

PRI 报告框架

组织概况

2023 年

最后修订：2023 年 1 月 18 日

目录

组织信息

| | |
|-------------------------------|----|
| 组织信息 | 7 |
| 报告年度[OO1] | 7 |
| OO 1 | 7 |
| 子公司信息[OO 2、OO 2.1、OO 2.2] | 8 |
| OO 2 | 8 |
| OO 2.1 | 10 |
| OO 2.2 | 12 |
| 资产管理规模 | 14 |
| 所有资产类别[OO3、OO4] | 14 |
| OO 3 | 14 |
| OO 4 | 15 |
| 资产明细分类[OO5] | 17 |
| OO 5 | 17 |
| 资产明细分类：外部管理的资产[OO 5.1、OO 5.2] | 21 |
| OO 5.1 | 21 |
| OO 5.2 | 23 |
| 资产明细分类：内部管理的上市股权[OO5.3LE] | 25 |

| | |
|----------------------------------|----|
| OO 5.3 LE | 25 |
| 资产明细分类：内部管理的固定收益[OO 5.3 FI] | 27 |
| OO 5.3 FI | 27 |
| 资产明细分类：内部管理的私募股权[OO 5.3 PE] | 29 |
| OO 5.3 PE | 29 |
| 资产明细分类：内部管理的房地产[OO5.3 RE] | 31 |
| OO 5.3 RE | 31 |
| 资产明细分类：内部管理的基础设施[OO 5.3 INF] | 34 |
| OO 5.3 INF | 34 |
| 资产明细分类：内部管理的对冲基金[OO 5.3 HF] | 37 |
| OO 5.3 HF | 37 |
| 由 PRI 签署方管理的外部管理资产[OO6] | 39 |
| OO 6 | 39 |
| 地域明细分类[OO7] | 40 |
| OO 7 | 40 |
| 尽责管理 | 43 |
| 尽责管理[OO8] | 43 |
| OO 8 | 43 |
| 尽责管理：（代理）投票[OO 9 HF、OO 9、OO 9.1] | 46 |
| OO 9 HF | 46 |
| OO 9 | 47 |

| | |
|---------------------------|-----------|
| OO 9.1 | 49 |
| 未开展尽责管理[OO10] | 51 |
| OO 10 | 51 |
| 纳入 ESG 因素 | 54 |
| 内部管理的资产[OO11] | 54 |
| OO 11 | 54 |
| 外部管理人遴选[OO 12] | 57 |
| OO 12 | 57 |
| 外部管理人委任[OO13] | 59 |
| OO 13 | 59 |
| 外部管理人监督[OO14] | 61 |
| OO 14 | 61 |
| 其他资产类别中的 ESG 因素[OO15] | 63 |
| OO 15 | 63 |
| 未纳入 ESG 因素[OO16] | 65 |
| OO 16 | 65 |
| ESG 策略 | 69 |
| 上市股权[OO 17 LE、OO 17.1 LE] | 69 |
| OO 17 LE | 69 |
| OO 17.1 LE | 71 |

| | |
|------------------------------|-----------|
| 固定收益[OO 17 FI、OO 17.1 FI] | 73 |
| OO 17 FI | 73 |
| OO 17.1 FI | 75 |
| ESG/可持续发展基金和产品 | 77 |
| 贴标和营销[OO 18、OO 18.1、OO 18.2] | 77 |
| OO 18 | 77 |
| OO 18.1 | 79 |
| OO 18.2 | 81 |
| 被动投资[OO 19] | 85 |
| OO 19 | 85 |
| 主题债券[OO 20] | 87 |
| OO 20 | 87 |
| 报告要求摘要 | 90 |
| 报告要求摘要[OO 21] | 90 |
| OO 21 | 90 |
| 其他资产明细分类 | 95 |
| 私募股权：板块[OO 22] | 95 |
| OO 22 | 95 |
| 私募股权：所有权比例[OO 23] | 97 |
| OO 23 | 97 |

| | |
|---------------------|-----|
| 房地产：建筑类型[OO 24] | 99 |
| OO 24 | 99 |
| 房地产：所有权比例[OO 25] | 100 |
| OO 25 | 100 |
| 房地产：管理类型[OO 26] | 102 |
| OO 26 | 102 |
| 基础设施：所有权比例[OO 27] | 104 |
| OO 27 | 104 |
| 基础设施：策略[OO 28] | 106 |
| OO 28 | 106 |
| 基础设施：资产类别[OO 29] | 108 |
| OO 29 | 108 |
| 基础设施：管理类型[OO 30] | 109 |
| OO 30 | 109 |
| 提交信息 | 111 |
| 报告披露信息[OO 31、OO 32] | 111 |
| OO 31 | 111 |
| OO 32 | 112 |

组织信息

报告年度[001]

| 指标 ID | 基于: | 不适用 | 分节 | PRI 原则 | 指标类型 |
|-------------------------------------|-----|-----|------|--------|------|
| 00 1 | 指向: | 不适用 | 报告年度 | 通用 | 核心 |
| 贵机构针对 PRI 报告所选择的 12 个月报告期间的年终日是哪一天? | | | | | |
| [日期字段] | | | | | |

| 解释性说明 | |
|--------|---|
| 指标的目的 | 报告年度指报告机构所选择的 12 个月期间。报告年度可以是标准财务报告年度，也可以是为 PRI 报告框架中的报告目的而选择的专门区间。 |
| 补充报告指引 | 签署方应确保其选择的 12 个月报告期间的年终日在各报告年度是一致的。 |
| 逻辑 | |
| 基于 | 不适用 |
| 指向 | 不适用 |
| 评估 | |
| 评估标准 | 不纳入评估 |

子公司信息[OO 2、OO 2.1、OO 2.2]

| 指标 ID | 基于: | 不适用 | 分节 | PRI 原则 | 指标类型 |
|--|-----|--------|-------|--------|------|
| OO 2 | 指向: | OO 2.1 | 子公司信息 | 通用 | 核心 |
| 贵机构是否有子公司？ | | | | | |
| <input type="radio"/> (A) 是 <input type="radio"/> (B) 否 | | | | | |

解释性说明

| | |
|--------|--|
| 指标的目的 | <p>在适用于集团的情况下，PRI 的签署方签署指引要求签署组织的所有经营主体（包括子公司）同时签署加入，以确保签署方报告所有资产管理规模 (AUM) 的情况。</p> <p>然而，组织仍可决定是否通过以下方式满足这一要求：(i) 将整个集团作为一家签署方统一加入；或 (ii) 同时将所有子公司单独作为多家签署方申请加入。前一种情况下，签署方应合并报告所有 AUM。后一种情况下，每个子公司将独立向 PRI 报告，且可从签署方的报告中排除。本指标的目的是确定签署方的哪些子公司被纳入或排除于（签署方的）报告。</p> <p>例外情形：集团跨越多个签署方类别 签署方不得跨类别申请，如果集团包含属于不同签署方类别[即资产所有者 (AO)、投资管理人 (IM) 和/或服务商 (SP)] 的子公司，则须分别在各类别下完成相关经营主体的签署工作；后者必须根据其分类提交单独报告。</p> |
| 补充报告指引 | <p>如果签署方将整个集团作为一家签署方统一加入，则应报告作为 PRI 签署方之实体（包括母公司拥有 50% 以上股权的任何子公司）的合并 AUM。如果母公司拥有子公司的多数股权，则该等子公司的所有 AUM 应包括在母公司报告的 AUM 总额数据中。</p> <p>如果签署方的子公司作为多家签署方分别签署加入，则均应报告各自的 AUM 总额，包括代表其母公司和其他客户管理的任何资金。在这种情况下，母公司仍可报告其合并 AUM（并在合并报告中说明子公司的活动）。然而，母公司也可选择将子公司管理的资金从 AUM 总额数据[OO4]中剔除，进而排除于报告的所有活动之外。</p> <p>例外情形：集团跨越多个签署方类别 如果资产所有者持有投资管理人的多数股权，则应剔除投资管理人子公司代表第三方管理的资金。这种做法的目的是使资产所有者仅报告代表自身受益人所管理的资金。</p> |

| | |
|-----------|--|
| 其他资源 | 关于 PRI 签署方资格及分类评估标准和流程的进一步解释，请参见 PRI 签署方签署指引 。 |
| 逻辑 | |
| 基于 | 不适用 |
| 指向 | [OO 2.1] |
| 评估 | |
| 评估标准 | 不纳入评估 |

| 指标 ID | 基于: | OO 2 | 分节 | PRI 原则 | 指标类型 |
|--------|-----|--------|-------|--------|------|
| OO 2.1 | 指向: | OO 2.2 | 子公司信息 | 通用 | 核心 |

贵机构的任何子公司是否本身即是 PRI 签署方？

- (A) 是
- (B) 否

解释性说明

| | |
|--------|---|
| 指标的目的 | <p>在适用于集团的情况下，PRI 的签署方签署指引要求：签署组织的所有经营主体（包括子公司）同时签署加入，以确保签署方报告所有资产管理规模 (AUM) 的情况。</p> <p>然而，组织仍可决定是否通过以下方式满足这一要求：(i) 将整个集团作为一家签署方统一加入；或 (ii) 同时将所有子公司单独作为多家签署方申请加入。前一种情况下，签署方应合并报告所有 AUM。后一种情况下，每个子公司将独立向 PRI 报告，且可从签署方的报告中排除。本指标的目的是确定签署方的哪些子公司被纳入或排除于（签署方的）报告。</p> <p>例外情形：集团跨越多个签署方类别</p> <p>签署方不得跨类别申请，如果集团包含属于不同签署方类别[即资产所有者 (AO)、投资管理人 (IM) 和/或服务商 (SP)]的子公司，则须分别在各类别下完成相关经营主体的签署工作；后者必须根据其分类提交单独报告。</p> |
| 补充报告指引 | <p>如果签署方将整个集团作为一家签署方统一加入，则应报告作为 PRI 签署方之实体（包括母公司拥有 50% 以上股权的任何子公司）的合并 AUM。如果母公司拥有子公司的多数股权，则该等子公司的所有 AUM 应包括在母公司报告的 AUM 总额数据中。</p> <p>如果签署方的子公司作为多家签署方分别签署加入，则均应报告各自的 AUM 总额，包括代表其母公司和其他客户管理的任何资金。在这种情况下，母公司仍可报告其合并 AUM（并在合并报告中说明子公司的活动）。然而，母公司也可选择将子公司管理的资金从 AUM 总额数据[OO4]中剔除，进而排除于报告的所有活动之外。</p> <p>例外情形：集团跨越多个签署方类别</p> <p>如果资产所有者持有投资管理人的多数股权，则应剔除投资管理人子公司代表第三方管理的资金。这种做法的目的是使资产所有者仅报告代表自身受益人所管理的资金。</p> |
| 其他资源 | <p>关于 PRI 签署方资格及分类评估标准和流程的进一步解释，请参见 PRI 签署方签署指引。</p> |

| | |
|------|---------|
| 逻辑 | |
| 基于 | [OO 2] |
| 指向 | [OO2.2] |
| 评估 | |
| 评估标准 | 不纳入评估 |

| | | | | | |
|------------------------|-----|---------------|-------------|--------------|------------|
| 指标 ID OO 2.2 | 基于: | OO 2.1 | 分节 子公司信息 | PRI 原则 通用 | 指标类型 核心 |
| | 指向: | 不适用 | | | |

请列出贵机构中本身即是 **PRI** 签署方的任何子公司，并说明是否将在本报告中报告所列子公司的负责任投资活动。

| | (1) 是，该子公司的负责任投资活动将包括在本报告中 | (2) 否，该子公司的负责任投资活动将包括在其单独报告中 |
|----------------------------|----------------------------|------------------------------|
| (A) 签署方名称: _____ [自由文本: 小] | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> |
| (B) 签署方名称: _____ [自由文本: 小] | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> |
| (C) 签署方名称: _____ [自由文本: 小] | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> |
| (D) 签署方名称: _____ [自由文本: 小] | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> |
| (E) 签署方名称: _____ [自由文本: 小] | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> |
| (F) 签署方名称: _____ [自由文本: 小] | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> |
| (G) 签署方名称: _____ [自由文本: 小] | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> |

| 解释性说明 | |
|--------|---|
| 指标的目的 | <p>在适用于集团的情况下，PRI 的签署方签署指引要求：签署组织的所有经营主体（包括子公司）同时签署加入，以确保签署方报告所有资产管理规模 (AUM) 的情况。</p> <p>然而，组织仍可决定是否通过以下方式满足这一要求：(i) 将整个集团作为一家签署方统一加入；或 (ii) 同时将所有子公司单独作为多家签署方申请加入。前一种情况下，签署方应合并报告所有 AUM。后一种情况下，每个子公司将独立向 PRI 报告，且可从签署方的报告中排除。本指标的目的是确定签署方的哪些子公司被纳入或排除于（签署方的）报告。</p> <p>例外情形：集团跨越多个签署方类别</p> <p>签署方不得跨类别申请，如果集团包含属于不同签署方类别[即资产所有者 (AO)、投资管理人 (IM) 和/或服务商 (SP)]的子公司，则须分别在各类别下完成相关经营主体的签署工作；后者必须根据其分类提交单独报告。</p> |
| 补充报告指引 | <p>如果签署方将整个集团作为一家签署方统一加入，则应报告作为 PRI 签署方之实体（包括母公司拥有 50% 以上股权的任何子公司）的合并 AUM。如果母公司拥有子公司的多数股权，则该等子公司的所有 AUM 应包括在母公司报告的 AUM 总额数据中。</p> <p>如果签署方的子公司作为多家签署方分别签署加入，则均应报告各自的 AUM 总额，包括代表其母公司和其他客户管理的任何资金。在这种情况下，母公司仍可报告其合并 AUM（并在合并报告中说明子公司的活动）。然而，母公司也可选择将子公司管理的资金从 AUM 总额数据[OO4]中剔除，进而排除于报告的所有活动之外。</p> <p>例外情形：集团跨越多个签署方类别</p> <p>如果资产所有者持有投资管理人的多数股权，则应剔除投资管理人子公司代表第三方管理的资金。这种做法的目的是使资产所有者仅报告代表自身受益人所管理的资金。</p> |
| 其他资源 | 关于 PRI 签署方资格及分类评估标准和流程的进一步解释，请参见 PRI 签署方签署指引 。 |
| 逻辑 | |
| 基于 | [OO 2.1] |
| 指向 | 不适用 |
| 评估 | |
| 评估标准 | 不纳入评估 |

