

2021年度 环境信息披露报告

长城证券股份有限公司

2022年6月



关于本报告

在全球气候变化治理体系新格局确立，以及后疫情时期中国和世界经济加快绿色复苏的大背景下，发展绿色金融、提升气候和环境风险识别和管理能力，成为金融机构可持续发展重要途径。中国证券业协会《证券行业文化建设十要素》要求证券公司坚持可持续发展，鼓励构建 ESG（环境、社会、治理）治理架构和治理机制，推动经济、社会、环境的协调发展。环境信息披露制度是中国绿色金融体系的重要组成部分，长城证券股份有限公司响应深圳市地方金融监督管理局、深圳市人民政府金融工作办公室等对深圳市金融机构环境信息披露试点的最新政策要求，编制 2021 年度环境信息披露报告，全面披露长城证券股份有限公司 2021 年度环境相关治理结构、战略及政策制度、绿色金融产品与服务创新，以及气候环境风险和机遇的识别管理、经营活动和投融资活动的碳排放碳减排等环境相关信息，全力支持国家绿色金融工作建设，争做绿色金融发展主力军，打造长城证券绿色品牌。

- **报告期间：**2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日，适当追溯及展望。
- **报告周期：**年度报告。
- **报告范围：**本报告以长城证券股份有限公司为主体，若无特殊说明，披露范围与公司 2021 年度合并财务报表范围一致。
- **编制依据：**本报告依据《深圳市金融机构环境信息披露指引（征求意见稿）》、《深圳市金融机构环境信息披露模板及指标说明（征求意见稿）》，并参考《金融机构环境信息披露指南》、《气候相关财务信息披露工作组（TCFD）建议报告》、《金融机构碳核算技术指南（试行）》等相关要求进行披露。
- **数据说明：**本报告所有数据均源自长城证券股份有限公司正式文件、内部统计和公开渠道。如无特别说明，本报告涉及金额均以人民币作为计量币种。
- **指代说明：**为便于阅读，本报告“长城证券股份有限公司”简称“长城证券”、“本公司”、“公司”或“我司”。
- **全球法人识别编码（LEI）：**300300E1006344000004。
- **发布形式：**本报告于 2022 年 6 月 30 日以 PDF 电子版形式在长城证券股份有限公司官方网站(<http://www.cgws.com>) 公开披露，方便投资者阅读、下载。

目 录

第一部分 基本信息	1
第二部分 战略目标	2
一、 环境、绿色金融相关目标.....	2
二、 环境、绿色金融相关发展战略.....	2
第三部分 环境及绿色金融相关治理结构	4
一、 董事会层面.....	4
二、 经营管理层层面.....	4
三、 专业部门层面.....	4
第四部分 环境及绿色金融相关政策制度	5
一、 内部政策.....	5
二、 外部政策.....	6
第五部分 环境风险管理	8
一、 环境风险及机遇管理机制.....	8
二、 识别的环境风险和机遇.....	10
第六部分 经营活动的环境影响	13
一、 经营活动能源消耗.....	13
二、 温室气体排放.....	14
三、 环保措施及环境效益.....	16
四、 经营活动环境影响的量化测算.....	16
第七部分 投融资活动的环境影响	20
一、 整体投融资情况.....	20
二、 绿色投融资活动情况.....	21
三、 绿色投融资活动环境效益.....	23
四、 整体投融资活动碳排放.....	24
五、 投融资环境影响的测算方法学与表达.....	25
第八部分 绿色金融培训及公益活动	27
一、 绿色金融培训.....	27
二、 公益活动.....	27
第九部分 绿色金融创新案例及成果奖项	30
一、 绿色金融、环境风险分析相关研究成果.....	30
二、 绿色金融奖项.....	31
第十部分 数据梳理、校验及保护	32
一、 数据梳理、校验及保护.....	32
二、 数据安全应急预案.....	32
附录 1：金融机构环境信息披露指南索引目录	34

附录 2：气候相关财务信息披露工作组（TCFD）建议内容索引 35

图 表 目 录

图 1: 长城证券正式加入联合国负责任投资原则组织 (PRI)	7
图 2: 长城证券环境风险识别、评估及监控流程	8
图 3: 长城证券 ESG 评价流程	9
图 4: 长城证券经营活动温室气体排放 (2020 年、2021 年)	15
图 5: 长城证券经营活动温室气体排放瀑布图 (2021 年)	16
图 6: 长城证券符合统计口径投资资产前三大行业 (2020 年)	20
图 7: 长城证券符合统计口径投资资产前三大行业 (2021 年)	21
图 8: 长城证券符合统计口径绿色投资分类统计 (2020 年、2021 年)	22
图 9: 长城证券绿色金融主题线上培训教育基地	27
图 10: 长城证券开展公益植树活动	28
图 11: 长城证券响应“低碳生活”号召, 组织长跑活动	29
图 12: 长城证券碳中和指数发布	30
图 13: 长城证券数据管理、安全管理、应急预案相关制度	32
表 1: 长城证券基本信息	1
表 2: 长城证券现行环境、绿色金融相关政策制度	5
表 3: 长城证券分识别短期、中期、长期环境相关风险与机遇	10
表 4: 长城证券经营活动能源消耗 (2020 年、2021 年)	13
表 5: 长城证券经营活动资源消耗 (2020 年、2021 年)	14
表 6: 长城证券经营活动温室气体排放 (2020 年、2021 年)	14
表 7: 长城证券符合统计口径绿色投资分类统计 (2020 年、2021 年)	22
表 8: 长城证券绿色投融资活动环境效益指标表 (2021 年)	24
表 9: 长城证券投融资活动碳排放数据汇总 (2021 年)	24
表 10: 投融资碳排放量测算方法学 (非项目类投资)	25

第一部分 基本信息

长城证券于 1995 年获准成立，于 2015 年整体变更设立股份有限公司。2018 年 10 月 26 日，长城证券首次向社会公开发行股票并在深圳证券交易所上市交易，证券代码 002939。

作为国内较早成立的综合类证券公司之一，经过二十余年的发展壮大，长城证券已经成长为一家资质齐全、业务覆盖全国的综合金融体，形成了多功能协调发展的金融业务体系。

表 1：长城证券基本信息

指标	内容
统一社会信用代码	91440300192431912U
法定代表人	张巍
填报负责人	吴礼信
全球法人识别编码 (Legal Entity Identifier, LEI)	300300E1006344000004
总部所在地	深圳
经营位置	广东省深圳市福田区金田路 2026 号能源大厦南塔楼 10-19 层
主要产品和服务	证券经纪，证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；融资融券；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；代销金融产品；证券投资基金托管。
服务的客户类型	个人投资者、机构投资者及企业客户

第二部分 战略目标

一、环境、绿色金融相关目标

（一）目标设置与完成情况

2021 年是我国开启“碳中和”征程的元年，碳达峰·碳中和“3060 目标”作为国家级绿色发展战略，将引领第三次能源革命，重构未来经济社会发展趋势和边界。

我司坚决贯彻党中央、国务院关于“碳达峰、碳中和”（“双碳”）目标战略部署，认真落实监管部门决策安排，始终坚持华能金融的初心和担当，聚焦“科创金融、绿色金融、产业金融”特色化发展，发挥专业优势，积极践行行业责任，为保障“双碳”目标实现注入金融力量。

（二）目标完成情况

2021 年，我司在 2020 年绿色投融资活动基础上，加大绿色业务创新力度，探索企业绿色融资业务，增加绿色资产投资。绿色融资方面，债权绿色融资及股权绿色融资共计承销 44.52 亿元，同比 2020 年（14.00 亿元）增加 218.00%。绿色投资方面，符合统计口径绿色投资资产 13.55 亿元，同比 2020 年（12.58 亿元）增加 7.68%。

二、环境、绿色金融相关发展战略

（一）中长期发展战略及行动计划

为贯彻落实党中央、国务院关于推动生态文明建设，发展绿色低碳循环经济的重大决策，进一步推动绿色金融创新发展和“碳达峰”“碳中和”目标实现，公司在“十四五”战略规划的指导下，编制了《长城证券绿色金融行动意见》（本章简称《意见》）。《意见》要求，积极践行“转型与创新为核心的双轨战略”，坚持“数字化、平台化”的转型以及“专业化、产业化”的创新，实现本质安全和高质量发展，奋力创建精于电力、能源领域的特色化一流证券公司。

