于申万宏源集团                  |
|                      | 2-2   | 报告编制说明                    |
|                      | 2-3   | 报告编制说明                    |
|                      | 2-4   | 报告编制说明                    |
|                      | 2-5   | 独立鉴证报告                    |
|                      | 2-6   | 关于申万宏源集团                  |
|                      | 2-7   | 以人为本, 建设一流人才队伍<br>员工权益与福利 |
|                      | 2-8   | 员工权益与福利                   |
|                      | 2-9   | ESG 治理与管理                 |
|                      | 2-10  | 公司治理                      |
|                      | 2-11  | 公司治理                      |
|                      | 2-12  | ESG 治理与管理<br>公司治理         |
| GRI 3: 实质性议题 2021    | 2-13  | ESG 治理与管理<br>公司治理         |
|                      | 2-14  | ESG 治理与管理                 |
|                      | 2-22  | ESG 治理与管理                 |
|                      | 2-28  | 荣誉及奖项                     |
|                      | 2-29  | ESG 治理与管理                 |
|                      | 3-1   | ESG 治理与管理                 |
|                      | 3-2   | ESG 治理与管理                 |
| <b>经济</b>            |   |                           |
| GRI 201: 经济绩效 2016   | 201-1   | ESG 量化指标绩效表               |
|                      | 201-2   | 唯实求新, 培育可持续发展生态           |
| GRI 203: 间接经济影响 2016 | 203-1   | 强化担当, 支持服务国家战略            |
|                      | 203-2   | 唯实求新, 培育可持续发展生态           |
| GRI 205: 反腐败 2016    | 205-1   |                           |
|                      | 205-2   | 商业道德                      |
|                      | 205-3   |                           |

| GRI 标准                 | 披露项   | 报告章节                       |
|------------------------|-------|----------------------------|
| <b>环境</b>              |       |                            |
| GRI 302: 能源 2016       | 302-1 |                            |
|                        | 302-2 | 能源及碳排放管理                   |
|                        | 302-3 | ESG 量化指标绩效表                |
|                        | 302-4 |                            |
| GRI 303: 水资源和污水 2018   | 303-1 | 水资源管理                      |
|                        | 303-2 | ESG 量化指标绩效表                |
|                        | 303-3 |                            |
| GRI 305: 排放 2016       | 305-1 |                            |
|                        | 305-2 | 能源及碳排放管理                   |
|                        | 305-3 | ESG 量化指标绩效表                |
|                        | 305-4 |                            |
|                        | 305-5 |                            |
| GRI 306: 废弃物 2020      | 306-1 | 废弃物管理                      |
|                        | 306-2 | ESG 量化指标绩效表                |
| <b>社会</b>              |       |                            |
| GRI 401: 雇佣 2016       | 401-1 | ESG 量化指标绩效表                |
|                        | 401-2 |                            |
| GRI 403: 职业健康与安全 2018  | 403-1 | 深化员工关怀                     |
|                        | 403-2 | ESG 量化指标绩效表                |
| GRI 404: 培训与教育 2016    | 404-1 | 赋能员工发展                     |
|                        | 404-2 | ESG 量化指标绩效表                |
|                        | 404-3 |                            |
| GRI 405: 多元性与平等机会 2016 | 405-1 | 员工权益与福利<br>ESG 量化指标绩效表     |
| GRI 406: 反歧视 2016      | 406-1 | 员工权益与福利                    |
| GRI 408: 童工 2016       | 408-1 | 员工权益与福利                    |
| GRI 409: 强迫或强制劳动 2016  | 409-1 | 员工权益与福利                    |
| GRI 417: 营销与标识 2016    | 417-1 |                            |
|                        | 417-2 | 客户权益保障                     |
|                        | 417-3 |                            |
| GRI 418: 客户隐私 2016     | 418-1 | 强化数据安全与隐私保护<br>ESG 量化指标绩效表 |



# 独立鉴证报告



普华永道

2024/SH-0168  
(第一页, 共三页)

## 注册会计师独立鉴证报告

致：申万宏源集团股份有限公司董事会

我们接受委托，对申万宏源集团股份有限公司（“申万宏源”）2023年度可持续发展暨环境、社会及管治报告中选定的2023年度关键数据（以下简称“关键数据”）执行了有限保证的鉴证业务。