资产管理规模

所有资产类别[003、004]

| 指标 ID | 基于: | 临时签署方 | 分节 | PRI 原则 | 指标类型 |
|-------|-----|--------------|--------|--------|------|
| 003 | 指向: | 004、005、0032 | 所有资产类别 | 通用 | 核心 |

在报告年度，贵机构是否完全处于募资过程中而无法报告资产管理规模 (AUM) 数据？

- (A) 是，我们（在报告年度）处于募资过程中而无法报告 AUM 数据
请说明募资活动的结束日期：_____ [必填日期字段]
- (B) 否，我们（在报告年度）完成了募资，可以报告 AUM 数据

解释性说明

| | |
|--------|--|
| 指标的目的 | 如果签署方处于募资过程中（即 AUM 100%由未缴承诺资金组成）而无法提供 AUM 数据，可在本指标中说明这一点。 |
| 补充报告指引 | 如果签署方仍在募资过程中且尚未管理资产，应在本指标中说明这一点，并报告本模块（组织概况）、政策、治理和战略 (PGS) 模块和建立信心措施模块。 |

逻辑

| | |
|----|--------------------|
| 基于 | 临时签署方 |
| 指向 | [004]、[005]、[0032] |

评估

| | |
|------|-------|
| 评估标准 | 不纳入评估 |
|------|-------|

| 指标 ID | 基于: | OO 3 | 分节 | PRI 原则 | 指标类型 |
|-------|-----|------|--------|--------|------|
| OO 4 | 指向: | 不适用 | 所有资产类别 | 通用 | 核心 |

在[OO 1]所述的报告年度末，贵机构的总资产管理规模 (AUM)是？

请提供美元金额。可于[国际货币基金组织网站](#)上查询本币对美元的汇率。

(A) 贵机构的 AUM，包括子公司的 AUM，不包括仅接受执行、咨询、托管或研究咨询服务的 AUM

(B) 本身是 PRI 签署方并排除于本报告的子公司的 AUM，如[OO2.2]所述

(C) 仅接受执行、咨询、托管或研究咨询服务的 AUM

关于所用汇率的补充信息：_____ [选填自由文本：小]

解释性说明

| | |
|--------|--|
| 指标的目的 | <p>PRI 要求：签署方在加入时以及根据 PRI 报告框架完成报告的每一年度提供 AUM 数据。</p> <p>PRI 以下多种方式使用此信息：</p> <ul style="list-style-type: none"> (i) 为签署方确定适当的费用等级， (ii) 计算 PRI 签署方的 AUM 总额， (iii) 为评估签署方建立同行小组，以及 (iv) 用于签署方细分活动，包括计算资产类别配置的规模。 |
| 补充报告指引 | <p>报告的数据应反映签署方在报告年度末的 AUM 总额，包括未缴承诺资金（例如在私募股权或基础设施中）和保单持有人的资金、资产负债表外资产以及在合资企业 (JV) 资产中的份额（如相关）。AUM 的数据应参照报告年度末的市场价值。如果无法获得市场价值，我们建议签署方报告这些资产的最新可变现净值（估算）。</p> |

| | |
|-------------|--|
| | <p>签署方须报告与在 OO4 (A)行所提供的 AUM 价值相关的负责任投资做法。因此，在整个报告框架中报告的资产明细分类和活动应仅根据 (A) 行计算，不包括 [OO4] (B) 行和 (C) 行的 AUM。</p> <p>签署方可于 国际货币基金组织网站 查询本币对美元的汇率。汇率应参照 [OO 1] 中所述报告年度末的汇率。</p> <p>子公司</p> <p>如签署方的子公司同时也是 PRI 签署方，签署方的答复应与上述指标[OO 2-OO 2.2]中的内容一致，即说明其是否将报告这些子公司的活动。</p> <p>(i) 选择报告部分或所有子公司活动的签署方，应在 [OO4] 的选项 A 中报告这些子公司的 AUM。</p> <p>(ii) 选择不报告部分或所有子公司活动的签署方，应在 [OO4] 的选项 B 中报告这些子公司的 AUM。</p> <p>接受执行、咨询、托管或研究咨询服务的管理资产</p> <p>在选项 C 中，“仅接受执行、咨询、托管或研究咨询服务”指以下服务：</p> <p>执行和/或咨询服务为客户提供持股和基金平台以进行投资。签署方可能会或不会为客户提供建议，但最终均由客户作出投资决策。</p> <p>(1) 咨询服务为客户提供投资建议，由客户作出决定（或接受建议）。</p> <p>(2) 执行服务为客户提供投资平台，但不为客户提供建议。</p> <p>上述 (1)、(2) 类包括基于执行或咨询的投资平台和/或第三方基金超市。</p> <p>(3) 托管服务通常包括客户证券和现金的结算、保管和报告。</p> <p>零售或私人银行通常提供此类服务。一些投资管理公司也提供这些服务。</p> |
| 逻辑 | |
| 基于 | [OO 3] |
| 指向 | 不适用 |
| 评估 | |
| 评估标准 | 不纳入评估 |

资产明细分类[005]

| 指标 ID 00 5 | 基于: | 00 3 | 分节 资产明细分类 | PRI 原则 通用 | 指标类型 核心 |
|--------------------------------------|---------------|------|---------------|--------------|------------|
| | 指向: | 多个指标 | | | |
| 请提供在[00 1]中所述的报告年度末贵机构 AUM 总额的百分比明细。 | | | | | |
| | 占 AUM 百分比: | | | | |
| | (1) 内部管理的 AUM | | (2) 外部管理的 AUM | | |
| (A) 上市股权 | _____ % | | _____ % | | |
| (B) 固定收益 | _____ % | | _____ % | | |
| (C) 私募股权 | _____ % | | _____ % | | |
| (D) 房地产 | _____ % | | _____ % | | |
| (E) 基础设施 | _____ % | | _____ % | | |
| (F) 对冲基金 | _____ % | | _____ % | | |
| (G) 林业 | _____ % | | _____ % | | |

| | | |
|--------------|---------------------------------|---------------------------------|
| (H) 耕地 | _____ % | _____ % |
| (I) 其他 | _____ % 请说明：_____ [必填自由文本：小] | _____ % 请说明：_____ [必填自由文本：小] |
| (J) 资产负债表外资产 | _____ % 请说明：_____ [必填自由文本：小] | _____ % 请说明：_____ [必填自由文本：小] |
| 总计 | 100% | |

解释性说明

| | |
|--------|---|
| 指标的目的 | 本指标用于关口指向(gateway)和对标(peering)目的，并为签署方的后续答复提供背景信息。签署方在该指标中的答复，结合“组织概况”模块中的其他指标（如 OO 4、OO 5.1、OO 5.3 LE），将决定签署方在报告框架的后续阶段需要完成哪些模块、章节和指标。 |
| 补充报告指引 | <p>内部和外部管理的资产</p> <p>“内部管理的资产”指由签署方内部作出证券、资产或金融工具层面投资决策的资产。这应当包括签署方的合并和全资子公司。如签署方开展内部研究以支持投资决策和/或向二级顾问提供合格（或不合格）证券、资产或金融工具，应将其资产列为“内部管理”。</p> <p>“外部管理的资产”指由外部投资管理人或类似第三方代表组织作出证券、资产或金融工具层面投资决策的资产。在此等情况下，母基金（FOF）管理人应将其资产报告为“外部管理”。</p> <p>若投资管理人主要在内部开展投资研究并向二级顾问提供合格证券（或不合格证券），应将其资产列为“内部管理”。如果标的资产的投资决策（如买入/卖出/持有）由第三方作出，母基金（包括对冲基金组成的基金）和管理人之管理人（MOM）应将其资产列为“外部管理”。</p> <p>固定收益和私募债</p> <p>就 PRI 报告框架而言，私募债应在固定收益项下报告。请参见《私募债的负责任投资聚焦》，了解私募债策略列表。</p> <p>对房地产投资信托基金（REITs）的处理</p> <p>如果基金管理人投资于一系列上市资产，并且基金持有 REITs 份额，则基金管理人应在相关 LE 策略项（主动基本面、主动量化或被动）下报告。</p> |

如果基金管理人管理一个（或多个）REITs 作为直接房地产投资，可决定 REITs 内的房地产哪些可以买入和卖出并且可能对这些资产进行管理，则基金管理人应在房地产模块下报告。

私募股权、房地产和基础设施

基础设施和房地产被视为单独报告类别，因为这些领域的投资特点不同。如果可能，对基础设施和房地产的非上市股权投资应在这些类别（而非私募股权）下报告。

有限合伙投资基金的次级权益应列为“外部管理”。

对冲基金

通过对冲基金结构对非上市或上市公司的投资应仅作为对冲基金报告，以避免重复计算（例如，在对冲基金结构中持有的上市股权不应在上市股权项下报告）。

现金和货币市场工具

现金、现金等价物和/或叠加组合(overlay)及货币市场资产应报告为“其他”。如果这些资产是资产负债表外的，则应报告为“资产负债表外资产”。

其他

该类别包括不符合上述任何类别的资产。贸易融资应在“其他”项下报告。

签署方应与各资产类别相关的衍生证券报告为“其他”，而非在资产类别项下报告。衍生品包括期货（如商品期货、货币期货、股息期货）、远期、掉期（如利率、货币、指数收益、固定期限掉期、总收益掉期）、奇异衍生品（如通货膨胀衍生品、天气衍生品、信用挂钩票据、信用衍生品、股权挂钩票据）、利率衍生品（如上限、下限、掉期期权、利率互换）、股权衍生品（如期权、权证、可转换债券、单一上市股权期货）等。

资产负债表外资产

任何资产负债表外资产都应列入此类，如现金、现金等价物和/或叠加组合及货币市场资产。

已承诺资金

理想情况下，签署方的资产类别组合应包括所有未缴承诺资金和已承诺资金（例如在私募股权或基础设施中）。但如果签署方对这些资产的分类有所不同（例如，只能提供对已投资本的明细分类），则应根据相应的分类来报告。如果 AUM 完全由未缴承诺资金组成（即签署方仍处于募资阶段），签署方应在 [OO3]中说明这一点。

逻辑

基于

[OO 3]

指向

OO 模块逻辑: [OO 5.1]、[OO 5.2]、[OO 5.3 LE]、[OO 5.3 FI]、[OO 5.3 PE]、[OO 5.3 RE]、[OO 5.3 INF]、[OO 5.3 HF]、[OO 6]、[OO 7]、[OO 8]、[OO 9 HF]、[OO 11]、[OO 12]、[OO 13]、[OO 14]、[OO 21]

| | |
|------|---|
| | <p>PGS 模块逻辑: [PGS 25]</p> <p>SO 模块逻辑: [SO 10]</p> |
| 评估 | |
| 评估标准 | 不纳入评估 |

资产明细分类：外部管理的资产[OO 5.1、OO 5.2]

| 指标 ID OO 5.1 | 基于： | OO 5 | 分节 | | | PRI 原则 | 指标类型 | |
|--------------------------------------|-------------|----------------------------|----------------|----------------|--------------|--------|------|--|
| | 指向： | 多个 | 资产明细分类：外部管理的资产 | | | 通用 | 核心 | |
| 请进一步提供贵机构外部管理的上市股权和/或固定收益 AUM 的明细分类。 | | | | | | | | |
| | (1) 上市股权 | (2) 固定收益—主权、超国家或机构债券 (SSA) | (3) 固定收益—公司债券 | (4) 固定收益—资产证券化 | (5) 固定收益—私募债 | | | |
| (A) 主动 | _____ % | _____ % | _____ % | _____ % | _____ % | | | |
| (B) 被动 | _____ % | _____ % | _____ % | | | | | |
| 总计 | 100% | 100% | | | | | | |

解释性说明

| | |
|--------|---|
| 指标的目的 | 本指标用于关口指向和对标目的，并为签署方的后续答复提供背景信息。签署方在该指标中的答复，结合“组织概况”模块中的其他指标（如 OO 4、OO 5），将决定签署方在报告框架的后续阶段需要完成哪些模块、章节和指标。 |
| 补充报告指引 | 本指标仅适用于外部管理的资产。所有的百分比应代表签署方在每一资产类别中采用主动或被动策略的外部管理资产的百分比资产类别 在 PRI 报告框架中，私募债和资产证券化债务被视为主动策略。 |

逻辑

| | |
|------|---|
| 基于 | [OO5] |
| 指向 | OO 模块逻辑: [OO 5.2]、[OO 8]、[OO 9]、[OO 12]、[OO 13]、[OO 14] |
| 评估 | |
| 评估标准 | 不纳入评估 |

| | | | | | |
|------------------------|-----|--------------------|-----------------------------|---------------------|-------------------|
| 指标 ID OO 5.2 | 基于: | OO 5、OO 5.1 | 分节 资产明细分类：外部管理的资产 | PRI 原则 通用 | 指标类型 核心 |
| | 指向: | SAM 3、SAM 8 | | | |

请提供贵机构外部管理的 AUM 中专户委托（**segregated mandates**）和**集合基金**或**集合投资**（**pooled funds or investments**）的明细分类。

| | (1) 专户委托 | (2) 集合基金或集合投资 | 总计 |
|-------------|----------|---------------|-------------|
| (A) 上市股权—主动 | _____ % | _____ % | 100% |
| (B) 上市股权—被动 | _____ % | _____ % | 100% |
| (C) 固定收益—主动 | _____ % | _____ % | 100% |
| (D) 固定收益—被动 | _____ % | _____ % | 100% |
| (E) 私募股权 | _____ % | _____ % | 100% |
| (F) 房地产 | _____ % | _____ % | 100% |
| (G) 基础设施 | _____ % | _____ % | 100% |
| (H) 对冲基金 | _____ % | _____ % | 100% |

| 解释性说明 | |
|--------|--|
| 指标的目的 | <p>本指标用于关口指向和对标目的，并为签署方的后续答复提供背景信息。签署方在该指标中的答复，结合“组织概况”模块中的其他指标（如 OO 4、OO 5），将决定签署方在报告框架的后续阶段需要完成哪些模块、章节和指标。</p> <p>PRI 理解，对于主要或仅投资于集合基金的签署方而言，在委任外部投资管理人时纳入 ESG 因素可能较有难度。报告框架的后续指标考虑了这一点。但在外部投资管理人的遴选和监督中纳入 ESG 因素，则完全适用于主要或仅投资于集合基金的签署方。</p> |
| 补充报告指引 | 本指标仅适用于外部管理的资产。所有百分比数字应代表在各资产类别中签署方外部管理的资产在专户委托和/或集合基金中的百分比。 |
| 逻辑 | |
| 基于 | [OO5]、[OO5.1] |
| 指向 | [SAM 3]、[SAM 8] |
| 评估 | |
| 评估标准 | 不纳入评估 |