（二）与整体战略的关系

“安全”“领先”战略思想是长城证券的文化内核。公司立足中央企业、上市公司、金融机构三大属性，深入挖掘自身资源禀赋，以“安全”“领先”为战略指导思想，打造以“数字券商、智慧投资、科创金融”为目标的综合型现代投资银行，发挥公司作为能源央企控股上市券商的优势地位，全面规划零碳能源的金融助力路径，积极服务于碳达峰、碳中和“3060”目标的国家级绿色发展战略。

《意见》是全面贯彻落实公司战略规划的主要途径之一。公司围绕“双碳”产业价值链，聚焦以华能集团担任链长的四大产业链，打造科创金融智慧生态平台，服务能源绿色转型，在绿色金融领域，强调着力贯彻落实绿色金融发展理念，助力国家“双碳”战略。

此外，产融结合作为实体经济和金融经济体融合发展的新发展方式，是助力实体产业持续健康发展的有效手段。长城证券作为产业背景券商，将以“科创金融、绿色金融、产业金融”为特色，结合华能集团禀赋，以科创金融港为发展平台，以华能集团统筹引领为发展保障，打造新时期高质量产业金融新模式，发挥强链、补链、延长链的重要功能，推动以融促产、以融强产，瞄准产能结构转换、新旧动能转换大方向，在产业与各类金融市场之间搭建桥梁，助力加快产业跨越式发展。

第三部分 环境及绿色金融相关治理结构

一、 董事会层面

公司董事会高度重视绿色金融和社会责任相关工作，在董事会的积极领导下，公司努力发挥专业优势服务实体经济、助力产融结合，大力发展绿色金融。作为深圳证券交易所主板上市公司，公司自 2019 年度起，每年编制社会责任报告，绿色金融作为其中重要内容之一，经董事会审议通过后公开披露。长城证券将凭借专业能力与资源优势，通过进一步丰富绿色债券、资产证券化等产品体系，探索产融发展新模式，助力国家“双碳”目标早日实现。截至本报告发布日，公司董事会暂未设置环境、绿色金融相关委员会。

二、 经营管理层层面

公司经营管理层根据董事会确定的相关战略方针，严格落实董事会相关决议，统筹开展绿色金融相关工作。李翔总裁为我司经营管理层在社会 responsibility、ESG 管理议题的主要负责人，同时李翔总裁作为公司控股股东华能资本服务有限公司的绿色金融发展工作领导小组成员之一，代表我司参与、制定华能集团绿色金融发展相关制度或决议。

三、 专业部门层面

我司绿色金融业务开展情况由战略创新部统筹，战略创新部依托科创金融智慧生态平台协同模块，协同督导投资银行业务条线等相关部门在绿色债券、绿色 ABS 等绿色金融业务领域加大项目推进力度。同时，战略创新部牵头打造科创金融港，建立产融一体化协同体系，依托三大图谱绘制，智能识别“双碳”产业链核心企业，以技术赋能为牵引，管理赋能与市场赋能为支撑，联合“产学研政研金”构建产业链与创新链深度融合的产业金融孵化生态圈，助力具有核心技术促进绿色转型或可持续发展的科创企业成长壮大。

第四部分 环境及绿色金融相关政策制度

一、 内部政策

（一） 现行的环境、绿色金融相关政策制度

作为深圳市金融机构环境信息披露工作试点机构之一，我司在国家出台“双碳”战略、绿色金融体系不断完善等背景下，制定了环境相关政策制度，一方面完善内部管理制度，推动各业务条线在绿色金融业务上发展；另一方面不断践行联合国负责任投资原则（PRI）；同时，不断减少自身运营碳排放、促进自身绿色办公经营，降低资产组合碳强度，以实际行动服务国家“双碳”战略。

表 2：长城证券现行环境、绿色金融相关政策制度

文件名称	发文字号	文件类型	文件主要内容	备注
《长城证券绿色金融行动意见》	长证字 (2021) 321 号	战略 规划 类	按照长城证券“十四五”“数字券商、智慧投资、科创金融”发展目标及奋力创建精于电力、能源领域的特色化一流证券公司要求，制定《长城证券绿色金融行动意见》，推动绿色金融服务，支持绿色产业发展	报 告 期 内 新 增
《关于长城证券股份有限公司加入联合国责任投资原则（PRI）组织的报告》	长证字 (2021) 337 号	业 务 发 展 类	打造以 ESG 为标签的资产管理业务，长城证券作为“投资管理人”角色加入联合国责任投资原则组织，系统践行责任投资	报 告 期 内 新 增
《关于重申加强职场纪律的通知》	-	通知	要求用餐员工按需取餐，杜绝浪费	-

（二） 报告期内实施的新政策

按照我司“十四五”“数字券商、智慧投资、科创金融”发展目标及奋力创建精于电力、能源领域的特色化一流证券公司要求，公司制定了《长城证券绿色金融行动意见》（本节简称《意见》），推动绿色金融服务，支持绿色产业发展。《意见》要求，公司通过发挥各条线业务专长为华能集团与能源产业提供绿色转型服务、全生命周期业务协同、践行绿色低碳循环发展理念打造公司绿

色品牌三个维度，结合公司业务开展提出行动意见。

为顺应国际大趋势及当下监管环境，积极借鉴国内外先进经验和全球共识，学习全球权威标准制定机构的信息披露框架，结合长城证券实际情况，制定《关于长城证券股份有限公司加入联合国责任投资原则（PRI）组织的报告》（长证字〔2021〕337号）。打造以 ESG 为标签的资产管理业务，长城证券作为“投资管理人”角色加入联合国责任投资原则组织，系统践行责任投资。

《关于重申加强职场纪律的通知》，提倡绿色生活，提倡绿色低碳理念，要求员工节约粮食，按需取餐、杜绝浪费。

二、外部政策

（一）遵循的外部环境、气候及绿色金融相关政策法规情况

我司严格落实《深圳经济特区绿色金融条例》（深圳市第六届人民代表大会常务委员会公告 第二二二号）、《深圳市金融机构环境信息披露指引（征求意见稿）》、《深圳市金融机构环境信息披露模板及指标说明（征求意见稿）》等文件要求，制定本报告完成长城证券环境信息披露。同时，我司大力承销绿色债券、绿色 ABS，探索企业绿色融资业务，不断提高绿色资产投资规模及比例。

披露报告期内，我司严格遵守国家、广东省、深圳市相关部门关于生态环境、绿色金融要求，未发生生态环境、绿色金融相关行政处罚、司法判决等。

（二）加入国内外相关倡议组织的情况

公司于 2021 年 12 月收到联合国支持的“负责任投资原则”组织（The United Nations supported Principles for Responsible Investment，以下简称“负责任投资原则”组织）通知，公司已正式加入该组织，以投资管理人身份签署“负责任投资原则”。

“负责任投资原则”组织是由联合国支持的国际非营利组织，旨在帮助投资者认识环境、社会和治理（以下简称 ESG）问题对投资的影响，并支持签署方将 ESG 问题纳入投资和所有权决策。



Signatory of:



图 1：长城证券正式加入联合国负责任投资原则组织（PRI）

长城证券作为华能集团旗下的金融上市平台，在华能集团打造世界一流现代化清洁能源企业的战略目标背景下，长城证券一直在尝试通过金融手段助力集团的碳减排，最终实现碳中和的目标。加入 UN PRI 组织，是长城证券顺应全球责任投资的趋势和中国双碳目标的国家战略、打造以 ESG 投资和绿色金融为主要理念的资产管理业务的重要一步。

加入 UN PRI 组织，既展现出长城证券立志成为一家与国际接轨、拥有自主 ESG 系统知识产权的证券公司的决心，又表明了国际社会对长城证券在践行 ESG 投资理念和承担社会责任方面所作努力的认可。长城证券借此之机，将积极借鉴国外先进经验，打造出以 ESG 为标签的“长城特色”资产管理业务。

第五部分 环境风险管理

一、环境风险及机遇管理机制

践行并推动 ESG 投资在中国市场的落地，既是国家和金融行业发展的需要，也是长城证券作为证券公司内生发展的需要。近年来，国内上市公司道德风险事件频出，非财务因素“黑天鹅”风险层出不穷，ESG 投资理念在国内资本市场的应用也越趋重要。

长城证券一直注重 ESG 投资理念实践，是国内最早将 ESG 纳入投资决策框架金融机构之一，开发了拥有自主知识产权的长城 ESG 投研体系，公开发布了 ESG 相关指数，在制度框架、人才储备与物质基础上均具备了践行 UN PRI 组织原则的客观条件。