## 关键数据

本报告就以下选定的2023年度贵公司可持续发展暨环境、社会及管治报告关键数据实施了有限保证鉴证工作程序：

- 员工总数（不含申万宏源证券子公司）
- 女性员工人数（不含申万宏源证券子公司）
- 新进员工人数（不含申万宏源证券子公司）
- 公司总部北京办公大楼耗电量
- 总帮扶资金

我们的鉴证工作仅限于可持续发展暨环境、社会及管治报告中选定的2023年度关键数据，可持续发展暨环境、社会及管治报告中所披露的其他信息、2022年及以前年度信息均不在我们的工作范围内。

## 标准

申万宏源集团股份有限公司编制2023年度可持续发展暨环境、社会及管治报告关键数据所采用的标准列示于可持续发展暨环境、社会及管治报告中附录关键数据编报基础（以下简称“编报基础”）中。

## 管理层的责任

按照编报基础编制2023年度可持续发展暨环境、社会及管治报告关键数据是申万宏源集团股份有限公司管理层的责任。这种责任包括设计、执行和维护与编制可持续发展暨环境、社会及管治报告关键数据有关的内部控制，以使该等数据不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。

## 我们的独立性与质量管理

我们遵守了国际会计师职业道德准则理事会颁布的国际会计师职业道德守则（包括国际独立性标准）中的独立性及其他职业道德要求。该职业道德守则以诚信、客观、专业胜任能力及应有的关注、保密和良好职业行为为基本原则。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)  
中国上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼 邮编200021  
总机：+86 (21) 2323 8888, 传真：+86 (21) 2323 8800, www.pwccn.com



普华永道

2024/SH-0168  
(第二页, 共三页)

本事务所遵循国际质量管理准则第1号。该准则要求会计师事务所设计、实施和运行质量管理体系，包括与遵守职业道德要求、职业准则和适用的法律和法规要求相关的政策与程序。

## 注册会计师的责任

我们的责任是在执行鉴证工作的基础上对2023年度可持续发展暨环境、社会及管治报告关键数据发表结论。

我们根据《国际鉴证业务准则第3000号(修订版)--历史财务信息审计或审阅以外的鉴证业务》的规定执行了鉴证工作。该准则要求我们计划和实施工作，以形成鉴证结论。

有限保证鉴证业务所实施程序的性质和时间较合理保证鉴证业务有所不同，且范围较小。因此，有限保证鉴证业务获取的保证程度远低于合理保证鉴证业务。因此，我们不会就2023年度可持续发展暨环境、社会及管治报告中选定的2023年度关键数据是否在所有重大方面按照编报基础编制，发表合理保证意见。我们的鉴证工作包括评估2023年度可持续发展暨环境、社会及管治报告关键数据是否存在由于舞弊或错误导致的重大错报风险，以及应对评估出的风险。选择的鉴证程序取决于我们的判断及对项目风险的评估。在我们的工作范围内，我们仅在贵公司总部层面开展工作。我们没有对除贵公司总部外的其他分支机构实施鉴证工作。我们所实施的工作包括：

- 1) 与贵公司参与提供可持续发展暨环境、社会及管治报告中所选定的关键数据的相关部门员工进行访谈；
- 2) 实施分析程序；
- 3) 对选定的可持续发展暨环境、社会及管治报告中关键数据实施抽样检查；
- 4) 重新计算；
- 5) 我们认为必要的其他程序。