资产明细分类：内部管理的上市股权[OO5.3LE]

| 指标 ID | 基于: | OO 5 | 分节 | PRI 原则 | 指标类型 |
|----------------------------------|-----|------|------------------|--------|------|
| OO 5.3 LE | 指向: | 多个 | 资产明细分类：内部管理的上市股权 | 通用 | 核心 |
| 请进一步提供贵机构内部管理的上市股权 AUM 的明细分类。 | | | | | |
| (A) 被动股权 | | | _____ % | | |
| (B) 主动—量化 | | | _____ % | | |
| (C) 主动—基本面 | | | _____ % | | |
| (D) 其他策略 请说明：_____ [必填自由文本：小] | | | _____ % | | |
| 总计 | | | 100% | | |

| 解释性说明 | |
|--------|---|
| 指标的目的 | 本指标用于关口指向和对标目的，并为签署方的后续答复提供背景信息。签署方在该指标中的答复，结合“组织概况”模块中的其他指标（如 OO 4、OO 5），将决定签署方在报告框架的后续阶段需要完成哪些模块、章节和指标。 |
| 补充报告指引 | “其他策略”指不符合答案选项中任何上市股权策略的策略，可能是结合了主动量化和主动基本面策略的主动策略，或签署方认为不符合其他上市股权策略定义的策略。 |
| 逻辑 | |
| 基于 | [OO5] |

| | |
|------|---|
| 指向 | OO 模块逻辑: [OO8]、[OO9]、[OO11]、[OO17LE]、[OO19] |
| 评估 | |
| 评估标准 | 不纳入评估 |

资产明细分类：内部管理的固定收益[OO 5.3 FI]

| 指标 ID | 基于: | OO 5 | 分节 | PRI 原则 | 指标类型 |
|---------------------------------------|-----|------|------------------|--------|------|
| OO 5.3 FI | 指向: | 多个 | 资产明细分类：内部管理的固定收益 | 通用 | 核心 |
| 请进一步提供贵机构内部管理的 固定收益 AUM 的明细分类。 | | | | | |
| (A) 被动—主权、超国家或机构债券 | | | _____ % | | |
| (B) 被动—公司债券 | | | _____ % | | |
| (C) 主动—主权、超国家或机构债券 | | | _____ % | | |
| (D) 主动—公司债券 | | | _____ % | | |
| (E) 资产证券化 | | | _____ % | | |
| (F) 私募债 | | | _____ % | | |
| 总计 | | | 100% | | |

解释性说明

指标的目

本指标用于关口指向和对标目的，并为签署方的后续答复提供背景信息。签署方在该指标中的答复，结合“组织概况”模块中的其他指标（如 OO 4、OO 5），将决定签署方在报告框架的后续阶段需要完成哪些模块、章节和指标。

| 逻辑 | |
|------|---|
| 基于 | [OO5] |
| 指向 | OO 模块逻辑: [OO 8]、[OO 11]、[OO 17 FI]、[OO 19] FI 模块逻辑: [FI 9]、[FI 14] |
| 评估 | |
| 评估标准 | 不纳入评估 |

资产明细分类：内部管理的私募股权[OO 5.3 PE]

| 指标 ID | 基于: | OO 5 | 分节 | PRI 原则 | 指标类型 |
|---|-----|------|------------------|--------|------|
| OO 5.3 PE | 指向: | 不适用 | 资产明细分类：内部管理的私募股权 | 通用 | 核心 |
| <p>请进一步提供贵机构内部管理的私募股权 AUM 的明细分类。</p> <p>百分比数字可四舍五入到最近的 5%。</p> | | | | | |
| (A) 风险资本 | | | _____ % | | |
| (B) 成长资本 | | | _____ % | | |
| (C) (杠杆) 收购 | | | _____ % | | |
| (D) 不良资产、重振资本或特殊机会 | | | _____ % | | |
| (E) S 基金 | | | _____ % | | |
| (F) 其他 请说明: _____ [必填自由文本: 小] | | | _____ % | | |
| 总计 | | | 100% | | |

解释性说明

| | |
|-----------|---|
| 指标的目的 | 本指标用于对标目的，并为签署方的后续答复提供背景信息。 通过该指标收集的汇总数据也可能用于分析目的，并用于 PRI 的公共传播，包括制定签署方指南、报告和/或其他产出。 |
| 补充报告指引 | “其他”指答案选项中未列出的其他私募股权投资形式。 |
| 逻辑 | |
| 基于 | [005] |
| 指向 | 不适用 |
| 评估 | |
| 评估标准 | 不纳入评估 |

资产明细分类：内部管理的房地产[OO5.3 RE]

| 指标 ID | 基于: | OO 5 | 分节 | PRI 原则 | 指标类型 |
|--|-----|------|-----------------|--------|------|
| OO 5.3 RE | 指向: | 不适用 | 资产明细分类：内部管理的房地产 | 通用 | 核心 |
| <p>请进一步提供贵机构内部管理的房地产 AUM的明细分类。</p> <p>百分比数字可四舍五入到最近的5%。</p> | | | | | |
| (A) 零售 | | | _____ % | | |
| (B) 办公 | | | _____ % | | |
| (C) 工业 | | | _____ % | | |
| (D) 住宅 | | | _____ % | | |
| (E) 酒店 | | | _____ % | | |
| (F) 住宿、休闲和娱乐 | | | _____ % | | |
| (G) 教育 | | | _____ % | | |
| (H) 科技 | | | _____ % | | |

| | |
|--------------------------------|-------------|
| (I) 医疗保健 | _____ % |
| (J) 多用途 | _____ % |
| (K) 其他 请说明：_____ [必填自由文本：小] | _____ % |
| 总计 | 100% |

解释性说明

| | |
|---------------|---|
| 指标的目的 | 本指标用于对标目的，并为签署方的后续答复提供背景信息。 通过该指标收集的汇总数据也可能用于分析目的，并用于 PRI 的公共传播，包括制定签署方指南、报告和/或其他产出。 |
| 补充报告指引 | <p>上述板块与《GRESB 2022 年房地产参考指南》保持一致</p> <p>零售：包括零售商业街、零售中心、餐馆/酒吧</p> <p>办公：包括公司办公场所、医疗办公场所、商业园区</p> <p>工业：包括流通仓库、工业园区、制造区</p> <p>住宅：包括多户住宅、家庭住宅、学生宿舍、退休人员住宅</p> <p>酒店：包括酒店、汽车旅馆、青年旅馆</p> <p>住宿、休闲和娱乐：包括室内场馆、健身中心、表演艺术场馆、游泳中心、博物馆、画廊</p> <p>教育：包括学校、大学、图书馆</p> <p>科技：包括数据中心、实验室、生命科学中心</p> <p>医疗保健：包括医疗中心、养老院</p> <p>多用途：包括办公/零售、办公/住宅、办公/工业的多种用途</p> <p>其他：可包括停车场（室内）、自助存储和以上未提及的其他场地</p> |
| 参考其他标准 | GRESB 2022 房地产参考指南：附录 3a — 物业类型分类 |

逻辑

| | |
|------|-------|
| 基于 | [005] |
| 指向 | 不适用 |
| 评估 | |
| 评估标准 | 不纳入评估 |

资产明细分类：内部管理的基础设施[OO 5.3 INF]

| 指标 ID OO 5.3 INF | 基于： OO 5 | | 分节 资产明细分类：内部管理的基础设施 | PRI 原则 通用 | 指标类型 核心 |
|---|--------------------|--|------------------------|--------------|-------------------|
| <p>请进一步提供贵机构内部管理的基础设施 AUM 的明细分类。</p> <p>百分比数字可四舍五入到最近的 5%。</p> | | | | | |
| (A) 数据基础设施 | _____ % | | | | |
| (B) 多元化 | _____ % | | | | |
| (C) 能源和水资源 | _____ % | | | | |
| (D) 环境服务 | _____ % | | | | |
| (E) 网络公用事业 | _____ % | | | | |
| (F) 发电（不包括可再生能源） | _____ % | | | | |
| (G) 可再生能源 | _____ % | | | | |
| (H) 社会基础设施 | _____ % | | | | |

| | |
|--------------------------------|-------------|
| (I) 交通运输 | _____ % |
| (J) 其他 请说明：_____ [必填自由文本：小] | _____ % |
| 总计 | 100% |

| 解释性说明 | |
|--------|---|
| 指标的目的 | 本指标用于对标目的，并为签署方的后续答复提供背景信息。 通过该指标收集的汇总数据也可能用于分析目的，并用于 PRI 的公共传播，包括制定签署方指南、报告和/或其他产出。 |
| 补充报告指引 | 上述板块与《GRESB 2022 年基础设施基金参考指南》保持一致 数据基础设施：提供电信和数据基础设施的公司 多元化：实体投资于多个板块 能源和水资源：处理和运送自然资源的公司 环境服务：处理水、废水和固体废物以实现卫生和再利用的公司 网络公用事业：经营基础设施网络的公司，具有自然垄断的特点（存在准入门槛，规模收益递增） 发电（不包括可再生能源）：使用一系列技术发电的独立发电厂，但不包括风能、太阳能和其他可再生能源 可再生能源：使用风能、太阳能、水能和其他可再生能源独立发电和输电的公司，包括储能公司 社会基础设施：为公众提供支持、住处或其他服务的公司 交通运输：提供交通运输基础设施服务的公司 |
| 参考其他标准 | GRESB 2022 基础设施基金参考指南：实体与报告特点——板块与地域：RC3 |
| 逻辑 | |
| 基于 | [O05] |
| 指向 | 不适用 |
| 评估 | |

| | |
|------|-------|
| 评估标准 | 不纳入评估 |
|------|-------|

资产明细分类：内部管理的对冲基金[OO 5.3 HF]

| 指标 ID OO 5.3 HF | 基于: | OO 5 | 分节 资产明细分类：内部管理的对冲基金 | PRI 原则 通用 | 指标类型 核心 |
|-----------------------------------|-----|--------------|------------------------|--------------|------------|
| | 指向: | OO 11 | | | |
| 请进一步提供贵机构内部管理的对冲基金资产的明细分类。 | | | | | |
| (A) 多策略 | | | _____ % | | |
| (B) 多/空股票 | | | _____ % | | |
| (C) 多/空信贷 | | | _____ % | | |
| (D) 不良资产、特殊机会和事件驱动的基本面 | | | _____ % | | |
| (E) 结构性信贷 | | | _____ % | | |
| (F) 全球宏观 | | | _____ % | | |
| (G) 大宗商品交易顾问 | | | _____ % | | |
| (H) 其他策略 请说明： _____ [必填自由文本：小] | | | _____ % | | |

| | |
|----|------|
| 总计 | 100% |
|----|------|

| 解释性说明 | |
|--------|---|
| 指标的目的 | 本指标用于关口指向和对标目的，并为签署方的后续答复提供背景信息。签署方在该指标中的答复，结合“组织概况”模块中的其他指标（如 OO 4、OO 5），将决定签署方在报告框架的后续阶段需要完成哪些模块、章节和指标。 |
| 补充报告指引 | “其他策略”指根据 PRI 报告框架术语表中的分类，不符合答案选项中所列任何一项的策略。 |
| 其他资源 | 这些策略在一定程度上与 HFR 对冲基金策略分类体系 保持一致。 |
| 逻辑 | |
| 基于 | [OO5] |
| 指向 | [OO11] |
| 评估 | |
| 评估标准 | 不纳入评估 |

由 PRI 签署方管理的外部管理资产[OO6]

| 指标 ID OO 6 | 基于: | OO 5 | 分节 由 PRI 签署方管理 | PRI 原则 通用 | 指标类型 核心 |
|--|-----|------|-------------------|--------------|------------|
| | 指向: | 不适用 | | | |
| <p>贵机构外部管理的资产中，由 PRI 签署方管理的资产比例是？</p> <p>百分比数字可四舍五入到最近的 5%。</p> <p>_____ %</p> | | | | | |

| 解释性说明 | |
|-------|--|
| 指标的目的 | 在 PRI 公共传播中，这一数字用于减少签署方 AUM 重复计算的可能性。对这一比例不作价值判断，也不会用在评估方法中。 |
| 逻辑 | |
| 基于 | [OO5] |
| 指向 | 不适用 |
| 评估 | |
| 评估标准 | 不纳入评估 |

地域明细分类[007]

| 指标 ID 007 | 基于: | 00 5、00 5.1、00 5.3 FI | 分节 地域明细分类 | PRI 原则 通用 | 指标类型 核心 |
|---|---|-----------------------------------|--------------|--------------|------------|
| <p>贵机构各资产类别的 AUM 中，投资于新兴市场和发展中经济体的比例是？</p> <p>这一百分比数字应是内部和外部管理的资产加总后的比例。市场分类依据国际货币基金组织的《世界经济展望》。</p> | | | | | |
| | | <p>投资于新兴市场和发展中经济体的 AUM</p> | | | |
| (A) 上市股权 | <p>[下拉式清单]</p> <p>(1) 0% (2) >0 至 10% (3) >10 至 20% (4) >20 至 30% (5) >30 至 40% (6) >40 至 50% (7) >50 至 60% (8) >60 至 70% (9) >70 至 80% (10) >80 至 90% (11) >90 至 <100% (12) 100%</p> | | | | |
| (B) 固定收益—主权、超国家或机构债券 | <p>[同上]</p> | | | | |

| | |
|---------------------------------|------|
| (C) 固定收益— 公司债券 | [同上] |
| (D) 固定收益— 资产证券化 | [同上] |
| (E) 固定收益— 私募债 | [同上] |
| (F) 私募股权 | [同上] |
| (G) 房地产 | [同上] |
| (H) 基础设施 | [同上] |
| (I) 对冲基金 | [同上] |

| 解释性说明 | |
|--------|--|
| 指标的目的 | 与新兴市场和发展中经济体的投资者相比，发达经济体的投资者可能采取不同的行动来实施负责任投资。通过报告这些信息，签署方能够将他们实施的进展与有相似资产细分比例的同行业组织比较，并为签署方的后续答复提供背景信息。 通过该指标收集的汇总数据也可能用于分析目的，并用于 PRI 的公共传播，包括制定签署方指南、报告和/或其他产出。 |
| 补充报告指引 | 市场分类依据 国际货币基金组织的《世界经济展望》 。 |
| 逻辑 | |
| 基于 | [OO 5]、[OO 5.1]、[OO 5.3 FI] |
| 指向 | 不适用 |

| 评估 | |
|------|-------|
| 评估标准 | 不纳入评估 |

尽责管理

尽责管理[008]

| | | | | | |
|----------------------|-----|--|-------------------|---------------------|-------------------|
| 指标 ID 00 8 | 基于: | 00 5、00 5.1、00 5.3 LE、00 5.3 FI | 分节 尽责管理 | PRI 原则 通用 | 指标类型 核心 |
| | 指向: | 多个指标 | | | |