（一）环境风险的识别、评估和监控流程

我司自主开发 ESG 投研体系，将环境风险纳入投前、投中、投后阶段投资决策中，形成全流程闭环管理，提高投资决策对环境风险识别的精确度、高效性、及时性。



图 2：长城证券环境风险识别、评估及监控流程

（二）业务风险管理流程中对环境风险和机遇的体现

国家对绿色金融转型金融政策不断完善。围绕国家发改委《绿色产业指导目录（2019）》，监管部门推动节能环保产业、清洁生产产业、清洁能源产业、生态环境产业、基础设施绿色升级、绿色服务六大领域发展，通过金融支持实体产业绿色发展，推动绿色金融发展。同时，面向火电、钢铁、化工、石化、有色、冶炼、造纸、航空等八大高能耗行业，国家通过碳排放权益试点及管理，服务“3060 双碳目标”实现，制定转型金融发展政策及路径。

我司在各业务流程中，通过分析各业务条线与国家在绿色金融、转型金融方面政策方针，加强对环境风险与机遇管理。在投行业务条线中，加强绿色债券、绿色 ABS 承销；在资产管理、自营业务条线中，通过构建 ESG 投研体系，加强对环境风险及机遇的识别及管理。

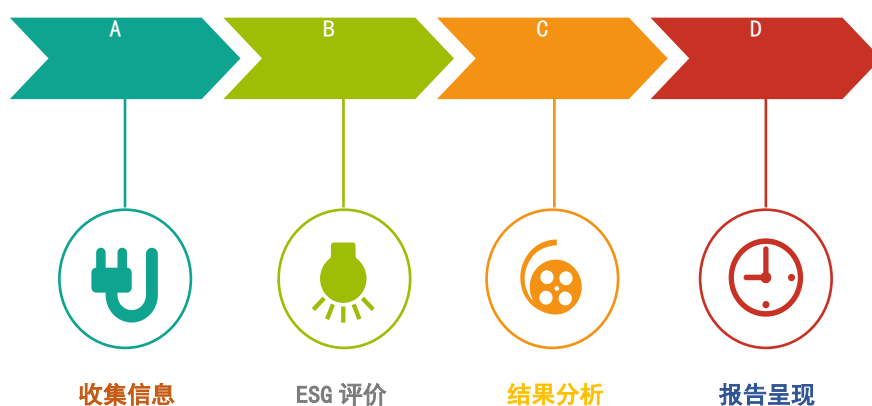


图 3：长城证券 ESG 评价流程

（三）针对环境相关风险暴露的应对预案

在投后 ESG 评价管理中，我司通过对被投资企业舆情监控，对 ESG 评价结果动态更新管理。在被投资企业出现重大环境事件或环境风险时，及时分析更新后 ESG 评价结果，识别环境风险暴露敞口变化趋势及原因，严格执行我司风险管理制度。

二、识别的环境风险和机遇

（一）识别的短期、中期、长期环境相关风险和机遇

参照气候变化相关财务信息披露指南工作小组（Task Force on Climate-Related Financial Disclosures，简称 TCFD）对环境风险识别方法学，主要存在两类气候与环境风险：物理风险及转型风险。

表 3：长城证券分识别短期、中期、长期环境相关风险与机遇

类型	影响时期	气候环境相关风险	潜在财务影响 (对我司或我司投资对象产生影响)	气候环境相关机遇
物理风险	短期	急性 极端天气：台风、洪水、冰雹等	-生产中断 -注销和提前淘汰现有资产	气候投融资（适应气候变化）
	长期	慢性 —平均气温上升 —海平面上升 —降水模式和天气模式的极端变化 —生物多样性丧失 —粮食安全、水安全	-生产能力下降或中断 -劳动力管理和规划的影响 -注销和提前淘汰现有资产 -融资企业增加运营成本 -增加资本成本 -降低销售收入	气候投融资（减缓气候变化） 生物多样性金融
转型风险	中期	政策和法律 —增加温室气体排放的价格 —增强排放报告义务 —对现有产品和服务的授权和监管 —接触风险	-增加运营成本（合规成本） -由于政策变化，现有资产的核销和提前淘汰 -损害资产 -增加保险费 -罚款和判决 -被投资企业资产价格下降	绿色金融：支持绿色产业 转型金融：支持碳密集产业低碳绿色转型 碳金融：碳排放外部成本内部化
		技术 —用较低排放的产品和服务替代现有产品和服务 —对新技术的失败投资 —向低排放技术过渡的前期成本	—现有资产的核销和提前淘汰 -减少对产品和服务的需求 -新技术和替代技术的前期研究与开发（R&D）支出 -技术开发前期资本投资 -采用/部署新实践和流程的前期成本	
		市场 —改变客户行为 —市场信号的不确定性 —增加原材料成本	—由于消费者偏好的转变，减少对商品和服务的需求 -由于输入价格和产出要求的变化而增加了生产成本 -能源成本突然和非预期的变化 -改变收入组合和来源 -资产重新定价和重新定价速度	
		声誉	—减少对商品/服务的需求	

类型	影响时期	气候环境相关风险	潜在财务影响 (对我司或我司投资对象产生影响)	气候环境相关机遇
		—消费者偏好的转变 —行业歧视 —增加利益相关者关注或负面利益 相关者反馈	-生产能力减少或中断 -影响员工的管理和规划 -资本可用性减少	

注：来源参考：TCFD(2016)

（二）环境相关风险和机遇对战略、业务和财务规划的影响

上述物理风险、转型风险通过影响金融机构自身、投融资服务企业对象经营活动，最终对金融机构财务产生影响。物理风险按存在影响时间长度，具体为短期影响、长期影响两种，金融机构通过气候投融资等措施适应或减缓，因此气候投融资是物理风险带来机遇。转型风险，主要为中期影响，通过绿色金融、转型金融、碳金融减缓，因此绿色金融、转型金融、碳金融是转型风险带来机遇。

因此，气候环境的物理风险和转型风险均会通过直接传导渠道、间接传导渠道，由实体经济传递至我司。

积极把握新能源发展及“双碳”机遇。中央经济工作会议再次为我国“双碳”工作开展进行了谋划和部署。助力“双碳”战略仍然是金融体系服务实体经济的重要内容，预计绿色金融顶层设计将进一步完善，绿色债券产品标准、绿色资产证券化产品、碳汇产品体系等都将进一步丰富。我司作为能源央企控股券商，有望凭借专业能力与资源优势，围绕新能源革命、技术革命、电网革命等，通过产融发展新模式，助力“双碳”目标达成。

（三）应对环境影响采取的措施和效果

❖ 环境风险应对措施及效果

在自身经营方面，2021 年我司持续提升绿色办公理念，不断增强绿色运营水平，厉行节约强化能耗管理。

绿色办公。2021 年，我司营业、办公活动消耗水 4196.63 吨，较 2020 年减少 1,351.63 吨，降幅 24.36%。消耗电力 104.89 万千瓦时，较 2020 年减少 5.82 万千瓦时，降幅 5.25%。

线上服务。我司不断推行线上服务，通过为客户提供便捷高效线上开户、账户管理等业务，节约纸张消耗量。2021 年办理特定线上业务 248.21 万笔，较

2020年增加14.54万笔，增幅6.22%。根据各类业务对应节约纸张量，2021年线上服务共计节约纸张1397.46万张，较2020年节约纸张量增加200.73万张，增幅16.77%；2021年，线上服务相当于节约消耗纸张带来二氧化碳减排量213.55吨，较2020年二氧化碳减排量增加30.67吨，增幅16.77%。

在投融资方面，我司大力承销绿色债券、绿色ABS，探索企业绿色融资业务，不断提高绿色资产投资规模及比例。同时在投资管理中，加大ESG投研体系应用，严格控制气候与环境风险敞口。

第六部分 经营活动的环境影响

一、经营活动能源消耗

2021 年，我司经营活动消耗能源中，自有交通运输工具消耗的汽油 7395.28 升，受疫情影响，同比 2020 年增加 51.03%，人均消耗 2.25 升。2021 年，我司营业办公消耗电力 104.89 万千瓦时，同比 2020 年减少 5.25%；人均消耗 318.81 千瓦时，同比减少 5.43%。2021 年，我司雇员因差旅出行乘坐的交通工具消耗的能源 590.79 吨标准煤，同比 2020 年减少 3.55%；人均消耗 0.18 吨标准煤，同比减少 3.73%。