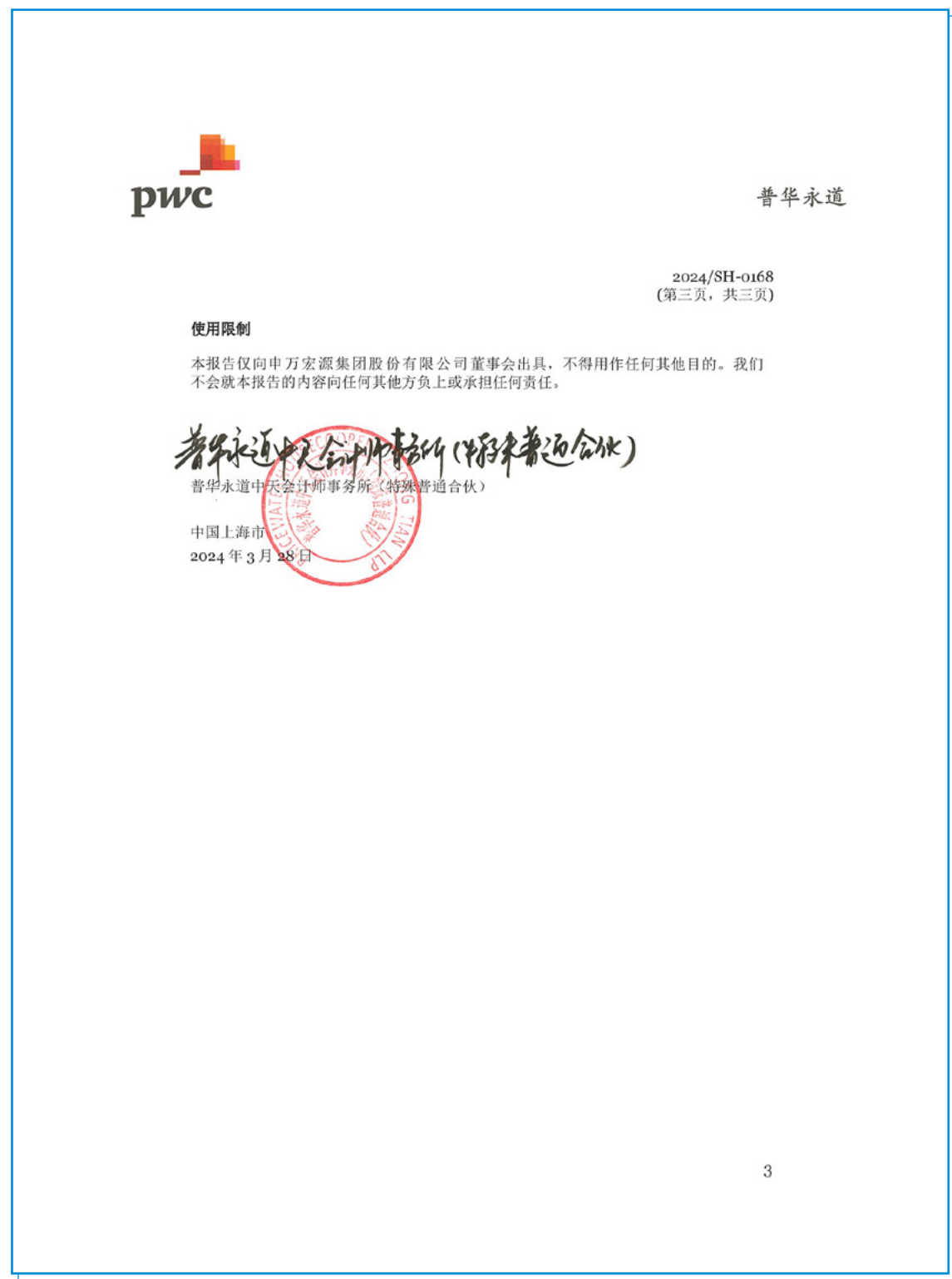
## 固有限制

我们提请使用者注意，针对非财务数据，尚无公认的评估和计量标准体系，因此存在不统一的计量方法，这将会影响公司间数据的可比性。

## 结论

基于已实施的程序及获取的证据，我们没有注意到任何事项使我们相信2023年度可持续发展暨环境、社会及管治报告中选定的2023年度关键数据未能在所有重大方面按照编报基础编制。

2



## 关键数据编报基础

### 员工总数（不含申万宏源证券子公司）

员工总数（不含申万宏源证券子公司）是指除申万宏源证券子公司之外，全集团范围内签订有劳动合同的员工总人数。

### 女性员工人数（不含申万宏源证券子公司）

女性员工人数（不含申万宏源证券子公司）是指除申万宏源证券子公司之外，全集团范围内签订有劳动合同的女性员工人数。

### 新进员工人数（不含申万宏源证券子公司）

新进员工人数（不含申万宏源证券子公司）是指除申万宏源证券子公司之外，全集团范围内签订有劳动合同的新进员工人数。

### 总帮扶资金

总帮扶资金是指申万宏源集团股份有限公司及下属子公司对外捐赠的总帮扶资金总额。

### 公司总部北京办公大楼耗电量

公司总部北京办公大楼耗电量是指申万宏源集团公司总部北京办公大楼的耗电量。

## 报告编制说明

本报告是申万宏源集团股份有限公司第 9 份社会责任报告暨环境、社会及管治报告，也是第 1 份可持续发展暨环境、社会及管治报告，向投资者等利益相关方披露了公司在经营中对于 ESG 议题所秉持的理念、建立的管理方法、推行的工作与达到的成效。