贵机构是否对任何资产开展（代理）投票之外的**尽责管理**活动？

| | (1) 上市 股权—主 动 | (2) 上市 股权—被 动 | (3) 固定 收益—主 动 | (4) 固定 收益—被 动 | (5) 私募 股权 | (6) 房地 产 | (7) 基础 设施 | (8) 对冲 基金 | (9) 林业 | (10) 耕地 | (11) 其他 |
|-----------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| (A) 是，通过内部员工开展 | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| (B) 是，通过服务商开展 | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| (C) 是，通过外部管理人开展 | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| (D) 我们未开展尽责管理活动 | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> |

解释性说明

指标的目的

签署方的答复将决定其在报告框架的后续阶段会看到哪些指标。

| | |
|---------------|---|
| <p>补充报告指引</p> | <p>PRI 对尽责管理的定义是：“机构投资者利用其影响力，将整体长期价值（包括共同的经济、社会和环境资产价值）最大化，而投资回报及客户和受益人的利益都依赖于此价值”。</p> <p>投资者可通过多种尽责管理工具实施尽责管理，包括利用投资者对现有或潜在投资对象或发行方的影响力，例如：</p> <ul style="list-style-type: none"> • 与当前和潜在投资对象接触； • 在股东大会上投票； • 发起、共同发起或递交股东决议或提案； • 提名董事会成员； • 发挥在董事会和董事会委员会中的作用； • 直接监督投资组合公司或资产，以及 • 诉讼 <p>投资者也可通过影响政策制定者和其他非发行人利益相关方实施尽责管理，例如：</p> <ul style="list-style-type: none"> • 政策参与； • 与标准制定者接触； • 与行业团体接触； • 与投资链中的中间方进行协商并监督其尽责管理行动，例如，资产所有者与外部管理人接触，有限合伙人与普通合伙人接触； • 与其他利益相关方接触，如非政府组织、工作者、社区和其他权利人； • 助力提供公共产品（如公开的研究）； • 参与公共对话（如通过媒体），支持尽责管理目标 <p>投资者可以综合使用上述多种工具。</p> <p>在选项 A 中，“通过内部员工”指通过签署方组织的内部员工（如雇员），单独或协作开展尽责管理活动。</p> <p>在选项 B 中，“通过服务商”指通过以下方式开展的尽责管理活动：</p> <p>(i) 提供独立尽责管理服务但并不管理客户标的资产的商业方，涉及明确费用和委托，而不只是收取会员费，或</p> <p>(ii) 代表其成员开展尽责管理工作的投资者组织，从成员那里接受明确费用和委托，而不只是收取会员费。其中包括完全外包的尽责管理工作，以及在投资者的员工承担部分尽责管理活动时，由服务商协助开展的行动。服务商的活动不包括协调、合作的尽责管理，也不包括代表某个组织的成员提出的大规模披露要求。</p> <p>在选项 C 中，“通过外部管理人”指通过外部投资管理人的，单独或协作开展尽责管理活动。</p> |
| | <p>逻辑</p> |

| | |
|------|--|
| 指向 | <p>OO 模块逻辑: [OO 10]</p> <p>PGS 模块逻辑: [PGS 1]、[PGS 10]、[PGS 23]、[PGS 24]、[PGS 24.1]、[PGS 25]、[PGS 26]、[PGS 27]、[PGS 28]、[PGS 36]、[PGS 37]、[PGS 38]、[PGS 39]、[PGS 40]</p> <p>SAM 模块逻辑: [SAM 6]、[SAM 13]</p> |
| 评估 | |
| 评估标准 | 该指标本身不设直接评估，但如果签署方报告称未开展尽责管理活动，此处披露的信息可能会影响签署方的评估。 |

尽责管理：（代理）投票[OO 9 HF、OO 9、OO 9.1]

| 指标 ID OO 9 HF | 基于: | OO 5 | 分节 资产明细分类 | PRI 原则 通用 | 指标类型 核心 |
|--|-----|-------------|--------------|--------------|------------|
| | 指向: | OO 9 | | | |
| 贵机构在 对冲基金 策略中是否直接投资于 上市股权 ？ | | | | | |
| <input type="radio"/> (A) 是 <input type="radio"/> (B) 否 | | | | | |

| 解释性说明 | |
|--------|---|
| 指标的目的 | 本指标用于关口指向和对标目的，并为签署方的后续答复提供背景信息。 |
| 补充报告指引 | 就本指标而言，“直接投资于上市股权”指对管理人拥有（代理）投票权的上市股权的投资。 |
| 逻辑 | |
| 基于 | [OO 5] |
| 指向 | [OO 9] |
| 评估 | |
| 评估标准 | 不纳入评估 |

| | | | | | |
|----------------------|-----|--------------------------------------|--------------------------|---------------------|-------------------|
| 指标 ID OO 9 | 基于: | OO 5.1、OO 5.3 LE、 OO 9 HF | 分节 尽责管理：（代理）投票 | PRI 原则 通用 | 指标类型 核心 |
| | 指向: | 多个指标 | | | |

贵机构是否对持有的任何上市股权开展（代理）投票活动？

| | (1) 上市股权—主动 | (2) 上市股权—被动 | (3) 对冲基金 |
|-----------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| (A) 是，通过内部员工 | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| (B) 是，通过服务商 | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| (C) 是，通过外部管理人 | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| (D) 我们不进行（代理）投票 | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> |

解释性说明

| | |
|--------|---|
| 指标的目的 | 签署方的答复将决定其在报告框架的后续阶段会看到哪些指标。 |
| 补充报告指引 | <p>在选项 A 中，“通过内部员工”指通过签署方的内部员工（如雇员）开展（代理）投票活动。</p> <p>在选项 B 中，“通过服务商”指通过以下方式开展（代理）投票活动：</p> <p>(i) 提供独立（代理）投票服务但并不管理客户标的资产的商业方，涉及明确费用和委托，而不只是收取会员费，或</p> <p>(ii) 代表其成员开展（代理）投票的投资者组织，从成员那里接受明确费用和委托以作为其代表，而不只是收取会员费。其中包括完全外包的（代理）投票，以及在投资者的员工承担部分（代理）投票活动时，由服务商协助开展的行动。</p> |

| | |
|-------------|---|
| | 在选项 C 中，“通过外部管理人”指通过外部投资管理人开展（代理）投票活动。 |
| 逻辑 | |
| 基于 | [OO 5.1]、[OO 5.3 LE]、[OO 9 HF] |
| 指向 | <p>OO 模块逻辑： [OO 9.1]、[OO 10]</p> <p>PGS 模块逻辑： [PGS 1]、[PGS 7]、[PGS 10]、[PGS 23]、[PGS 24]、[PGS 24.1]、[PGS 25]、[PGS 26]、[PGS 27]、[PGS 28]、[PGS 29]、[PGS 30]、[PGS 32]、[PGS 33]、[PGS 34]、[PGS 35]、[PGS 36]、[PGS 39]、[PGS 40]</p> <p>SAM 模块逻辑： [SAM 7]、[SAM 14]</p> |
| 评估 | |
| 评估标准 | 该指标本身不设直接评估，但如果签署方报告称其未开展尽责管理活动，此处披露的信息可能会影响签署方的评估。 |

| 指标 ID OO 9.1 | 基于: OO 9 | | 分节 尽责管理：（代理）投票 | PRI 原则 通用 | 指标类型 核心 |
|---|---|--|-----------------------|--------------|------------|
| <p>对于各资产类别，贵机构在持有的上市股权中拥有自行投票权的百分比是多少？</p> <p>这一百分比数字应反映内部和外部管理的资产加总后的比例。</p> | | | | | |
| | | | 持有的上市股权中，拥有自行投票权的百分比： | | |
| (A) 上市股权—主动 | <p>[下拉式清单]</p> <p>(1) 0%</p> <p>(2) >0 至 10%</p> <p>(3) >10 至 20%</p> <p>(4) >20 至 30%</p> <p>(5) >30 至 40%</p> <p>(6) >40 至 50%</p> <p>(7) >50 至 60%</p> <p>(8) >60 至 70%</p> <p>(9) >70 至 80%</p> <p>(10) >80 至 90%</p> <p>(11) >90 至 <100%</p> <p>(12) 100%</p> | | | | |
| (B) 上市股权—被动 | [同上] | | | | |

| | |
|----------|------|
| (C) 对冲基金 | [同上] |
|----------|------|

| 解释性说明 | |
|--------|--|
| 指标的目的 | 投资者通常只对其持有的部分上市股权拥有自行投票权（比如投资管理人的某些专户客户拥有投票控制权，或者资产所有者投资于没有投票控制权的集合基金而失去部分投票权）。通过该指标，签署方可说明对 AUM 拥有自行投票权的百分比，从而对报告框架中与（代理）投票有关的指标更好地进行对标和分析。 |
| 补充报告指引 | 在该指标中，“自行投票权”指签署方能够决定 <i>是否以及如何</i> 对被投资公司的管理层和/或股东决议投票。签署方可在年度或特别股东大会（AGM 或 EGM）期间亲自投票，或通过代理人投票。 |
| 逻辑 | |
| 基于 | [OO 9] |
| 指向 | [PGS 10.1]、[PGS 31] |
| 评估 | |
| 评估标准 | 不纳入评估 |

未开展尽责管理[OO10]

| 指标 ID | 基于: | OO 8、OO 9 | 分节 | PRI 原则 | 指标类型 |
|--|-----|-----------|------------|--------|------|
| | 指向: | 不适用 | | | |
| 请说明贵机构目前未开展 尽责管理 和/或 （代理）投票 的原因。 | | | | | |
| 尽责管理，不包括（代理）投票 | | | | | |
| (A) 上市股权—主动 | | | [必填自由文本：大] | | |
| (B) 上市股权—被动 | | | [必填自由文本：大] | | |
| (C) 固定收益—主动 | | | [必填自由文本：大] | | |
| (D) 固定收益—被动 | | | [必填自由文本：大] | | |
| (E) 私募股权 | | | [必填自由文本：大] | | |
| (F) 房地产 | | | [必填自由文本：大] | | |
| (G) 基础设施 | | | [必填自由文本：大] | | |
| (H) 对冲基金 | | | [必填自由文本：大] | | |

| | |
|----------------|------------|
| (I) 林业 | [必填自由文本：大] |
| (J) 耕地 | [必填自由文本：大] |
| (K) 其他 | [必填自由文本：大] |
| (代理) 投票 | |
| (L) 上市股权—主动 | [必填自由文本：大] |
| (M) 上市股权—被动 | [必填自由文本：大] |
| (N) 对冲基金 | [必填自由文本：大] |

| 解释性说明 | |
|---------------|--|
| 指标的目的 | 根据 PRI 原则 2，签署方承诺成为积极所有者，将 ESG 因素纳入所有权政策和实践。通过该指标，签署方可解释为何没有对这些资产类别开展尽责管理。 |
| 补充报告指引 | 签署方可详细说明对各相关资产类别未实施 PRI 原则 2（成为积极的所有者，将 ESG 问题纳入所有权政策和实践）的原因。 |
| 其他资源 | 更多指引，请参见 负责任投资简介 。 PRI 的 投资工具 说明了如何对特定资产类别开展尽责管理。 |
| 逻辑 | |
| 基于 | [008]、[009] |
| 指向 | 不适用 |
| 评估 | |

| | |
|------|-------|
| 评估标准 | 不纳入评估 |
|------|-------|

纳入 ESG 因素

内部管理的资产[0011]

| 指标 ID OO 11 | 基于: | OO 5、OO 5.3 LE、 OO 5.3 FI、OO 5.3 HF | 分节 内部管理的资产 | PRI 原则 1 | 指标类型 核心 |
|-----------------------------------|-----|--|-------------------------|-------------|------------|
| | 指向: | 多个指标 | | | |
| 对于内部管理的各资产类别，贵机构是否将 ESG 因素纳入投资决策？ | | | | | |
| | | (1) 是，我们将 ESG 因素纳入投资决策 | (2) 否，我们未将 ESG 因素纳入投资决策 | | |
| (A) 上市股权—被动 | | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | | |
| (B) 上市股权—主动—量化 | | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | | |
| (C) 上市股权—主动—基本面 | | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | | |
| (D) 上市股权—其他策略 | | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | | |
| (E) 固定收益—主权、超国家或机构债券 | | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | | |
| (F) 固定收益—公司债券 | | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | | |

| | | |
|-----------------------------|---|---|
| (G) 固定收益—资产证券化 | ○ | ○ |
| (H) 固定收益—私募债 | ○ | ○ |
| (I) 私募股权 | ○ | ○ |
| (J) 房地产 | ○ | ○ |
| (K) 基础设施 | ○ | ○ |
| (L) 对冲基金—多策略 | ○ | ○ |
| (M) 对冲基金—多/空股票 | ○ | ○ |
| (N) 对冲基金—多/空信贷 | ○ | ○ |
| (O) 对冲基金—不良资产、特殊机会和事件驱动的基本面 | ○ | ○ |
| (P) 对冲基金—结构性信贷 | ○ | ○ |
| (Q) 对冲基金—全球宏观 | ○ | ○ |
| (R) 对冲基金—大宗商品交易顾问 | ○ | ○ |

| | | |
|------------------------------------|---|---|
| (S) 对冲基金—其他策略 | ○ | ○ |
| (T) 林业 | ○ | ○ |
| (U) 耕地 | ○ | ○ |
| (V) 其他：_____ [按 OO5 第(1)栏报告的内容预填充] | ○ | ○ |

| 解释性说明 | |
|--------------|--|
| 指标的目的 | 签署方的答复将决定其在报告框架的后续阶段会看到哪些指标。 |
| 逻辑 | |
| 基于 | [OO 5]、[OO 5.3 LE]、[OO 5.3 FI]、[OO 5.3 HF] |
| 指向 | [OO 15]、[OO 16]、[OO 17 LE]、[OO 17 FI]、[OO 18]、[OO 19]、[OO 21] |
| 评估 | |
| 评估标准 | 该指标本身不设直接评估，但此处披露的信息可能会影响签署方的模块得分。参见 投资者报告的评估方式 ，了解更多详情。 |