表 4：长城证券经营活动能源消耗（2020 年、2021 年）

统计指标	消耗量				人均				
	单位	2020 年	2021 年	同比 (%)	单位	2020 年	2021 年	同比 (%)	
能源消耗	自有交通运输工具消耗的汽油	升	4,896.50	7,395.28	51.03	升/人	1.49	2.25	50.76
	营业办公消耗电力	千瓦时	1,107,058.40	1,048,896.70	-5.25	千瓦时/人	337.11	318.81	-5.43
	雇员因差旅出行乘坐的交通工具消耗的能源	吨标准煤	612.56	590.79	-3.55	吨标准煤/人	0.19	0.18	-3.73

注：1、自有交通运输工具消耗的汽油、营业办公消耗的电力，统计范围均为公司总部大楼；差旅出行，统计范围均为全公司。2、人均自然资源消耗测算以我司 2020 年末员工总数 3284 人、2021 年末员工总数 3290 人为测算基准。3、受疫情影响，2020 年公车用量较其他年份偏小，导致 2021 年同比数值偏大。4、我司食堂采用电灶，未产生对应天然气消耗量。

2021 年，我司经营活动消耗资源中，营业办公耗水 4196.63 吨，同比 2020 年减少 24.36%，人均消耗 1.28 吨，同比减少 24.50%。2021 年，我司营业办公用纸 8.84 吨，受疫情影响，同比 2020 年增加 23.85%；人均消耗 0.0027 吨。同时，2021 年，我司产生一般废弃物 22.75 吨，同比 2020 年减少 5.01%，人均

0.0069 吨，同比减少 5.18%；产生电子废弃物 0.17 吨，同比 2020 年减少 12.95%，人均 0.051 千克，同比减少 13.11%。

表 5：长城证券经营活动资源消耗（2020 年、2021 年）

统计指标		消耗量			人均				
		单位	2020 年	2021 年	同比 (%)	单位	2020 年	2021 年	同比 (%)
资源消耗	营业办公耗水	吨	5,548.26	4,196.63	-24.36	吨/人	1.69	1.28	-24.50
	营业办公用纸	吨	7.14	8.84	23.85	吨/人	0.0022	0.0027	23.63
废弃物	一般废弃物	吨	23.95	22.75	-5.01	吨/人	0.0073	0.0069	-5.18
	电子废弃物	吨	0.19	0.17	-12.95	千克/人	0.059	0.051	-13.11

注：1、营业办公耗水、营业办公用纸、一般废弃物、电子废弃物，统计范围均为公司总部大楼，一般废弃物统计对象主要为废弃纸张类及餐厨废弃物，电子废弃物统计对象主要为硒鼓。2、人均自然资源消耗测算以我司 2020 年末员工总数 3284 人、2021 年末员工总数 3290 人为测算基准。3、受疫情影响，2020 年办公用纸量较其他年份偏小，导致 2021 年同比数值偏大。

二、温室气体排放

2021 年，我司经营活动温室气体排放总量 2944.10 吨二氧化碳当量，与 2020 年基本持平；人均排放 0.89 吨二氧化碳当量，同比减少 0.16%。

其中，2021 年直接温室气体排放总量（范围一）15.68 吨二氧化碳当量，受疫情影响，同比增加 51.03%；人均排放 0.005 吨二氧化碳当量。2021 年能源产生间接温室气体排放总量（范围二）473.26 吨二氧化碳当量，同比减少 5.25%；人均排放 0.14 吨二氧化碳当量，同比减少 5.43%。2021 年其他经营活动产生间接温室气体排放总量（范围三）2455.15 吨二氧化碳当量，同比增加 0.89%；人均排放 0.75 吨二氧化碳当量，同比减少 0.71%。

表 6：长城证券经营活动温室气体排放（2020 年、2021 年）

温室气体排放范围	总排放量 (吨二氧化碳当量)			人均排放量 (吨二氧化碳当量/人)		
	2020 年	2021 年	同比 (%)	2020 年	2021 年	同比 (%)
直接温室气体排放总量 (范围一)	10.38	15.68	51.03	0.003	0.005	50.76
能源产生间接温室气体排放总量 (范围二)	499.50	473.26	-5.25	0.15	0.14	-5.43

长城证券股份有限公司环境信息披露报告（2021 年度）

温室气体排放范围		总排放量 (吨二氧化碳当量)			人均排放量 (吨二氧化碳当量/人)		
		2020 年	2021 年	同比 (%)	2020 年	2021 年	同比 (%)
其他经营活动产生 间接温室气体排放总量 (范围三)	差旅出行	1,353.75	1,305.64	-3.55	0.41	0.40	-3.73
	差旅住宿	1,040.41	1,107.70	6.47	0.32	0.34	6.27
	办公用纸	24.98	30.94	23.85	0.008	0.009	23.63
	用水	14.37	10.87	-24.36	0.004	0.003	-24.50
	小计	2,433.51	2,455.15	0.89	0.74	0.75	0.71
温室气体排放总量		2,943.40	2,944.10	0.02	0.90	0.89	-0.16

注：1、温室气体排放因子引自中国银行保险监督管理委员会《绿色信贷项目节能量测算指引》、生态部环境规划院《中国产品全生命周期温室气体排放系数集（2022）》、《深圳市金融机构环境信息披露模板及指标说明》等文件。2、自有交通运输工具消耗的汽油、营业办公消耗的电力、营业办公耗水、营业办公用纸，统计范围均为公司总部大楼；差旅出行、差旅住宿，统计范围均为全公司；其他经营活动产生间接温室气体排放总量（范围三），暂不统计废弃物对应碳排放。3、直接温室气体排放总量（范围一）主要来自于自有交通运输工具消耗的汽油排放二氧化碳。受疫情影响，2020 年自有交通运输工具消耗的汽油量较其他年份偏小，导致 2021 年直接温室气体排放总量（范围一）同比数值偏大。受疫情影响，2020 年办公用纸量较其他年份偏小，导致 2021 年办公用纸对应温室气体排放量同比数值偏大。4、人均自然资源消耗和人均温室气体排放测算以我司 2020 年末员工总数 3284 人、2021 年末员工总数 3290 人为测算基准。

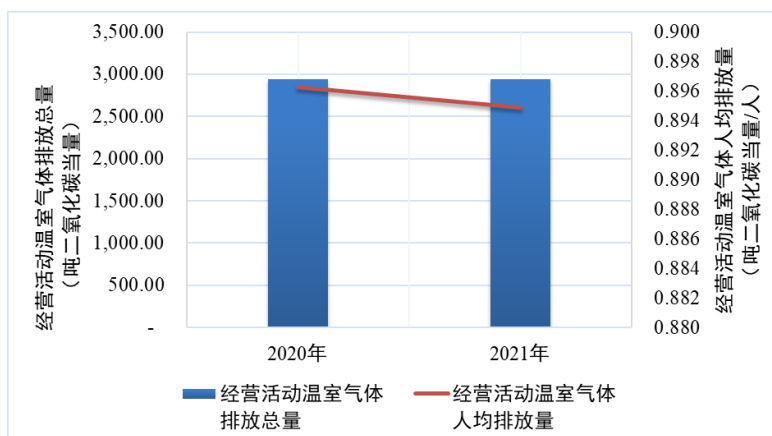


图 4：长城证券经营活动温室气体排放（2020 年、2021 年）

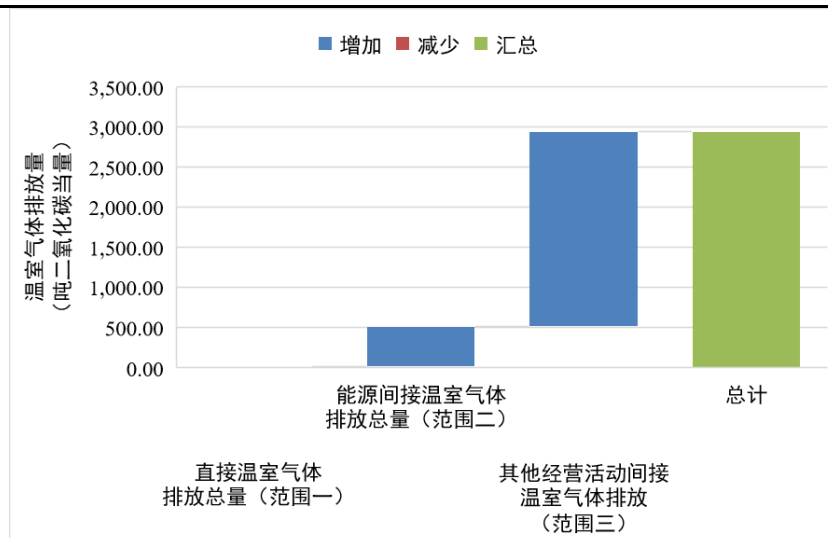


图 5：长城证券经营活动温室气体排放瀑布图（2021 年）

三、环保措施及环境效益

（一）环保措施

报告期内，我司采取多种措施，降低经营活动对环境影响。具体内容包括，大力推行线上办公、节约用水与用电、垃圾分类、大力开展线上服务等。

（二）环境效益

2021 年，我司持续提升绿色办公理念，不断增强绿色运营水平，厉行节约强化能耗管理。

绿色办公。2021 年，我司营业、办公活动消耗水 4196.63 吨，较 2020 年减少 1,351.63 吨，降幅 24.36%。消耗电力 104.89 万千瓦时，较 2020 年减少 5.82 万千瓦时，降幅 5.25%。