### 报告范围

本报告范围涵盖申万宏源集团股份有限公司及其子公司（简称“公司”“申万宏源”“申万宏源集团”）。除非特别说明，与申万宏源（000166（深交所）6806（香港联交所））同期合并财务报表范围一致。

在本报告中，除非文义另有所指，下列词语具有如下含义：

| 报告中公司简称            | 公司全称              |
|--------------------|-------------------|
| “公司”“申万宏源”“申万宏源集团” | 申万宏源集团股份有限公司及其子公司 |
| “集团公司”             | 申万宏源集团股份有限公司      |
| “申万宏源证券”           | 申万宏源证券有限公司        |
| “宏源汇富”             | 宏源汇富创业投资有限公司      |
| “宏源汇智”             | 宏源汇智投资有限公司        |
| “宏源期货”             | 宏源期货有限公司          |
| “申万宏源投资”           | 申万宏源投资有限公司        |
| “申万宏源产业投资”         | 申万宏源产业投资管理有限责任公司  |
| “申万宏源承销保荐”         | 申万宏源证券承销保荐有限责任公司  |
| “申万研究所”            | 上海申银万国证券研究所有限公司   |
| “申万投资”             | 申银万国投资有限公司        |
| “申万菱信”             | 申万菱信基金管理有限公司      |
| “申万创新投”            | 申银万国创新证券投资咨询有限公司  |
| “申万宏源西部”           | 申万宏源西部证券有限公司      |
| “香港公司”             | 申万宏源（香港）有限公司      |
| “申万宏源资管”           | 申万宏源证券资产管理有限公司    |

### 报告期间

本报告期间为 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日。本报告中的数据如无特别说明，均为在此期间内数据。

### 编制依据

本报告依据《深圳证券交易所上市公司自律监管指引第 1 号—主板上市公司规范运作（2023 年 12 月修订）》，香港联交所《上市规则》附录 C2 环境、社会及管治报告指引（2023 年 12 月 31 日生效版），并参照全球报告倡议组织（GRI）《可持续发展报告标准》（2021）编制。

### 数据说明

报告中数据和案例来自公司实际运行的正式记录。

报告中的财务数据均以人民币为单位。财务数据与公司年度财务报告不符的，以年度财务报告为准。

### 报告编制原则

#### 重要性

公司识别出投资者等利益相关方关注的与经营相关的实质性议题，作为本报告汇报重点。本报告中对实质性议题的汇报同时关注公司运营涉及的行业特征以及所在地区特征。实质性议题的分析过程及结果详见本报告“ESG 治理与管理”章节。同时，本报告对环境、社会和公司治理方面可能对投资人及其他相关方产生重要影响的事项进行重点汇报。

#### 准确性

本报告尽可能确保信息准确。其中，定量信息的测算已说明数据口径、计算依据与假定条件，以保证计算误差范围不会对信息使用者造成误导性影响。定量信息及附注信息详见本报告章节。

董事会对报告的内容进行保证，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

#### 平衡性

本报告内容反映客观事实，对涉及公司正面、负面的信息均予以不偏不倚的披露。

#### 清晰性

本报告以简体中文发布。本报告中包含表格、模型图以及专业名词表等信息，作为本报告中文字内容的辅助，便于利益相关方更好地理解报告中文字内容。为便于利益相关方更快获取信息，本报告提供目录及 ESG 标准的对标索引表。

#### 量化及一致性

本报告披露关键定量绩效指标，并尽可能披露历史数据。本报告对同一指标在不同报告期内的统计及披露方式保持一致；若统计及披露方式有更改，在报告附注中予以充分说明，以便利益相关方进行有意义的分析，评估公司 ESG 绩效水平发展趋势。

#### 完整性

本报告披露对象范围涵盖与公司合并财务报表范围保持一致。

#### 可验证性

本报告中案例和数据来自公司实际运行的原始记录或财务报告。公司采用 HiESG 绩效管理系统管理历年 ESG 量化绩效，所披露数据来源及计算过程均可追溯，可用于支持外部鉴证工作检查。

### 报告获取方式

本报告通过电子版形式发布，发布平台包括：

公司官方网站（www.swhygh.com）

香港交易及结算所有限公司披露易网站（www.hkexnews.hk）

深圳证券交易所官方网站（www.szse.cn）

巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）





## 申万宏源集团股份有限公司

<http://www.swwhygh.com/>

北京市西城区太平桥大街 19 号

咨询电话：010-88085333

新疆乌鲁木齐市高新区北京南路 358 号大成国际 20 楼

咨询电话：0991-2301870