外部管理人遴选[OO 12]

| 指标 ID OO 12 | 基于: | OO 5、OO 5.1 | 分节 外部管理人遴选 | PRI 原则 1 | 指标类型 核心 |
|--|-----|-------------------------------|---------------|-------------------------------|------------|
| | 指向: | 多个指标 | | | |
| 对于外部管理的各资产类别，贵机构在遴选外部投资管理人时是否纳入了 ESG 因素？ | | | | | |
| | | (1) 是，我们在遴选外部投资管理人时纳入了 ESG 因素 | | (2) 否，我们在遴选外部投资管理人时未纳入 ESG 因素 | |
| (A) 上市股权—主动 | | <input type="radio"/> | | <input type="radio"/> | |
| (B) 上市股权—被动 | | <input type="radio"/> | | <input type="radio"/> | |
| (C) 固定收益—主动 | | <input type="radio"/> | | <input type="radio"/> | |
| (D) 固定收益—被动 | | <input type="radio"/> | | <input type="radio"/> | |
| (E) 私募股权 | | <input type="radio"/> | | <input type="radio"/> | |
| (F) 房地产 | | <input type="radio"/> | | <input type="radio"/> | |
| (G) 基础设施 | | <input type="radio"/> | | <input type="radio"/> | |

| | | |
|--------------------------------------|---|---|
| (H) 对冲基金 | ○ | ○ |
| (I) 林业 | ○ | ○ |
| (J) 耕地 | ○ | ○ |
| (K) 其他：_____ [按 005 第(2) 栏中报告的内容预填充] | ○ | ○ |

| 解释性说明 | |
|-------|---|
| 指标的目的 | 签署方的答复将决定其在报告框架的后续阶段会看到哪些指标。 |
| 逻辑 | |
| 基于 | [005]、[005.1] |
| 指向 | OO 模块逻辑： [00 18]、[00 15]、[00 16]、[00 21] SAM 模块逻辑： [SAM 1]、[SAM 2]、[SAM 3]、[SAM 4] |
| 评估 | |
| 评估标准 | 该指标本身不设直接评估，但此处披露的信息可能会影响签署方的模块得分。参见 投资者报告的评估方式 ，了解更多详情。 |

外部管理人委任[0013]

| 指标 ID 00 13 | 基于: | 00 5、00 5.1 | 分节 外部管理人委任 | PRI 原则 1 | 指标类型 核心 |
|--|-----|-------------------------------|---------------|-------------------------------|------------|
| | 指向: | 多个指标 | | | |
| 对于外部管理的各资产类别，贵机构在委任外部投资管理人时是否纳入了 ESG 因素？ | | | | | |
| | | (1) 是，我们在委任外部投资管理人时纳入了 ESG 因素 | | (2) 否，我们在委任外部投资管理人时未纳入 ESG 因素 | |
| (A) 上市股权—主动 | | <input type="radio"/> | | <input type="radio"/> | |
| (B) 上市股权—被动 | | <input type="radio"/> | | <input type="radio"/> | |
| (C) 固定收益—主动 | | <input type="radio"/> | | <input type="radio"/> | |
| (D) 固定收益—被动 | | <input type="radio"/> | | <input type="radio"/> | |
| (E) 私募股权 | | <input type="radio"/> | | <input type="radio"/> | |
| (F) 房地产 | | <input type="radio"/> | | <input type="radio"/> | |
| (G) 基础设施 | | <input type="radio"/> | | <input type="radio"/> | |

| | | |
|--------------------------------------|-----------------------|-----------------------|
| (H) 对冲基金 | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> |
| (I) 林业 | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> |
| (J) 耕地 | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> |
| (K) 其他：_____ [按 005 第(2) 栏中报告的内容预填充] | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> |

| 解释性说明 | |
|-------|---|
| 指标的目的 | 签署方的答复将决定其在报告框架的后续阶段会看到哪些指标。 |
| 逻辑 | |
| 基于 | [005]、[005.1] |
| 指向 | OO 模块逻辑： [00 18]、[00 15]、[00 16]、[00 21] SAM 模块逻辑： [SAM 1]、[SAM 2]、[SAM 3]、[SAM 8] |
| 评估 | |
| 评估标准 | 该指标本身不设直接评估，但此处披露的信息可能会影响签署方的模块得分。参见 投资者报告的评估方式 ，了解更多详情。 |

外部管理人监督[OO14]

| 指标 ID OO 14 | 基于: | OO 5、OO 5.1 | 分节 外部管理人监督 | PRI 原则 1 | 指标类型 核心 |
|--|-----|-------------------------------|---------------|-------------------------------|-------------------|
| | 指向: | 多个指标 | | | |
| 对于外部管理的各资产类别，贵机构在 监督外部投资管理人 时是否 纳入了 ESG 因素 ？ | | | | | |
| | | (1) 是，我们在监督外部投资管理人时纳入了 ESG 因素 | | (2) 否，我们在监督外部投资管理人时未纳入 ESG 因素 | |
| (A) 上市股权—主动 | | <input type="radio"/> | | <input type="radio"/> | |
| (B) 上市股权—被动 | | <input type="radio"/> | | <input type="radio"/> | |
| (C) 固定收益—主动 | | <input type="radio"/> | | <input type="radio"/> | |
| (D) 固定收益—被动 | | <input type="radio"/> | | <input type="radio"/> | |
| (E) 私募股权 | | <input type="radio"/> | | <input type="radio"/> | |
| (F) 房地产 | | <input type="radio"/> | | <input type="radio"/> | |
| (G) 基础设施 | | <input type="radio"/> | | <input type="radio"/> | |

| | | |
|------------------------------------|-----------------------|-----------------------|
| (H) 对冲基金 | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> |
| (I) 林业 | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> |
| (J) 耕地 | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> |
| (K) 其他：_____ [按 OO5 第(2)栏报告的内容预填充] | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> |

| 解释性说明 | |
|--------|---|
| 指标的目的 | 签署方的答复将决定其在报告框架的后续阶段会看到哪些指标。 |
| 补充报告指引 | 在答复中，签署方应说明在报告年度内对管理相关资产类别的外部投资管理人的监督情况，无论其委任时间为何时。 |
| 逻辑 | |
| 基于 | [OO 5]、[OO 5.1] |
| 指向 | OO 模块逻辑： [OO 18]、[OO 15]、[OO 16]、[OO 21] SAM 模块逻辑： [SAM 1]、[SAM 2]、[SAM 3]、[SAM 9]、[SAM 10]、[SAM 11]、[SAM 12]、[SAM 15]、[SAM 16]、[SAM 17] |
| 评估 | |
| 评估标准 | 该指标本身不设直接评估，但此处披露的信息可能会影响签署方的模块得分。参见 投资者报告的评估方式 ，了解更多详情。 |

其他资产类别中的 ESG 因素[OO15]

| 指标 ID | 基于: | OO 11、OO 12-14 | 分节 | PRI 原则 | 指标类型 |
|---------------------------|-----|----------------|--------------|--------|------|
| OO 15 | 指向: | 不适用 | 其他资产类别中的 ESG | 1 | 核心 |
| 请说明贵机构如何将 ESG 因素纳入以下资产类别。 | | | | | |
| 内部管理的资产 | | | | | |
| (A) 林业 | | | [必填自由文本: 大] | | |
| (B) 耕地 | | | [必填自由文本: 大] | | |
| (C) 其他 | | | [必填自由文本: 大] | | |
| 外部管理的资产 | | | | | |
| (D) 林业 | | | [必填自由文本: 大] | | |
| (E) 耕地 | | | [必填自由文本: 大] | | |
| (F) 其他 | | | [必填自由文本: 大] | | |

| 解释性说明 | |
|-------|--|
| 指标的目的 | PRI 尚未开发对林业、耕地和其他资产类别的模块。通过该指标，签署方可报告将 ESG 因素纳入这些资产类别的方法。 |
| 其他资源 | <p>关于将 ESG 因素纳入林业的更多指引，请参见 林业负责任投资简介 和 PRI 专门的 林业 网页。</p> <p>关于将 ESG 因素纳入耕地的更多指引，请参见 PRI 专门的 耕地 网页。</p> <p>PRI 的 投资工具 说明了如何将 ESG 因素纳入特定资产类别。</p> |
| 逻辑 | |
| 基于 | [OO 11]、[OO 12]、[OO 13]、[OO 14] |
| 指向 | 不适用 |
| 评估 | |
| 评估标准 | 不纳入评估 |

未纳入 ESG 因素[OO16]

| 指标 ID | 基于: | OO 11、OO 12-14 | 分节 | PRI 原则 | 指标类型 |
|----------------------------|-----|----------------|------------|-------------|------|
| | 指向: | 不适用 | | | |
| OO 16 | | | 未纳入 ESG 因素 | 1 | 核心 |
| 说明贵机构目前未将 ESG 因素纳入投资决策的原因。 | | | | | |
| 内部管理的资产 | | | | | |
| (A) 上市股权—被动 | | | | [必填自由文本: 大] | |
| (B) 上市股权—主动量化 | | | | [必填自由文本: 大] | |
| (C) 上市股权—主动基本面 | | | | [必填自由文本: 大] | |
| (D) 上市股权—其他策略 | | | | [必填自由文本: 大] | |
| (E) 固定收益—主权、超国家或机构债券 | | | | [必填自由文本: 大] | |
| (F) 固定收益—公司债券 | | | | [必填自由文本: 大] | |
| (G) 固定收益—资产证券化 | | | | [必填自由文本: 大] | |
| (H) 固定收益—私募债 | | | | [必填自由文本: 大] | |

| | |
|----------------|------------|
| (I) 私募股权 | [必填自由文本：大] |
| (J) 房地产 | [必填自由文本：大] |
| (K) 基础设施 | [必填自由文本：大] |
| (L) 对冲基金 | [必填自由文本：大] |
| (M) 林业 | [必填自由文本：大] |
| (N) 耕地 | [必填自由文本：大] |
| (O) 其他 | [必填自由文本：大] |
| 外部管理的资产 | |
| (P) 上市股权—主动 | [必填自由文本：大] |
| (Q) 上市股权—被动 | [必填自由文本：大] |
| (R) 固定收益—主动 | [必填自由文本：大] |
| (S) 固定收益—被动 | [必填自由文本：大] |

| | |
|----------|------------|
| (T) 私募股权 | [必填自由文本：大] |
| (U) 房地产 | [必填自由文本：大] |
| (V) 基础设施 | [必填自由文本：大] |
| (W) 对冲基金 | [必填自由文本：大] |
| (X) 林业 | [必填自由文本：大] |
| (Y) 耕地 | [必填自由文本：大] |
| (Z) 其他 | [必填自由文本：大] |

| 解释性说明 | |
|--------|---|
| 指标的目的 | 根据 PRI 原则 1，签署方承诺将 ESG 因素纳入投资分析和决策过程。通过该指标，签署方可解释为何没有将 ESG 因素纳入这些资产类别。 |
| 补充报告指引 | 签署方可详细说明对于各相关资产类别未实施 PRI 原则 1（将 ESG 问题纳入投资分析和决策过程）的原因。 |
| 其他资源 | 更多指引，请参见 负责任投资简介 。 PRI 的 投资工具 说明了如何将 ESG 因素纳入特定资产类别。 |
| 逻辑 | |
| 基于 | [OO 11]、[OO 12]、[OO 13]、[OO 14] |
| 指向 | 不适用 |

| 评估 | |
|------|-------|
| 评估标准 | 不纳入评估 |

ESG 策略

上市股权[OO 17 LE、OO 17.1 LE]

| 指标 ID | 基于: | OO 11 | 分节 | PRI 原则 | 指标类型 |
|--|-----|------------------|-------------------------|--------|------|
| OO 17 LE | 指向: | OO 17.1 LE、LE 12 | 上市股权 | 1 | 核心 |
| <p>在内部管理的主动型上市股权资产中，贵机构采用了哪种 ESG 纳入方法和/或多种方法的结合？</p> <p>百分比数字可四舍五入到最近的 5%。</p> | | | | | |
| | | | 在内部管理的所有主动型上市股权资产中的百分比： | | |
| (A) 仅筛选 | | | _____ % | | |
| (B) 仅主题 | | | _____ % | | |
| (C) 仅整合 | | | _____ % | | |
| (D) 筛选和整合 | | | _____ % | | |
| (E) 主题和整合 | | | _____ % | | |
| (F) 筛选和主题 | | | _____ % | | |

| | |
|------------|-------------|
| (G) 三种方法结合 | _____ % |
| (H) 无 | _____ % |
| 总计 | 100% |

| 解释性说明 | |
|--------|---|
| 指标的目的 | <p>根据 PRI 原则 1，签署方承诺将 ESG 因素纳入投资分析和决策过程。通过该指标，签署方可说明不同的 ESG 纳入方法对其上市股权资产的适用范围。签署方的答复将决定其在报告框架的后续阶段会看到哪些指标。</p> <p>通过该指标收集的汇总数据也可能用于分析目的，并用于 PRI 的公共传播，包括制定签署方指南、报告和/或其他产出。</p> |
| 补充报告指引 | <p>将 ESG 因素纳入投资实践可采取三种方法：整合、筛选和主题。投资者可根据期望的结果（例如改善风险-回报状况、规避特定行业或推动资本支持特定环境和/或社会目标的实现），在这些方法中进行选择或组合。</p> <p>在本指标中，“仅”意为不结合任何其他策略。</p> <p>如果两种策略应用于同一资产，应选择相应的组合选项。例如“筛选”仅适用于 5% 的上市股权资产，而“筛选和整合”适用于其余资产，则对这 5% 应报告“仅筛选”，而其余 95% 的资产应报告“筛选和整合”。</p> |
| 其他资源 | 更多指引，请参见 负责任投资简介：上市股权 和 负责任投资简介：筛选 。 |
| 逻辑 | |
| 基于 | [OO 11] |
| 指向 | [OO 17.1LE]、[LE 12] |
| 评估 | |
| 评估标准 | 不纳入评估 |

| | | | | | |
|----------------------------|-----|-----------------|-------------------|--------------------|-------------------|
| 指标 ID OO 17.1 LE | 基于: | OO 17 LE | 分节 上市股权 | PRI 原则 1 | 指标类型 核心 |
| | 指向: | LE 9 | | | |