线上服务。我司不断推行线上服务，通过为客户提供便捷高效线上开户、账户管理等业务，节约纸张消耗量。2021 年办理特定线上业务 248.21 万笔，较 2020 年增加 14.54 万笔，增幅 6.22%。根据各类业务对应节约纸张量，2021 年线上服务共计节约纸张 1397.46 万张，较 2020 年增加 200.73 万张，增幅 16.77%；2021 年，线上服务相当于节约消耗纸张带来二氧化碳减排量 213.55 吨，较 2020 年二氧化碳减排量增加 30.67 吨，增幅 16.77%。

四、经营活动环境影响的量化测算

（一）测算指标的统计口径

在本报告中，我司自有交通工具所消耗的汽油、经营办公活动的用水量、用电量和用纸量统计范围均为公司总部大楼，差旅出行、差旅住宿统计范围均为全公司。因此，直接温室气体的排放量（范围一）和能源产生间接温室气体排放总量（范围二）也为公司总部大楼。在人均碳排放量和人均自然资源消耗测度方面，本报告以我司 2020 年末员工总数 3284 人、2021 年末员工总数 3290 人为测算基准。

（二）经营活动环境影响的测算方法学

本行经营活动产生的直接温室气体排放、采购产品或服务产生的间接温室气体排放的测算依据中国人民银行 2021 年 7 月发布的《金融机构碳核算技术指南（试行）》（以下简称《指南》）相关要求。《指南》规定金融机构自身经营活动的碳排放核算按照《工业企业温室气体排放核算和报告通则》规定的算法进行核算，相关计算公式如下：

❖ 直接温室气体排放的核算（范围一）

$$E_{\text{燃烧}} = \sum_{i=1}^n (AD_i \times EF_i)$$

上式中：

$E_{\text{燃烧}}$ ：核算期内消耗的化石燃料燃烧产生的二氧化碳排放，单位：吨二氧化碳（ tCO_2 ）；

AD_i ：核算和报告年度内第 i 种化石燃料的活动水平，单位：百万千焦（ GJ ）；

EF_i ：第 i 种化石燃料的二氧化碳排放因子，单位：吨二氧化碳每吉焦（ tCO_2/GJ ）；

i ：化石燃料类型代号。

其中，核算期内燃料燃烧的活动数据是各种燃料的消耗量与平均低位发热量乘积，按下式计算：

$$AD_i = NCV_i \times FC_i$$

上式中：

AD_i : 核算和报告年度内第 i 种化石燃料的活动水平, 单位: 百万千焦 (GJ) ;

NCV_i : 第 i 种燃料的平均低位发热量, 液体燃料单位: 百万千焦/吨 (GJ/t) ;

FC_i : 第 i 种燃料的净消耗量, 液体燃料单位: 吨 (t) ; 对气体燃料, 单位为万标立方米 ($10^4 Nm^3$) 。

而燃料燃烧的二氧化碳排放因子按式下式计算:

$$EF_i = CC_i \times OF_i \times \frac{44}{12}$$

上式中:

EF_i : 第 i 种化石燃料的二氧化碳排放因子, 单位: 吨二氧化碳每吉焦 (tCO_2/GJ) ;

CC_i : 第 i 种燃料的单位热值含碳量, 单位: 吨碳/百万千焦 (tC/GJ) ;

OF_i : 第 i 种燃料的碳氧化率, 单位: %;

44/12: 二氧化碳与碳的相对分子质量之比。

❖ 直接温室气体排放的核算（范围一）测算示例

2021 年我司自有交通运输工具消耗的汽油 7395.28 升, 汽油低位发热量 43.07 GJ/t, 单位热值含碳量 $18.9 \times 10^{-3} tC/GJ$, 直接排放二氧化碳 15.68 吨。

❖ 能源产生间接温室气体排放总量（范围二）

$$E_{\text{购入电}} = AD_{\text{购入电}} \times EF_{\text{电力}}$$

上式中:

$E_{\text{购入电}}$: 购入电力所产生的二氧化碳排放量, 单位为吨二氧化碳 (tCO_2) ;

$AD_{\text{购入电}}$: 核算期内购入的电量, 单位为兆瓦时 (MWh) ;

$EF_{\text{电力}}$: 电力的二氧化碳排放因子, 单位为吨二氧化碳每兆瓦时 (tCO_2/MWh)

❖ 能源产生间接温室气体排放总量（范围二）测算示例

2021 年我司用电 104.89 万千瓦时，根据《深圳市金融机构环境信息披露模板及指标说明》，广东省电网平均排放因子 $0.4512 \text{ kgCO}_2/\text{kWh}$ ，电力造成的二氧化碳排放量为 473.26 吨。

第七部分 投融资活动的环境影响

一、整体投融资情况

截止 2021 年末，我司投融资业务中，符合本章节特定统计口径¹投融资活动总额 1472.17 亿元，同比 2020 年末增加 91.49 亿元，增加 6.63%。

❖ 投融资概况及较上一报告期的变动情况

按《国民经济行业分类（GB/T 4754-2017）》中一级行业统计，我司投融资活动所在一级行业基本不变。其中，截止 2020 年末我司投融资活动前三大行业为①建筑业②电力、热力、燃气及水生产和供应业③金融业，金额分别为 348.23 亿元、202.93 亿元、187.23 亿元，占比分别为 25.22%、14.70% 及 13.56%；截止 2021 年末我司投融资活动前三大行业为①建筑业②金融业③电力、热力、燃气及水生产和供应业，金额分别为 363.10 亿元、361.32 亿元、112.79 亿元，占比分别为 24.66%、24.54% 及 7.66%。

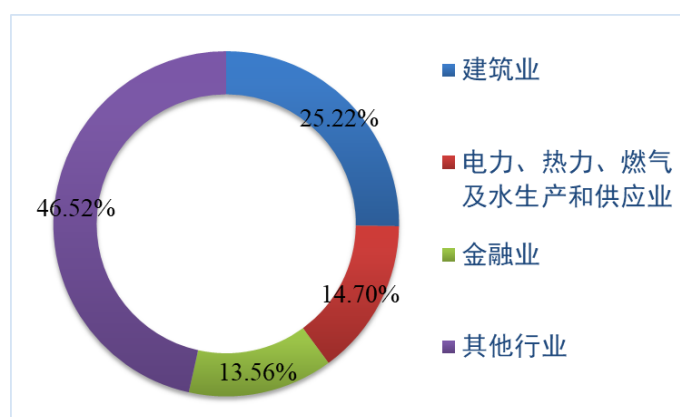


图 6：长城证券符合统计口径投资资产前三大行业（2020 年）²

¹ 包括符合本章节特定统计口径的投融资业务，其中融资业务主要为投行业务条线全年债权融资、股权融资等项目融资总额（不含我司自身融资活动及融资融券业务），投资业务主要为期末自营业务及资产管理业务规模总额。

