



## 中國平安資產管理（香港） 系統化、量化、科學化

中國平安資產管理（香港）是中國平安保險（集團）股份有限公司旗下主要的海外投資及資產管理平台，公司建基於系統化、量化、科學化（SQS）投資理念，提供全球市場股票、固定收益、ETF、結構化產品和另類投資等全方位投資管理解決方案，致力於建設下一代資本市場投資平臺，為客戶創造超越市場的回報。



### 海外需求 推動多元投資機遇

受到疫情及宏觀政策變動影響，2021年市場波動加劇。但因海外機構客戶對於中國優質資產需求的推動，公司的資產管理規模全年錄得顯著增長。

作為一家領先的中國資管公司，中國平安資產管理（香港）全方位的中國研究團隊和專長得到境外客戶的認可。2021年8月，木星資產管理委任公司管理旗下中國股票投資組合，這亦是木星資產管理第二隻委託公司管理的中國股票投資組合。

另外，公司於2020推出平安集團旗下首隻UCITS（可

轉讓證券集體投資計劃）系列基金，根據基金互認安排，2021年已獲得香港證券及期貨事務監察委員會認可，於香港公開發售。該系列基金的子基金涵蓋綠色債券、人工智能量化投資、高收益私募債券及新興市場債券等多種投資策略，各具獨特的投資目標，幫助投資者把握多元化投資機遇。

### 綠色投資 保護環境 減少碳足跡

作為中國ESG領域的領先企業，平安集團於2019年成為第一個簽署聯合國責任投資原則（UNPRI）的中國資產所

有者，並在2021年宣佈2030年達致運營碳中和的承諾。在「方式、控制、工具、應用」一體化的責任投資體系驅動下，平安集團將ESG充分融入各類資產配置和投資組合，2021年度，集團綠色投融資規模已達2245.8億元人民幣。作為平安ESG戰略在海外業務中的先行者，中國平安資產管理（香港）致力於在中國及海外推動綠色投資，減少碳足跡。

公司於2019年推出市場首隻中國綠色債券基金，並於2020年成為亞洲首個與氣候債券倡議組織（CBI）合作的中國資產管理人和機構投資者，採用其權威的綠色標準中國綠色債券評價和選擇分類法，基金在2021年《環境金融》可持續投資大獎中榮獲「ESG年度固定收益基金（亞洲）」獎項。截至2021年9月30日，該基金共投入了29個國家、623個綠色項目中，是公司長期致力於減碳及改善環境的其中一項舉措。

### 智能化投資流程 即時比對 ESG 資料

目前，公司已將ESG篩選融入人工智能量化投資流程。平安集團2020年推出自主研發的人工智能CN-ESG管理平台，幫助企業提升ESG管理並將ESG原則融入投資流程。CN-ESG數據體系依託平安在金融及科技方面的專長，數據體系運用多種技術，如網絡爬蟲、數據挖掘、機器學習、知識圖譜、自然語言處理（NLP）、衛星遙感等，對已披露ESG資料真實性進行比對驗證，同時挖掘未披露的另類數據，為客戶的投資提供豐富的資訊。

在集團平台的基礎上，中國平安資產管理（香港）在投資之中廣泛應用人工智能技術處理ESG評分及監控。公司的風險管理部致力於全周期的企業風險管理，包括資產品質、流動性、信息安全、法律、合規、運營及聲譽風險等。該部門利用多種先進的風險管理平台和模型，通過在不同情景下對不同資產進行壓力測試以執行全面風險管理，並自主開發了專有的風險管理指標和信號體系來監控全球風險。針對公司ESG政策要求，風險管理部亦負責對所公司各投資部門所管理的投資組合的ESG評分進行監控。

### 制定 ESG 投資目標 把握未來機遇

放眼未來，全球綠色金融理念已逐漸成為主流，綠色債券市場的規模在過去5年中呈指數級增長，相信在未來10年將繼續高速增長。更值得關注的是，中國在2020年9月作出2030年實現「碳達峰」、2060年實現「碳中和」承諾，綠色投資已成為中國經濟轉型發展的重中之重。氣候政策倡議組織估計，到2030年，中國每年將需要3萬億元至4萬億元人民幣的綠色投資<sup>1</sup>，而綠色債券則是支持這種所需投資的理想融資工具。因此未來中國的綠色債券市場及相關ESG

中國平安資產管理（香港）資本市場負責人、首席投資官柴志傑先生



投資存在相當大的機遇<sup>2</sup>。

為此，公司已制定短、中、長期綠色及ESG投資目標。公司預計2022年綠色債券的投資規模，及通過ESG篩選的股票投資規模，均將按年增長50%以上。另外，公司也在快速增加與ESG相關的另類投資，包括投資海外可再生能源、氣候變化基金和可再生能源共投項目，以及中國內地風電和新能源項目等，預計2022年內ESG相關另類投資規模，包括基金、境內外直接投資和跟投，按年也將增長50%以上。

當前全球各地ESG監管體系差異較大，並且仍在持續變動，對ESG投資機構帶來一定挑戰。中國平安資產管理（香港）依託平安集團的大數據及人工智能核心技術和資源，準確衡量每家公司的ESG相關業務的狀況和變化趨勢，有助公司把握潛在的機遇。

<sup>1</sup> 以上投資目標為預計數字，僅供參考。

<sup>2</sup> 資料來源：氣候政策倡議組織2020年6月發佈報告《中國綠色債券市場概覽及有效性分析》www.climatepolicyinitiative.org/wp-content/uploads/2020/06/The-State-and-Effectiveness-of-the-Green-Bond-Market-in-China-Mandarin-Version.pdf