若采用了筛选方法，贵机构对内部管理的主动型上市股权资产使用何种筛选方式？

百分比数字可四舍五入到最近的 5%。

| | |
|----------------|----------------------------|
| | 在贵机构的所有上市股权资产中，采用筛选方法的百分比： |
| (A) 仅正面/最优筛选 | _____ % |
| (B) 仅负面筛选 | _____ % |
| (C) 综合使用多种筛选方法 | _____ % |
| 总计 | 100% |

解释性说明

| | |
|-------|--|
| 指标的目的 | 根据 PRI 原则 1，签署方承诺将 ESG 因素纳入投资分析和决策过程。通过该指标，签署方可说明不同的筛选方法对其上市股权资产的适用范围。签署方的答复将决定其在报告框架的后续阶段会看到哪些指标。 通过该指标收集的汇总数据也可能用于分析目的，并用于 PRI 的公共传播，包括制定签署方指南、报告和/或其他产出。 |
| 其他资源 | 更多指引，请参见 负责任投资简介：上市股权 和 负责任投资简介：筛选 。 |

逻辑

| | |
|----|------------|
| 基于 | [OO 17 LE] |
| 指向 | [LE 9] |

| 评估 | |
|------|-------|
| 评估标准 | 不纳入评估 |

固定收益[OO 17 FI、 OO 17.1 FI]

| | | | | | |
|--------------------------|-----|--------------------------------|------------|-------------|------------|
| 指标 ID OO 17 FI | 基于: | OO 5.3 FI、 OO 11 | 分节 固定收益 | PRI 原则 1 | 指标类型 核心 |
| | 指向: | OO 17.1 FI、 OO 20、 FI 16-18 | | | |

在内部管理的主动型固定收益资产中，贵机构采用了哪种 ESG 纳入方法和/或多种方法的结合？

百分比数字可四舍五入到最近的 5%。

| | (1) 固定收益—主权、超国家或机构债券 | (2) 固定收益—公司债券 | (3) 固定收益—资产证券化 |
|------------|----------------------|---------------|----------------|
| (A) 仅筛选 | _____ % | _____ % | _____ % |
| (B) 仅主题 | _____ % | _____ % | _____ % |
| (C) 仅整合 | _____ % | _____ % | _____ % |
| (D) 筛选和整合 | _____ % | _____ % | _____ % |
| (E) 主题和整合 | _____ % | _____ % | _____ % |
| (F) 筛选和主题 | _____ % | _____ % | _____ % |
| (G) 三种方法结合 | _____ % | _____ % | _____ % |

| | | | |
|-------|--------------|--------------|--------------|
| (H) 无 | _____ % | _____ % | _____ % |
| 总计 | 100 % | 100 % | 100 % |

解释性说明

| | |
|---------------|---|
| 指标的目的 | <p>根据 PRI 原则 1，签署方承诺将 ESG 因素纳入投资分析和决策过程。通过该指标，签署方可说明不同的 ESG 纳入方法对其固定收益资产的适用范围。签署方的答复将决定其在报告框架的后续阶段会看到哪些指标。</p> <p>通过该指标收集的汇总数据也可能用于分析目的，并用于 PRI 的公共传播，包括制定签署方指南、报告和/或其他产出。</p> |
| 补充报告指引 | <p>将 ESG 因素纳入投资实践可采取三种方法：整合、筛选和主题。投资者可根据期望的结果（例如改善风险-回报状况、规避特定行业或推动资本支持特定环境和/或社会目标的实现），在这些方法中进行选择或组合。</p> <p>在本指标中，“仅”意为不结合任何其他策略。</p> <p>如果两种策略应用于同一资产，应选择相应的组合选项。例如“筛选”仅适用于 5% 的固定收益资产，而“筛选和整合”适用于其余资产，则对这 5% 应报告“仅筛选”，而其余 95% 的资产应报告“筛选和整合”。</p> |
| 其他资源 | <p>更多指引，请参见负责任投资简介：固定收益和负责任投资简介：筛选。</p> |

逻辑

| | |
|-----------|---|
| 基于 | [OO 5.3 FI]、[OO 11] |
| 指向 | [OO 17.1 FI]、[OO 20]、[FI 16]、[FI 17]、[FI 18]、[SO 7] |

评估

| | |
|-------------|-------|
| 评估标准 | 不纳入评估 |
|-------------|-------|

| | | | | | |
|----------------------------|-----|-----------------|-------------------|--------------------|-------------------|
| 指标 ID OO 17.1 FI | 基于: | OO 17 FI | 分节 固定收益 | PRI 原则 1 | 指标类型 核心 |
| | 指向: | 不适用 | | | |

若采用了筛选方法，贵机构对内部管理的主动型固定收益资产使用何种筛选方式？

百分比数字可四舍五入到最近的 5%。

| | 在贵机构的所有固定收益资产中，采用筛选方法的百分比： | | |
|----------------|----------------------------|---------------|----------------|
| | (1) 固定收益—主权、超国家或机构债券 | (2) 固定收益—公司债券 | (3) 固定收益—资产证券化 |
| (A) 仅正面/最优筛选 | _____ % | _____ % | _____ % |
| (B) 仅负面筛选 | _____ % | _____ % | _____ % |
| (C) 综合使用多种筛选方法 | _____ % | _____ % | _____ % |
| 总计 | 100 % | 100 % | 100 % |

解释性说明

| | |
|-------|--|
| 指标的目的 | 根据 PRI 原则 1，签署方承诺将 ESG 因素纳入投资分析和决策过程。通过该指标，签署方可说明不同的筛选方法对其固定收益资产的适用范围。通过该指标收集的汇总数据也可能用于分析目的，并用于 PRI 的公共传播，包括制定签署方指南、报告和/或其他产出。 |
| 其他资源 | 更多指引，请参见 负责任投资简介：固定收益 和 负责任投资简介：筛选 。 |

逻辑

| | |
|------|------------|
| 基于 | [OO 17 FI] |
| 指向 | 不适用 |
| 评估 | |
| 评估标准 | 不纳入评估 |

ESG/可持续发展基金和产品

贴标和营销[OO 18、OO 18.1、OO 18.2]

| 指标 ID | 基于: | OO 11-14 | 分节 | PRI 原则 | 指标类型 |
|---|-----|----------|---|--------|------|
| OO 18 | 指向: | OO 18.1 | 贴标和营销 | 1 | 核心 |
| 贵机构是否明确地将任何产品和/或基金冠以 ESG 和/或可持续性进行营销? | | | | | |
| <input type="radio"/> (A) 是，我们在产品和/或基金的营销中冠以 ESG 和/或可持续性的名称 | | | 请提供贵机构冠名 ESG 和/或可持续性的产品或基金占 AUM 的百分比： 百分比数字可四舍五入到最近的 5%，并应为内部和外部管理的资产之和。 _____% | | |
| <input type="radio"/> (B) 否，我们在产品和/或基金的营销中，未明确冠以 ESG 和/或可持续性的名称 | | | | | |
| <input type="radio"/> (C) 不适用：我们不提供产品或基金 | | | | | |
| 其他信息：_____ [选填自由文本：中] | | | | | |

解释性说明

指标的目的

本指标用于关口指向和对标目的，并为签署方的后续答复提供背景信息。对本指标的答复将帮助 PRI 更好地了解 ESG 和/或可持续发展产品和基金市场，以便未来分析。对于签署方是否将产品和/或基金冠名 ESG 和/或可持续性进行营销，或这些产品和/或基金的占比，不作价值判断。答复也不会用于评估。

| | |
|---------------|--|
| 补充报告指引 | <p>报告的百分比应包括以 ESG 和/或可持续性的名称进行营销的基金或产品以及任何经 ESG 和/或 RI 认证或贴标的资产，并根据 AUM 总额计算，包括内部和外部管理的资产。</p> <p>以 ESG 和/或可持续性的名称进行营销的产品和基金可包括促进环境或社会特征的产品，或根据欧盟《可持续金融披露条例》（关于金融服务部门可持续性相关披露的条例（欧盟）2019/2088）第 8 条和第 9 条以可持续投资为目标的产品。</p> <p>为确定产品/基金是否拥有 ESG 和/或 RI 认证或标签，签署方应考虑产品或基金的 ESG 和/或可持续性标准，以及这些产品或基金的管理过程是否通过外部程序验证。此外，授予标签或认证的实体必须是独立的第三方行业组织，或有权代表独立组织授予标签的公司。</p> |
| 逻辑 | |
| 基于 | [OO 11]、[OO 12]、[OO 13]、[OO 14] |
| 指向 | [OO18.1] |
| 评估 | |
| 评估标准 | 不纳入评估 |

| 指标 ID | 基于: | OO 18 | 分节 | PRI 原则 | 指标类型 |
|---|-----|--|-------|--------|------|
| OO 18.1 | 指向: | OO 18.2 | 贴标和营销 | 1 | 核心 |
| <p>贵机构对于以 ESG 和/或可持续性的名称进行营销的产品和/或基金，是否拥有第三方授予的正式 ESG 和/或 RI 认证或标签？</p> | | | | | |
| <p><input type="radio"/> (A) 是，我们以 ESG 和/或可持续性的名称进行营销的产品和/或基金拥有正式标签或认证</p> | | <p>请提供贵机构获得标签和/或认证的产品和/或基金占 AUM 的百分比。 百分比数字可四舍五入到最近的 5%，并应为内部和外部管理的资产之和。 _____ %</p> | | | |
| <p><input type="radio"/> (B) 否，我们以 ESG 和/或可持续性的名称进行营销的产品和/或基金未获得正式标签或认证</p> | | | | | |

| 解释性说明 | |
|--------|---|
| 指标的目的 | <p>本指标用于关口指向和对标目的，并为签署方的后续答复提供背景信息。对本指标的答复将帮助 PRI 更好地了解 ESG 和 RI 标签和认证市场，以便未来分析。</p> <p>对于签署方是否拥有正式 ESG 和/或 RI 标签或认证，或这些标签或认证所覆盖的产品和/或基金的百分比，不作价值判断。答复也不会用于评估。</p> |
| 补充报告指引 | <p>在本指标中，报告的百分比应根据 AUM 总额计算，包括内部和外部管理的资产。</p> <p>具有环境或社会特征的产品和基金，或根据欧盟《可持续金融披露条例》（关于金融服务部门可持续性相关披露的条例（欧盟）2019/2088）第 8 条和第 9 条，以可持续投资为目标的产品和基金不应视为有标签或认证。报告 OO18.1 时将排除这些产品和基金，除非拥有第三方授予的正式 ESG 和/或 RI 认证或标签。</p> <p>为确定产品/基金是否拥有 ESG 和/或 RI 认证或标签，签署方应考虑产品或基金的 ESG 和/或可持续性标准，以及这些产品或基金的管理过程是否通过外部程序验证。此外，授予标签或认证的实体必须是独立的第三方行业组织，或有权代表独立组织授予标签的公司。</p> |
| 逻辑 | |
| 基于 | [OO 18] |

| | |
|------|----------|
| 指向 | [OO18.2] |
| 评估 | |
| 评估标准 | 不纳入评估 |

| | | | | | |
|-------------------------|-----|----------------|--------------------|--------------------|-------------------|
| 指标 ID OO 18.2 | 基于: | OO 18.1 | 分节 贴标和营销 | PRI 原则 1 | 指标类型 核心 |
| | 指向: | 不适用 | | | |

贵机构持有哪些 **ESG/RI 认证或标签**?

选择所有适用项。

- (A) 商品类型标签 (如 BCI)
- (B) GRESB
- (C) 奥地利生态标签 (UZ49)
- (D) B 类公司
- (E) BREEAM
- (F) CBI 气候债券标准
- (G) DDV-Nachhaltigkeitskodex-ESG-Strategie
- (H) DDV-Nachhaltigkeitskodex-ESG-Impact
- (I) 欧盟生态标签
- (J) 欧盟绿色债券标准
- (K) Febelfin 标签 (比利时)
- (L) Finansol
- (M) FNG-Siegel 生态标签 (德国、奥地利和瑞士)
- (N) Greenfin 标签 (法国)
- (O) Grüner Pfandbrief
- (P) ICMA 绿色债券原则
- (Q) ICMA 社会债券原则
- (R) ICMA 可持续性债券原则
- (S) ICMA 可持续性关联债券原则
- (T) Kein Verstoß gegen Atomwaffensperrvertrag
- (U) Le label ISR (法国政府 SRI 标签)
- (V) Luxflag 气候融资

- (W) Luxflag 环境
- (X) Luxflag ESG
- (Y) Luxflag 绿色债券
- (Z) Luxflag 小额信贷
- (AA) Luxflag 可持续保险产品
- (AB) 国家/地区尽责管理法规
请说明：____ [必填自由文本：小]
- (AC) 北欧天鹅生态标签
- (AD) 基于 EUROSIF 《SRI 透明管理守则》的其他 SRI 标签（如 Novethic）
请说明：____ [必填自由文本：小]
- (AE) 中国人民银行绿色债券指南
- (AF) RIAA（澳大利亚）
- (AG) 迈向可持续发展标签（比利时）
- (AH) 其他
请说明：____ [必填自由文本：小]