² 因数据基础，统计对象中融资活动不含 ABS，投资活动中不含自营条线固定收益投资活动。

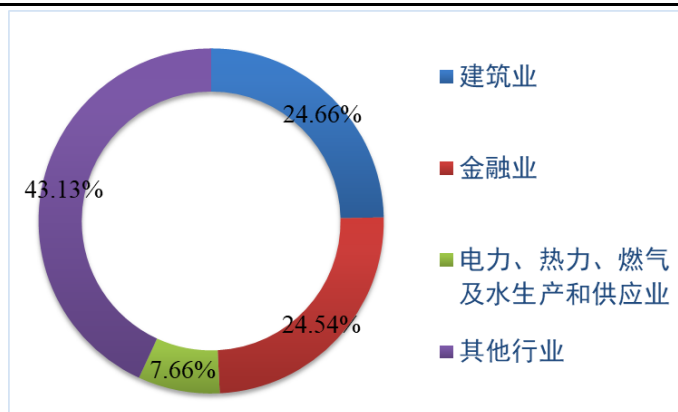


图 7：长城证券符合统计口径投资资产前三大行业（2021 年）

二、绿色投融资活动情况

（一）绿色投融资整体情况

2021 年，我司在 2020 年绿色投融资业务基础上，加大绿色业务创新力度，探索企业绿色融资业务，增加绿色资产投资。绿色融资方面，债权绿色融资及股权绿色融资共计承销 44.52 亿元，同比 2020 年（14.00 亿元）增加 218.00%。绿色投资方面，符合统计口径绿色投资资产 13.55 亿元，同比 2020 年（12.58 亿元）增加 7.68%。

（二）绿色资产管理产品

报告期内，我司将 ESG 投研体系应用于资产管理中，并对外发布了发布 10 只“碳中和”主题指数。

报告期内，我司发布的十只“碳中和”主题指数：

- 长城碳中和（CI014001.WI）
- 长城碳中和沪深 300（CI014002.WI）
- 长城碳中和中小盘（CI014003.WI）
- 长城 ESG 绿色债优选（CI014004.WI）
- 长城 ESG 能源行业优选（CI014005.WI）
- 长城 ESG 沪深 300 优选（CI014006.WI）
- 长城新消费（CI014007.WI）
- 长城先进科技（CI014008.WI）
- 长城高端制造（CI014009.WI）
- 长城金融周期（CI014010.WI）

（三）自有及管理资产投资于绿色金融工具及绿色企业（项目）情况

截止 2021 年末，符合统计口径绿色投资资产中，主要为绿色债权类投资及绿色股权类投资。其中，绿色债权类投资 86,587.21 万元，占全部绿色投资资产 63.90%，同比 2020 年末增加 8,526.23 万元，增幅 10.92%；绿色股权类投资 48,914.00 万元，占全部绿色投资资产 36.10%，同比 2020 年末增加 1,154.95 万元，增幅 2.42%。

表 7：长城证券符合统计口径绿色投资分类统计（2020 年、2021 年）

统计指标	2020 年		2021 年		同比变化	
	金额（万元）	占比（%）	金额（万元）	占比（%）	金额（万元）	同比变化幅度（%）
绿色债权类投资	78,060.99	62.03	86,587.21	63.90	8,526.23	10.92
绿色股权类投资	47,759.05	37.95	48,914.00	36.10	1,154.95	2.42
绿色基金类投资	24.19	0.02	5.63	0.00	-18.56	-76.75
总计	125,844.23	100.00	135,506.84	100.00	9,662.61	7.68

注：1、绿色债权类投资，包括绿色债券、碳中和债券、绿色 ABS；绿色股权类投资指对符合绿色企业主体的股票投资。2、绿色企业主体认定，基于《深圳证券交易所公司债券创新品种业务指引第 1 号——绿色公司债券》（深证上〔2020〕1173 号），结合使用场景，定义绿色企业主体为：同时满足以下 3 个条件：条件 1，某项业务符合国家发改委《绿色产业指导目录（2019）》；条件 2，且该业务符合情形之一：①占营收比超过 50%②占营业收入比未超过 50%，但该业务对应营收和利润对应占比在所有业务中排第一，且相应占比均超过 30%；条件 3，该企业符合所有情形：①近三年无较大、重大和特大级别的环境和生态突发事件发生和生产安全事故，且一般级别的环境和生态突发事件发生和生产安全事故不超过 1 次②近三年警告、罚款种类的环保、安全生产、节约能源行政处罚次数分别不超过 5 次且已按要求改正违法行为，且无其他种类的环保、安全生产、节约能源行政处罚③上一年度未被纳入环保、安监、经信、水利等与资源环境相关监管部门失信黑名单④非落后产能淘汰企业和重点要求整治企业。3、绿色基金类投资，指对符合国家发改委《绿色产业指导目录（2019）》的主题基金进行投资。

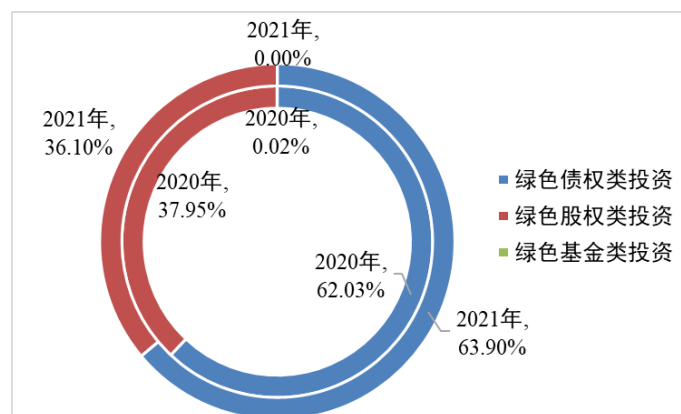


图 8：长城证券符合统计口径绿色投资分类统计（2020 年、2021 年）

（四）其他绿色投融资服务

债权融资方面，2021 年我司承销绿色债券、绿色 ABS，共计 11 只，承销金额 40.77 亿元，同比 20 年末增加 191.21%。11 只绿色债券，截至报告期末违约率为 0。

绿色债券承销案例：

2021 年 2 月 25 日，长城证券作为主承销商参与承销的“中电投融和融资租赁有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行绿色公司债券(第一期)(专项用于碳中和)品种一”及“中电投融和融资租赁有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行绿色公司债券(第一期)(专项用于碳中和)品种二”在上海证券交易所成功发行，本期债券品种一发行利率创最近一年来融资租赁公司同期公司债券最低，品种二为近三年来融资租赁公司首单纯 5 年期公司债券；2021 年 10 月 22 日，长城证券作为主承销商参与承销的“中电投融和融资租赁有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行绿色公司债券(第二期)(专项用于碳中和)”成功发行。

债券募集资金将主要用于具有碳减排效益的且符合《绿色债券支持项目目录》界定的绿色产业领域的融资租赁项目。发行人获得中诚信最高 Ge-1 级的绿色企业等级，债券募投项目具有安全、可靠、无污染，无需消耗燃料，维护简便，建站周期短等优点，大幅减少煤耗及污染物排放，改善环境质量，并在一定程度上改善当地能源供应结构，带动多元产业的可持续发展，助力发行人构筑绿色创新发展新跑道，助力国家“双碳”目标早日实现。

股权融资方面，2021 年我司为企业 IPO 融资、上市企业再融资募集资金项目中，募集资金企业符合绿色企业主体有 1 笔，具体为岭南生态文旅股份有限公司（股票代码：002717）再融资³，融资规模 3.75 亿元，该企业主要从事生态环境和文化旅游业务。

三、绿色投融资活动环境效益

³ 绿色企业主体认定，基于《深圳证券交易所公司债券创新品种业务指引第 1 号——绿色公司债券》（深证上〔2020〕1173 号），结合使用场景，定义绿色企业主体为：同时满足以下 3 个条件：条件 1，某项业务符合国家发改委《绿色产业指导目录（2019）》；条件 2，且该业务符合情形之一：①占营收比超过 50%②占营业收入比未超过 50%，但该业务对应营收和利润对应占比在所有业务中排第一，且相应占比均超过 30%；条件 3，该企业符合所有情形：①近三年无较大、重大和特大级别的环境和生态突发事件发生和生产安全事故，且一般级别的环境和生态突发事件发生和生产安全事故不超过 1 次②近三年警告、罚款种类的环保、安全生产、节约能源行政处罚次数分别不超过 5 次且已按要求改正违法行为，且无其他种类的环保、安全生产、节约能源行政处罚③上一年度未被纳入环保、安监、经信、水利等与资源环境相关监管部门失信黑名单④非落后产能淘汰企业和重点要求整治企业。

截止 2021 年末，我司绿色债权类投融资及绿色股权类投融资具有明显环境效益。其中，投资额按比例折算产生的年环境效益为：节能量 49,461.59 吨标准煤，碳减排量 127,370.04 吨二氧化碳当量，二氧化硫削减量 30.23 吨，氮氧化物削减量 31.52 吨。