解释性说明

| | |
|---------------|---|
| 指标的目的 | 该指标旨在说明签署方持有哪些认证或标签。PRI 对所有 ESG 标签同等看待。 |
| 补充报告指引 | <p>国家/地区性尽责管理守则包括（但不限于）：</p> <ul style="list-style-type: none"> • 欧盟：《EFAMA 尽责管理守则》，欧洲基金与资产管理协会，2018 年 • 德国：《德国尽责管理准则》，DVFA，2020 年 • 荷兰：《荷兰尽责管理守则》，Eumedion，2018 年 • 新加坡：《新加坡尽责管理原则》，亚洲尽责管理研究院，2016 年 • 瑞士：《机构投资者准则：在上市有限公司中行使参与权的治理》，Ethos 基金会，2013 年 • 台湾：《机构投资者尽责管理原则》，台湾证券交易所，2016 年 • 英国：《英国尽责管理守则》，金融报告委员会，2019 年 • 美国：《美国机构投资者尽责管理框架》，投资者尽责管理组织，2018 年 • 日本：《日本尽责管理守则》，FSA，2020 年 |

| | |
|------|---|
| | <ul style="list-style-type: none"> • 香港：《香港负责任的所有权原则》，证券及期货事务监察委员会 • 挪威：《挪威尽责管理守则》，挪威基金和市场协会，2012年 • 意大利：《意大利对上市公司行使管理权和投票权的尽责管理守则》 • 瑞典：《基金管理公司股东参与准则》，瑞典投资基金协会 2002年2月发布，2019年5月修订 • Eurosif《欧洲透明管理守则》 • 法国：《AFEP-MEDEF 公司治理守则》 |
| 其他资源 | <p>请参见 PRI 法规数据库，了解 ESG/RI 标签和/或认证相关法规的更多详情。</p> <p>所列 ESG/RI 认证或标签链接：</p> <ul style="list-style-type: none"> GRESB Austrian Ecolabel B Corporation BREEAM CBI Climate Bonds Standard DDV-Nachhaltigkeitskodex EU Ecolabel EU Green Bond Standard Febelfin Finansol FNG-Siegel Greenfin Grüner Pfandbrief ICMA Green Bond Principles ICMA's Social Bond Principles ICMA's Sustainability Bond Guidelines ICMA's Sustainability-Linked Bond Principles Le label ISR Luxflag Climate Finance Luxflag Environment Luxflag ESG Luxflag Green Bond Luxflag Microfinance Luxflag Sustainable Insurance Products Nordic Swan Ecolabel People's Bank of China green bond guidelines |

| | |
|------|--------------------------------|
| | RIAA Towards Sustainability |
| 逻辑 | |
| 基于 | [OO18.1] |
| 指向 | 不适用 |
| 评估 | |
| 评估标准 | 不纳入评估 |

被动投资[OO 19]

| 指标 ID OO 19 | 基于: | OO 5.3 FI、OO 11 | 分节 被动投资 | PRI 原则 1 | 指标类型 核心 |
|--|-----|------------------------|------------------------------|--------------------|-------------------|
| | 指向: | LE 8、FI 10 | | | |
| <p>贵机构的所有内部管理的被动型上市股权和/或固定收益被动管理的 AUM 中，使用 ESG 指数或基准的比例是？</p> <p>百分比数字可四舍五入到最近的 5%。</p> | | | | | |
| | | | AUM 中使用 ESG 指数或基准的比例： | | |
| (A) 上市股权—被动 | | | _____% | | |
| (B) 固定收益—被动 | | | _____% | | |

| 解释性说明 | |
|---------------|---|
| 指标的目的 | 本指标旨在评估签署方的被动型上市股权和固定收益资产中，使用 ESG 指数作为参考或基准以衡量回报并构建投资组合的程度。签署方的答复将决定其在报告框架的后续阶段会看到哪些指标。 通过该指标收集的汇总数据也可能用于分析目的，并用于 PRI 的公共传播，包括制定签署方指南、报告和/或其他产出。 |
| 补充报告指引 | 被动投资中使用的 ESG 指数或基准可以是外部的，也可以是签署方采用 ESG 筛选标准制定的。 本指标不适用于私募债或资产证券化债务。 |
| 其他资源 | 关于被动投资者纳入 ESG 因素的进一步指导，请参见 被动投资者如何成为负责任的投资者？ |
| 逻辑 | |
| 基于 | [OO 5.3 FI]、[OO 11] |

| | |
|------|----------------|
| 指向 | [LE 8]、[FI 10] |
| 评估 | |
| 评估标准 | 不纳入评估 |

主题债券[OO 20]

| 指标 ID OO 20 | 基于: | OO 17 FI | 分节 主题债券 | PRI 原则 1 | 指标类型 核心 |
|---|-----|--------------------|--------------------------------|--------------------|-------------------|
| | 指向: | FI 15、FI 17 | | | |
| <p>在贵机构的所有环境和/或社会主题债券中，由发行人根据行业公认标准贴标的比例？</p> <p>见“参考其他标准”，了解行业公认标准列表（非详尽）。</p> | | | | | |
| | | | 贵机构的所有环境和/或社会主题债券中，由发行人贴标的百分比： | | |
| (A) 绿色或气候债券 | | | _____ % | | |
| (B) 社会债券 | | | _____ % | | |
| (C) 可持续发展债券 | | | _____ % | | |
| (D) 可持续发展挂钩债券 | | | _____ % | | |
| (E) SDG 或 SDG 挂钩债券 | | | _____ % | | |
| (F) 其他 请说明：_____ [必填文本：小] | | | _____ % | | |
| (G) 未由发行人贴标的债券 | | | _____ % | | |

| | |
|----|------|
| 总计 | 100% |
|----|------|

| 解释性说明 | |
|--------|--|
| 指标的目的 | 本指标旨在评估签署方的主题产品中符合公认 ESG 和/或 SDG 债券标准的比例。签署方的答复将决定其在报告框架的后续阶段会看到哪些指标。通过该指标收集的汇总数据也可能用于分析目的，并用于 PRI 的公共传播，包括制定签署方指南、报告和/或其他产出。 |
| 补充报告指引 | 本指标针对的是投资于环境和/或社会债券的投资者，而不是潜在的债券发行人。 本指标仅适用于主动型固定收益资产。 |
| 参考其他标准 | <p>国际债券标准：</p> <p>CBI 气候债券标准</p> <p>ICMA 绿色债券原则</p> <p>ICMA 社会债券原则</p> <p>ICMA 可持续发展债券指南</p> <p>ICMA 可持续发展挂钩债券原则</p> <p>联合国开发计划署为债券发行人制定的 SDG 影响标准</p> <p>区域债券标准：</p> <p>东盟债券标准</p> <p>奥地利生态标签 (UZ49)</p> <p>欧盟绿色债券标准</p> <p>Febelfin</p> <p>FNG-Siegel</p> <p>Greenfin</p> <p>Le label ISR</p> <p>Luxflag 绿色债券</p> <p>北欧天鹅生态标签</p> <p>中国人民银行绿色债券指南</p> <p>RIAA</p> <p>迈向可持续发展</p> |

| | |
|-------|-----------------|
| 逻辑 | |
| 基于 | [OO 17 FI] |
| 指向 | [FI 15]、[FI 17] |
| 评估 | |
| 不纳入评估 | |

报告要求摘要

报告要求摘要[OO 21]

| | | | | | |
|-------|-----|------|--------|--------|------|
| 指标 ID | 基于: | 多个指标 | 分节 | PRI 原则 | 指标类型 |
| OO 21 | 指向: | 多个指标 | 报告要求摘要 | 通用 | 核心 |

下表显示了在 PRI 各资产类别模块中，哪些模块是强制报告，哪些是自愿报告。如果某个模块属自愿报告，请说明贵机构是否有意报告该模块。

见“解释性说明——补充报告要求”，了解强制或自愿报告模块的详情。

| 适用模块 | (1) 强制报告 | (2) 自愿报告 | |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| | (根据先前答复预填充) | (2.1) 是，本机构选择报告该模块 | (2.2) 否，本机构选择不报告该模块 |
| 政策、治理和战略 | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> |
| 信心建立措施 | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> |
| (A) 上市股权—被动 | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> |
| (B) 上市股权—主动—量化 | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> |
| (C) 上市股权—主动—基本面 | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> |

| | | | |
|-----------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| (D) 上市股权—其他策略 | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> |
| (E) 固定收益—主权、超国家或机构债券 | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> |
| (F) 固定收益—公司债券 | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> |
| (G) 固定收益—资产证券化 | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> |
| (H) 固定收益—私募债 | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> |
| (I) 私募股权 | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> |
| (J) 房地产 | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> |
| (K) 基础设施 | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> |
| (L) 对冲基金—多策略 | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> |
| (M) 对冲基金—多/空股票 | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> |
| (N) 对冲基金—多/空信贷 | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> |
| (O) 对冲基金—不良资产、特殊机会和事件驱动的基本面 | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> |

| | | | |
|--------------------------------|---|---|---|
| (P) 对冲基金—结构性信贷 | ○ | ○ | ○ |
| (Q) 对冲基金—全球宏观 | ○ | ○ | ○ |
| (R) 对冲基金—大宗商品交易顾问 | ○ | ○ | ○ |
| (S) 对冲基金—其他策略 | ○ | ○ | ○ |
| (T) 外部管理人遴选、委任和监督(SAM)—上市股权—主动 | ○ | ○ | ○ |
| (U) 外部管理人遴选、委任和监督(SAM)—上市股权—被动 | ○ | ○ | ○ |
| (V) 外部管理人遴选、委任和监督(SAM)—固定收益—主动 | ○ | ○ | ○ |
| (W) 外部管理人遴选、委任和监督(SAM)—固定收益—被动 | ○ | ○ | ○ |
| (X) 外部管理人遴选、委任和监督(SAM)—私募股权 | ○ | ○ | ○ |
| (Y) 外部管理人遴选、委任和监督(SAM)—房地产 | ○ | ○ | ○ |
| (Z) 外部管理人遴选、委任和监督(SAM)—基础设施 | ○ | ○ | ○ |
| (AA) 外部管理人遴选、委任和监督(SAM)—对冲基金 | ○ | ○ | ○ |

| 解释性说明 | |
|--------|--|
| 指标的目的 | <p>签署方只需报告在相关报告年度中占 AUM 10%及以上或金额达 100 亿美元及以上的內部或外部管理资产类别。通过该指标，签署方可选择是否自愿报告未达 AUM 门槛的模块或资产类别。</p> <p>通过本指标，签署方可报告以下模块：(i) 签署方持有（无论内部或外部管理）但未达到上述 AUM 门槛的资产类别，及 (ii) 签署方先前未说明的没有纳入 ESG 因素的模块。</p> |
| 补充报告指引 | <p>自愿报告</p> <p>如果签署方在某一资产类别中的 AUM 总额低于 10%，且该资产类别的规模少于 100 亿美元，签署方可自愿在该资产类别模块中报告。</p> <p>如果签署方通过外部管理人间接管理资产，同样的资产类别门槛也适用，但签署方可选择是否在外部投资管理人遴选、委任和监督(SAM)模块中报告。</p> <p>如果签署方表示有意自愿报告某一模块和/或资产类别，需在相应模块下答复所有“核心”指标。</p> <p>强制报告</p> <p>1.如果签署方在某一资产类别中的 AUM 总额达到或超过 10%，则必须在该资产类别模块中提交报告。</p> <p>2.如果签署方在某一资产类别中的 AUM 总额低于 10%，且该资产类别的规模为 100 亿美元或以上，则必须在该资产类别模块中提交报告。</p> <p>如果签署方通过外部管理人间接管理资产，同样的资产类别门槛也适用，但签署方必须在外部投资管理人遴选、委任和监督(SAM)模块中报告。</p> <p>资产所有者报告</p> <p>从 2023 年起，资产所有者签署方只需报告政策、治理和战略(PGS)模块、外部投资管理人遴选、委任和监督 (SAM) 模块中的适用资产类别以及信心建立措施 (CBM) 模块。</p> <p>签署方报告通过服务商或内部员工对外部管理资产的尽责管理活动</p> <p>以下内容适用于：在某一资产类别仅拥有外部管理的资产但直接（即通过服务商或内部员工）对这些资产部分或完全行使投票权和/或参与权的签署方。此类直接尽责管理活动应通过 PGS 模块中的尽责管理指标报告。</p> |
| 逻辑 | |
| 基于 | [OO 5]、[OO 5.1]、[OO 5.3 LE]、[OO 5.3 FI]、[OO 5.3 HF]、[OO 8]、[OO 9]、[OO 11]、[OO 12]、[OO 13]、[OO 14] |
| 指向 | SAM 模块逻辑： 所有指标 |

| | |
|-----------|---|
| | <p>LE 模块逻辑: 所有指标</p> <p>FI 模块逻辑: 所有指标</p> <p>PE 模块逻辑: 所有指标</p> <p>RE 模块逻辑: 所有指标</p> <p>INF 模块逻辑: 所有指标</p> <p>HF 模块逻辑: 所有指标</p> <p>CBMs 模块逻辑: [CBM 2]、[CBM 4]</p> |
| 评估 | |
| 评估标准 | 不纳入评估 |

其他资产明细分类

私募股权：板块[OO 22]

| 指标 ID | 基于: | OO 21 | 分节 | PRI 原则 | 指标类型 |
|-------|-----|-------|---------|--------|------|
| OO 22 | 指向: | 不适用 | 私募股权：板块 | 通用 | 核心 |

贵机构内部管理的私募股权投资投资于哪些板块？

- (A) 能源
- (B) 材料
- (C) 工业
- (D) 非必需消费品
- (E) 必需消费品
- (F) 医疗保健
- (G) 金融
- (H) 信息技术
- (I) 电信服务
- (J) 公用事业
- (K) 房地产

解释性说明

| | |
|--------|---|
| 指标的目的 | 本指标用于对标目的，并为签署方的后续答复提供背景信息。 通过该指标收集的汇总数据也可能用于分析目的，并用于 PRI 的公共传播，包括制定签署方指南、报告和/或其他产出。 |
| 补充报告指引 | 本指标中列出的板块大致是基于 MSCI《全球行业分类标准》。由于板块均已详尽列出，我们在此未列“其他”选项。 |

| | |
|------|---------|
| 逻辑 | |
| 基于 | [OO 21] |
| 指向 | 不适用 |
| 评估 | |
| 评估标准 | 不纳入评估 |

私募股权：所有权比例[OO 23]

| 指标 ID | 基于: | OO 21 | 分节 | PRI 原则 | 指标类型 |
|---|-----|-------|---|--------|------|
| OO 23 | 指向: | 不适用 | 私募股权：所有权比例 | 通用 | 核心 |
| <p>贵机构内部管理的私募股权投资</p> <p>投资的百分比明细，按所有权比例划分</p> <p>在计算百分比明细时，应基于投资组合公司的数量。</p> | | | | | |
| <input type="checkbox"/> (A) 多数股权（超过 50%） | | | [下拉式清单] (1) >0 至 10% (2) >10 至 50% (3) >50 至 75% (4) >75% | | |
| <input type="checkbox"/> (B) 重要少数股权(10-50%) | | | [同上] | | |
| <input type="checkbox"/> (C) 有限少数股权（低于 10%） | | | [同上] | | |

| 解释性说明 | |
|--------|--|
| 指标的目的 | 本指标用于对标目的，并为签署方的后续答复提供背景信息。通过该指标，签署方和报告框架数据的使用者还可按照投资者的影响程度来筛选负责任投资方法。 |
| 补充报告指引 | <p>在该指标中，“多数股权”指所有权占 50%以上。</p> <p>在该指标中，“重要少数股权”指所有权占 10%至 50%。</p> |

| | |
|-------------|----------------------------|
| | 在该指标中，“有限少数股权”指所有权占 10%以下。 |
| 逻辑 | |
| 基于 | [OO 21] |
| 指向 | 不适用 |
| 评估 | |
| 评估标准 | 不纳入评估 |