表 8：长城证券绿色投融资活动环境效益指标表（2021 年）

指标名称	单位	债权类	股权类	小计
节能量	吨标煤/年	49,461.59	-	49,461.59
碳减排量	吨二氧化碳当量/年	127,265.34	104.70	127,370.04
二氧化硫削减量	吨/年	30.23	-	30.23
氮氧化物削减量	吨/年	31.52	-	31.52

注：1、纳入碳减排核算绿色债权类投融资业务比例 2.53%，纳入碳减排核算绿色股权类投融资业务比例 0.44%。2、化学需氧量削减量、氨氮削减量、节水量、总氮削减量、总磷削减量、颗粒物减排量、挥发性有机物削减量、替代化石能源量、一氧化碳削减量、碳氢化合物削减量、生化需氧量削减量、固体废物处理量、污水处理量、废气处理量、水资源循环利用量、固体废物循环利用量、清淤量、固碳量、释放氧气量、减少/替代化学农药施用量等指标，无数据基础。

❖ 投资对象环境信息披露情况

我司投资资产中，投资对象依据《企业环境信息依法披露管理办法》及《金融机构环境信息披露指南》等文件，按国家及相关部门要求，及时披露环境信息。

四、整体投融资活动碳排放

我司披露 2021 年末投融资活动碳排放量为 909.24 吨二氧化碳当量，对应投资金额为 20.33 百万元，纳入碳核算投融资业务比例为 0.014%，投融资活动碳排放强度为 44.72 吨二氧化碳当量/百万元。

表 9：长城证券投融资活动碳排放数据汇总（2021 年）

指标名称	单位	披露数据
投融资活动碳排放量	吨二氧化碳当量	909.24
纳入碳核算的投融资业务比例	%	0.014
纳入碳核算的投融资金额	百万元	20.33
投融资活动碳排放强度	吨二氧化碳当量/百万元	44.72

注：1、本表仅包含投资活动产生碳排放量，不包含融资活动产生碳排放量。2、本表投资活动碳排放计算主要来自股权类投资，对应测算方法为非项目类投资。

五、投融资环境影响的测算方法与表达

我司依据《金融机构碳核算技术指南》分析环境风险投融资影响，并参考监管部门《绿色信贷项目节能减排量测算指引》、《工业企业温室气体排放核算和报告通则》（GB/T 32150）、《节能量测量和验证技术通则》（GB/T 28750）、《节能量测量和验证实施指南》（GB/T 32045）、《基于项目的温室气体减排量评估技术规范 通用要求》（GB/T 33760）等标准规范要求，对投资银行、自营、资产管理三个业务条线相关投融资活动对环境影响测算分析。

❖ 非项目类投资碳环境影响测算与表达

表 10：投融资碳排放量测算方法学（非项目类投资）

变量说明	$E_{\text{非项目业务}} = E_{\text{非项目}} \times \left(\frac{V_{\text{投资}}}{V_{\text{企业价值}}} \right)$
$E_{\text{非项目业务}}$	报告期内，非项目投资业务对应的碳排放量，单位为吨二氧化碳当量（tCO _{2e} ）；
$E_{\text{非项目}}$	报告期内，非项目投资业务相关被投资主体的碳排放量，单位为吨二氧化碳当量（tCO _{2e} ）；
$V_{\text{投资}}$	报告期内，金融机构对被投资主体的月均非项目投资额，单位为万元；
$V_{\text{企业价值}}$	报告期内，被投资主体的企业价值（基于年末收盘价总市值+年末负债账面价值），单位为万元。
$\text{当 } V_{\text{投资}} > V_{\text{企业价值}} \text{ 时, } \left(\frac{V_{\text{投资}}}{V_{\text{企业价值}}} \right) = 1$	

注：1、本表企业价值，参照中国人民银行《金融机构碳核算技术指南》及碳核算金融联盟（Partnership for Carbon Accounting Financials, PCAF）关于上市企业股权及债券碳排放核算方法及含现金企业价值法（Enterprise Value Including Cash, EVIC）。

2021 年末，我司投资 A 上市企业股票，月末投资余额平均值为 959 万元，经测算主体碳排放为 157.2 万吨二氧化碳当量，年末 A 企业的企业价值为

216.57 亿元，因此我司投资对应碳排放量为 696.10 吨二氧化碳当量。

第八部分 绿色金融培训及公益活动

一、绿色金融培训

❖ 长城证券线上投资者教育基地（<http://edu.cgws.com/>）

长城证券“十四五”战略规划秉持“安全”“领先”战略指导思想，守住不发生重大风险和坚持合规经营底线。以安全保领先，以安全促领先。长城证券的“安全”与“领先”离不开扎实的投资者教育保驾护航。长城证券高度重视投资者教育工作，坚持以健全投资者教育长效机制为主线，以服务广大投资者为重点，把投资者权益保护工作作为公司履行社会责任的有效形式。

在投教内容丰富程度上，本系统目前有 8 个一级模块，共计 27 个三级子模块，覆盖专业的产品展示（金博士学堂）、专家讲堂（金博士视频课）、模拟体验（A 股、期权、港股通）、互动沟通（问卷调查、意见征集、投诉与建议）、风险防范、政策法规等基本功能区域，也设置了具有我司特色的长城投教风采展示和绿色金融功能区。



图 9：长城证券绿色金融主题线上培训教育基地

二、公益活动

❖ 开展公益植树，增加森林碳汇

为推动绿色低碳生活历年，主动参与“碳中和，碳达峰”建设，我司在深圳市南山区松坪山公园举办了公益植树活动，进一步营造了全公司“植绿、护绿、爱绿”的浓厚氛围。



图 10：长城证券开展公益植树活动

植树催浓夏意，播绿造福众人。《中共中央国务院关于完整准确全面贯彻新发展理念做好碳达峰碳中和工作的意见》指出，实现“双碳”目标需要巩固生态系统碳汇能力，提升生态系统碳汇增量。通过植树造林，推进森林固碳，公益植树活动不仅让长城子弟将手中的树苗植入大地，更将“坚决落实绿色发展，积极推动碳汇交易”的意识植入了心中。

❖ 响应低碳号召，开展跑步运动

为响应“低碳生活”号召，推广绿色理念，我司在深圳湾公园举办 2021 年长城证券筑梦追风迎新跑活动。通过本次跑步活动，员工锻炼了体能和坚韧，不断磨砺长城人积极向上、勇往直前的精、气、神，同时以身体力行实践低碳生活、绿色发展理念。



图 11：长城证券响应“低碳生活”号召，组织长跑活动

第九部分 绿色金融创新案例及成果奖项

一、绿色金融、环境风险分析相关研究成果

2021 年 5 月 19 日，长城证券碳中和系列指数发布会在深圳举行。公司以能源央企控股券商的独特视角，深度解读碳达峰、碳中和目标对能源未来发展和产业结构调整的影响，构建系统性、多角度、多层次追踪碳中和目标执行的碳中和指数体系，发布长城碳中和（CI014001.WI）、长城碳中和沪深 300（CI014002.WI）、长城碳中和中小盘（CI014003.WI）、长城 ESG 绿色债优选（CI014004.WI）、长城 ESG 能源行业优选（CI014005.WI）、长城 ESG 沪深 300 优选（CI014006.WI）、长城新消费（CI014007.WI）、长城先进科技（CI014008.WI）、长城高端制造（CI014009.WI）及长城金融周期（CI014010.WI）10 只指数。



图 12：长城证券碳中和指数发布

结合长城证券碳中和系列指数发布，长城证券同步上线长城 ESG（环境、社会和治理）投研体系。长城碳中和系列指数的设计融入了长城证券对行业的思考，重点关注碳中和目标在调整能源和产业结构、促进制造业全面升级、引领 ESG 投资消费新理念等方面的作用，跟踪全局性、趋势性、成长性变化，纳入能源电力企业、能源供应链、装备制造产业链、绿色债券、金融周期和新消费等与碳中和目标紧密相关主题板块，筛选优质公司，反映碳中和趋势。

二、绿色金融奖项

2021年，我司在社会责任、绿色金融等领域取得成绩，荣获“第十一届‘金鼎奖’2021年度最具社会责任感券商”、“2021‘金桥奖’年度杰出社会责任企业”等荣誉称号。

第十部分 数据梳理、校验及保护

一、数据梳理、校验及保护

在管理制度层面，为规范长城证券股份有限公司的数据质量管理工作，提升公司数据质量，满足业务运营、风险控制、领导决策以及外部监管要求，我司发布了《长城证券数据质量管理办法》，该办法包含数据质量问题管理、数据质量规则管理、监督与考核机制等内容。在日常工作中，针对基础数据及指标数据数据质量，我司建立了全流程监控机制。通过合规管理、建立勾稽关系、同比阈值监控等手段，做好基础数据、指标数据等数据质量保证及质量控制。

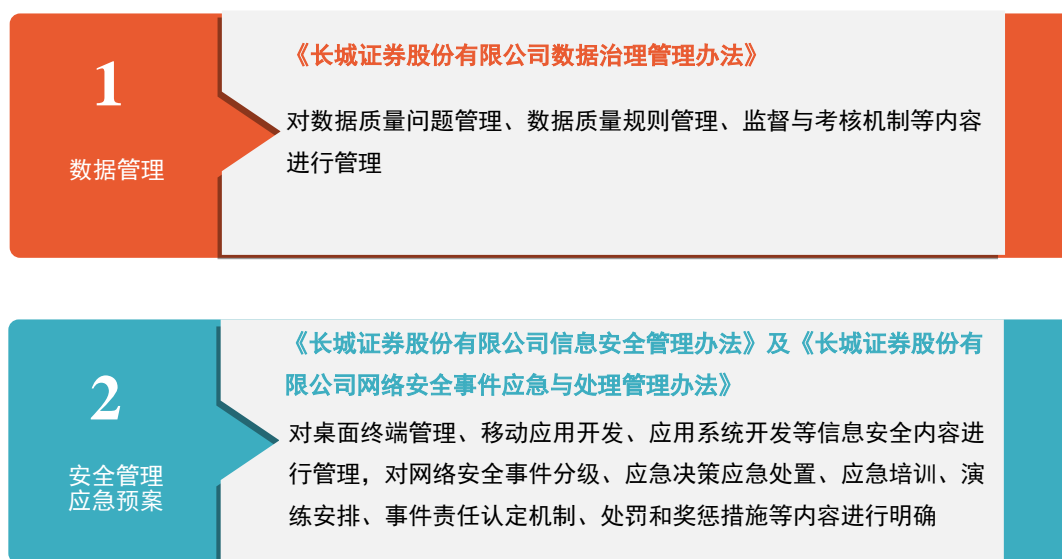


图 13: 长城证券数据管理、安全管理、应急预案相关制度

二、数据安全应急预案

为保障公司业务的正常稳定运行，保护公司信息资产安全，积极预防安全事件的发生，最小化安全事件影响，我司依据《中华人民共和国网络安全法》、《证券期货业信息安全保障管理办法》、《证券期货业网络安全等级保护基本要求》等文件要求，制定了《长城证券股份有限公司信息安全管理办

法》，为提高公司信息系统竞争力，开展公司信息安全管理工作提供指导与支持。

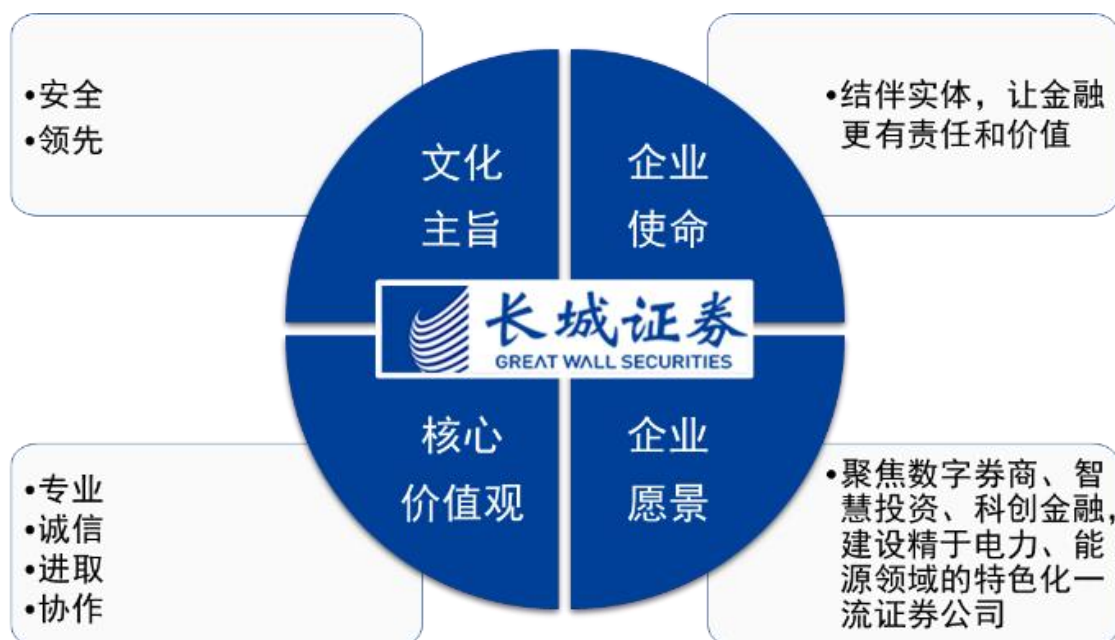
在数据安全应急管理方面，我司依据《证券期货业信息安全保障管理办法》、《证券期货业网络安全事件报告与调查处理办法》等文件要求，制定了《长城证券股份有限公司网络安全事件应急与处理管理办法》，对网络安全事件分级、应急决策应急处置、应急培训、演练安排、事件责任认定机制、处罚和奖惩措施等内容进行明确，减少网络安全事件的发生，减轻或消除事件的危害及影响，规范网络安全事件管理流程的基本制度，保障公司信息化系统安全和平稳运行，促进信息技术工作健康发展。


附录 1：金融机构环境信息披露指南索引目录


指标内容	对应披露内容索引
1.概况	1-3
环境相关目标愿景、战略规划，及政策行动	1-3
环境相关成果和绩效	2
2.环境相关治理结构	4
董事会层面	4
高管层面	4
业务部门层面	4
3.环境相关政策制度	5-7
制定内部环境相关管理制度	5-6
贯彻国家及地区环境相关政策要求	6
遵守采纳气候环境相关国际公约框架倡议	6-7
4.环境相关产品与服务创新	30
5.环境风险管理及流程	8-9
环境风险识别和评估流程	8
环境风险管理和控制流程	9
6.环境因素的影响	10-12
气候环境风险对经济和金融体系的影响机理	10-11
环境风险识别与应对、机遇与挑战	11-12
环境风险量化分析	-
7.投融资活动的环境影响	20-26
投融资及其环境影响	20-25
投融资环境影响的量化测算	20-25
投融资环境影响的测算方法学与表达	25-26
8.经营活动的环境影响	13-19,27-29
经营活动产生的直接温室气体排放和直接自然资源消耗	13-16
采购产品或服务产生的间接温室气体排放和间接自然资源消耗	13-16
采取环保措施产生的环境效益	16-19,27-29
经营活动环境影响的统计口径和测算方法学	17-19
9.数据梳理、校验及保护	32-33
定期数据梳理和校验	32
保证数据安全和数据主体权益	32
建立数据安全事件（事故）应急处理预案	32-33
10.绿色金融创新及研究成果	30-31

附录 2：气候相关财务信息披露工作组（TCFD）建议内容索引

指标内容	对应披露内容索引
1.治理	4
描述董事会对气候相关风险和机遇监控情况	4
描述管理层在评估和管理气候相关风险和机遇方面职责	4
2.战略	10-11
说明组织已经识别长中短期气候相关风险与机会	10
说明气候相关风险与机会对组织业务、战略和财务规划影响	11
说明组织战略韧性，应将 2°C 以下气温升幅控制目标等气候相关情景纳入考虑之中	-
3. 风险管理	8-9
描述组织机构识别和评估气候相关风险流程	8
描述组织机构管理气候相关风险流程	8
描述识别、评估和管理气候相关风险流程如何与组织机构整体风险管理相融合	9
4. 指标及目标	2, 10-11, 13-16
披露组织按照其战略和风险管理流程评估气候相关风险和机会时使用指标	10-11
披露直接排放（范围 1）和能间接排放（范围 2）及其他间接排放（范围 3）（如适用）温室气体相关信息及相关风险	13-16
描述组织用于管理气候相关风险和机会目标以及目标完成程度	2



 0755-83516072

 广东省深圳市福田区金田路 2026 号能源大厦南塔楼 10-19 层

 <http://www.cgws.com>