房地产：建筑类型[OO 24]

| 指标 ID | 基于: | OO 21 | 分节 | PRI 原则 | 指标类型 |
|-------|-----|----------------|----------|--------|------|
| OO 24 | 指向: | RE 1、RE 9 - 10 | 房地产：建筑类型 | 通用 | 核心 |

贵机构实体**房地产**资产的**建筑类型**是什么？

本指标指贵机构**内部管理的**房地产 **AUM** 资产，如[OO 5]中所述。

- (A) 长期房地产投资
- (B) 新建项目
- (C) 重大翻新

解释性说明

| | |
|-----------|---|
| 指标的目的 | 一项房地产资产是长期房地产投资，还是最近完成的翻新建筑，或近期有过重大翻新的建筑，都会影响其可持续性。签署方的答复将决定其在报告框架的后续阶段会看到哪些指标。通过该指标收集的汇总数据也可能用于分析目的，并用于 PRI 的公共传播，包括制定签署方指南、报告和/或其他产出。 |
| 参考其他标准 | GRESB: 2022 年房地产参考指南：实体与报告特征—实体业务的性质：RC5 |
| 逻辑 | |
| 基于 | [OO 21] |
| 指向 | [RE 1]、[RE 9]、[RE 10] |
| 评估 | |
| 评估标准 | 不纳入评估 |

房地产：所有权比例[OO 25]

| 指标 ID | 基于: | OO 21 | 分节 | PRI 原则 | 指标类型 |
|-------|-----|-------|-----------|--------|------|
| OO 25 | 指向: | 不适用 | 房地产：所有权水平 | 通用 | 核心 |

贵机构的实体**房地产**资产的百分比明细，按所有权比例划分

在计算百分比明细时，应基于实体房地产资产的数量。本指标指责机构**内部管理的**房地产 **AUM** 资产，如[OO 5]中所述。

| | |
|---|---|
| <input type="checkbox"/> (A) 多数股权（超过 50%） | [下拉式清单] (1) >0 至 10% (2) >10 至 50% (3) >50 至 75% (4) >75% |
| <input type="checkbox"/> (B) 重要少数股权(10-50%) | [同上] |
| <input type="checkbox"/> (C) 有限少数股权（低于 10%） | [同上] |

解释性说明

| | |
|--------|---|
| 指标的目的 | 本指标用于对标目的，并为签署方的后续答复提供背景信息。通过该指标，签署方和报告框架数据的使用者还可按照投资者的影响程度来筛选负责任投资方法。 |
| 补充报告指引 | 在该指标中，“多数股权”指所有权占 50%以上。 在该指标中，“重要少数股权”指所有权占 10%至 50%。 在该指标中，“有限少数股权”指所有权占 10%以下。 |

| | |
|------|---------|
| 逻辑 | |
| 基于 | [OO 21] |
| 指向 | 不适用 |
| 评估 | |
| 评估标准 | 不纳入评估 |

房地产：管理类型[OO 26]

| 指标 ID | 基于: | OO 21 | 分节 | PRI 原则 | 指标类型 |
|-------|-----|-------------------|----------|--------|------|
| OO 26 | 指向: | RE 1、RE 6–8、RE 13 | 房地产：管理类型 | 通用 | 核心 |

谁负责管理贵机构的实体**房地产**资产？

本指标指贵机构**内部管理的**房地产 **AUM** 资产，如[OO 5]中所述。

- (A) 由本机构直接管理
- (B) 本机构委任的**第三方物业管理人**
- (C) 其他投资者或其**第三方物业管理人**
- (D) 拥有运营控制权的承租人

解释性说明

| | |
|--------|--|
| 指标的目的 | 对于理解投资者影响资产管理的潜力和责任，房地产资产的管理类型十分重要。签署方的答复将决定其在报告框架的后续阶段会看到哪些指标。通过该指标收集的汇总数据也可能用于分析目的，并用于 PRI 的公共传播，包括制定签署方指南、报告和/或其他产出。 |
| 补充报告指引 | “管理的直接实体房地产资产”指拥有运营控制权的签署方所管理的房地产资产。 在本指标中，“承租人”指占用房屋、办公室、工业区或类似场所的个人或团体。 如果一个或多个承租人拥有采取和实施运营及环境政策的最主要权限，应视之为拥有运营控制权，并选择“拥有运营控制权的承租人”。如果签署方和承租人都拥有采取和实施日常运营程序，应选择“由本机构直接管理”。 |
| 逻辑 | |
| 基于 | [OO 21] |
| 指向 | [RE 1]、[RE 6]、[RE 7]、[RE 8]、[RE 13] |

评估

| | |
|------|-------|
| 评估标准 | 不纳入评估 |
|------|-------|

基础设施：所有权比例[OO 27]

| 指标 ID | 基于: | OO 21 | 分节 | PRI 原则 | 指标类型 |
|-------|-----|-------|------------|--------|------|
| OO 27 | 指向: | 不适用 | 基础设施：所有权比例 | 通用 | 核心 |

贵机构的**基础设施**资产百分比明细，按所有权比例划分

在计算百分比明细时，应基于实体基础设施资产的数量。本指标指贵机构**内部管理的**基础设施 AUM 资产，如[OO 5]中所述。

| | |
|---|---|
| <input type="checkbox"/> (A) 多数股权（超过 50%） | [下拉式清单] (1) >0 至 10% (2) >10 至 50% (3) >50 至 75% (4) >75% |
| <input type="checkbox"/> (B) 重要少数股权(10-50%) | [同上] |
| <input type="checkbox"/> (C) 有限少数股权（低于 10%） | [同上] |

解释性说明

| | |
|--------|---|
| 指标的目的 | 本指标用于对标目的，并为签署方的后续答复提供背景信息。通过该指标，签署方和报告框架数据的使用者还可按照投资者的影响程度来筛选负责任投资方法。 |
| 补充报告指引 | 在该指标中，“多数股权”指所有权占 50%以上。 在该指标中，“重要少数股权”指所有权占 10%至 50%。 在该指标中，“有限少数股权”指所有权占 10%以下。 |

| | |
|------|---------|
| 逻辑 | |
| 基于 | [OO 21] |
| 指向 | 不适用 |
| 评估 | |
| 评估标准 | 不纳入评估 |

基础设施：策略[OO 28]

| 指标 ID | 基于: | OO 21 | 分节 | PRI 原则 | 指标类型 |
|-------|-----|-------|---------|--------|------|
| OO 28 | 指向: | 不适用 | 基础设施：策略 | 通用 | 核心 |

贵机构对**基础设施**资产的投资策略是什么？

本指标指贵机构**内部管理**的基础设施 **AUM** 资产，如[OO 5]中所述。

- (A) 核心型
- (B) 价值增值型
- (C) 机会型
- (D) 其他

请说明：_____ [必填文本：小]

解释性说明

| | |
|--------|---|
| 指标的目的 | 本指标用于对标目的，并为签署方的后续答复提供背景信息。 通过该指标收集的汇总数据也可能用于分析目的，并用于 PRI 的公共传播，包括制定签署方指南、报告和/或其他产出。 |
| 补充报告指引 | <p>“核心型”、“价值增值型”和“机会型”是基础设施投资者常常使用的投资风险和回报分类，与 GRESB 保持一致。</p> <p>“核心型”指投资于运营风险有限的核心资产和通常已经创造收入之资产的策略。这些资产一般是监管和政治环境较透明的发达国家的二级资产。标的资产的主要特征包括垄断地位，需求明确，现金流长期稳定、可预测且误差小。</p> <p>“价值增值型”指投资于需要提升之资产的中高风险策略，重点是增加资产的资本价值。这类资产可能是绿地或棕地资产，涉及新技术或未经证实的技术，在投资时尚无定价权。</p> <p>“机会型”指风险/回报特征更高的策略。例如资产可能位于新兴市场，正在开发或需要大量资金周转。相对于产生稳定现金流，此类策略更注重透过标的资产的价值实现资本增长。</p> |
| 参考其他标准 | GRESB: 2022 年基础设施基金评估参考指南 ：实体和报告特征—所有权性质； EC2 |

| | |
|------|---------|
| 逻辑 | |
| 基于 | [OO 21] |
| 指向 | 不适用 |
| 评估 | |
| 评估标准 | 不纳入评估 |

基础设施：资产类别[OO 29]

| 指标 ID | 基于： | OO 21 | 分节 基础设施：资产类别 | PRI 原则 通用 | 指标类型 核心 |
|-------|-----|-------|-----------------|--------------|------------|
| | 指向： | INF 1 | | | |

贵机构的**基础设施**的资产类型是什么？

本指标指贵机构**内部管理**的基础设施 **AUM** 资产，如[OO 5]中所述。

- (A) 绿地
- (B) 棕地

解释性说明

指标的目的

签署方的答复将决定其在报告框架的后续阶段会看到哪些指标。本指标也用于对标目的，并为签署方的后续答复提供背景信息。通过该指标收集的汇总数据也可能用于分析目的，并用于 **PRI** 的公共传播，包括制定签署方指南、报告和/或其他产出。

参考其他标准

GRESB：2022 年基础设施基金参考指南：实体和报告特征—实体的业务性质：RC4

逻辑

基于

[OO 21]

指向

[INF 1]

评估

评估标准

不纳入评估

基础设施：管理类型[OO 30]

| 指标 ID | 基于: | OO 21 | 分节 | PRI 原则 | 指标类型 |
|-------|-----|----------------------|-----------|--------|------|
| OO 30 | 指向: | INF 1、INF 6–8、INF 11 | 基础设施：管理类型 | 通用 | 核心 |

谁负责管理贵机构的**基础设施资产**？

本指标指贵机构**内部管理**的基础设施 **AUM** 资产，如[OO 5]中所述。

- (A) 由本机构直接管理
- (B) 本机构委任的**第三方基础设施运营商**
- (C) 其他投资者、基础设施公司或其第三方运营商
- (D) 公共或政府实体或其第三方运营商

解释性说明

指标的目的

签署方的答复将决定其在报告框架的后续阶段会看到哪些指标。本指标也用于对标目的，并为签署方的后续答复提供背景信息。通过该指标收集的汇总数据也可能用于分析目的，并用于 PRI 的公共传播，包括制定签署方指南、报告和/或其他产出。

补充报告指引

该指标仅适用于在基础设施资产中拥有股权的签署方。

- (i) “基础设施管理”：指基础设施资产的日常运营和决策执行，而不是指投资决策（如收购决策）。
- (ii) “由本机构直接管理”：指管理基础设施资产的内部团队，和/或对签署方拥有所有权的基础设施资产实施运营控制的公司。
- (iii) 由“本机构委任的第三方基础设施运营商”管理：指由签署方委任而非拥有的第三方运营商，其对签署方拥有所有权的基础设施资产自行配备管理人员和运营人员。
- (iv) 由“其他投资者、基础设施公司或其第三方运营商”管理：通常适用于签署方对基础设施资产拥有少数股权的情形。
- (v) 由“公共或政府实体或其第三方运营商”管理：指基础设施资产由公共合作投资者或支持者（如政府）或其委任的第三方组织管理。

这些解释与 GRESB 保持一致。

逻辑

| | |
|------|--|
| 基于 | [OO 21] |
| 指向 | [INF 1]、[INF 6]、[INF 7]、[INF 8]、[INF 10] |
| 评估 | |
| 评估标准 | 不纳入评估 |

提交信息

报告披露信息[OO 31、OO 32]

| 指标 ID | 基于: | 报告状态 | 分节 | PRI 原则 | 指标类型 |
|-------|-----|------|--------|--------|------|
| OO 31 | 指向: | 不适用 | 报告披露信息 | 通用 | 核心 |

贵机构当前处于自愿报告期，是否希望向公众公开这些答复？

- (A) 是，对于核心指标以及标明将公开的附加指标，公开所有答复
- (B) 否，今年我们的所有答复均不公开

解释性说明

| | |
|--------|--|
| 指标的目的 | 通过该指标，在成为 PRI 签署方的第一年（即自愿报告年度），可选择不在 PRI 网站上公开其答复。 |
| 补充报告指引 | PRI 签署方需每年公开报告其负责任投资活动。仅在自愿报告年度中进行自愿报告的签署方可选择不公开透明度报告。 |

逻辑

| | |
|----|-----|
| 基于 | 不适用 |
| 指向 | 不适用 |

评估

| | |
|------|-------|
| 评估标准 | 不纳入评估 |
|------|-------|

| | | | | | |
|-----------------------|-----|-------------------|--------------|--------------|-------------------|
| 指标 ID OO 32 | 基于: | OO 3、OO 31 | 分节 报告披露信息 | PRI 原则 通用 | 指标类型 核心 |
| | 指向: | 不适用 | | | |

对于在整个报告框架中报告的详细百分比数字，贵机构希望以何种形式表示？

关于这一设置将影响的指标，请参见“补充报告指引”。

- (A) 按绝对数公布
- (B) 按范围公布

解释性说明

| | |
|--------|---|
| 指标的目的 | 根据签署方在报告工具中的答复，将自动生成公开报告，包括在“核心”指标中报告的所有数据。通过该指标，签署方可选择在此等报告中以何种形式表示详细百分比数字。 |
| 补充报告指引 | 如果选择(B)，以下指标将按范围公布：[OO 5]、[OO 5.1]、[OO 5.2]、[OO 5.3 LE]、[OO 5.3 FI]、[OO 5.3 PE]、[OO 5.3 RE]、[OO 5.3 INF]、[OO 5.3 HF]、[OO 6]、[OO 17 LE]、[OO 17.1 LE]、[OO 17 FI]、[OO 17.1 FI]、[OO 18]、[OO 18.1]、[OO 19]、[OO 20]。 使用的范围是：0、>0-10%、>10-50%、>50-75%、>75%。 |

逻辑

| | |
|----|----------------|
| 基于 | [OO 3]、[OO 31] |
| 指向 | 不适用 |

评估

| | |
|------|-------|
| 评估标准 | 不纳入评估 |
|------|-------|