

# 华安财保资产管理有限责任公司股票投资管理能力建设及自评估情况（年度披露-20240122）

## 一、风险责任人

|           |                |              |                  |
|-----------|----------------|--------------|------------------|
| 风险责任人：    | 风险责任人信息披露公告    |              |                  |
| 行政责任人：    | 童清             | 职务：          | 董事长              |
| 行政责任人类别：  | 董事长            | 是否履行完备的授权程序： |                  |
| 行政责任人性别   | 男              | 行政责任人出生年月    | 1967-07          |
| 行政责任人学历   | 硕士研究生          | 行政责任人学位      | 硕士研究生            |
| 行政责任人所在部门 | 总裁室            | 行政责任人入司时间    | 2013-09-05       |
| 行政责任人专业资质 | 无              | 行政责任人专业技术职务  | 无                |
| 专业责任人：    | 肖睿             | 职务：          | 权益投资部总经理助理（主持工作） |
| 专业责任人类别：  | 授权的相关资产管理部门负责人 | 是否履行完备的授权程序： | 是                |
| 专业责任人性别   | 女              | 专业责任人出生年月    | 1989-12          |
| 专业责任人学历   | 硕士研究生          | 专业责任人学位      | 硕士研究生            |
| 专业责任人入司时间 | 2021-11-01     | 专业责任人所在部门    | 权益投资部            |
| 专业责任人专业资质 | 金融风险管理师        | 专业责任人专业技术职务  | 无                |

## 二、组织架构

|         |
|---------|
| 整体评估情况： |
|---------|



公司下发“华保资发〔2018〕28号”《关于公司组织架构调整的决定》，根据该发文，公司组建权益投资部，负责股票、债券、基金、期货、衍生品等权益资产的研究、配置和投资。

公司下发“华保资发〔2022〕44号”《关于下发〈华安财保资产管理有限责任公司部门职责及岗位设置〉的通知》、“华保资发〔2023〕74号”《关于华安财保资产管理有限责任公司岗位及职责调整的通知》，根据上述发文：权益投资部部门核心职能为负责公司权益类资产的研究、配置和投资工作，部门专业职责包括投资管理、风险控制、量化策略研究、团队建设、档案管理等其他通用职责。权益投资部岗位设置为：设权益投资部总经理、权益投资部副总经理、投资经理（股票）岗、投资经理（基金）岗、投资经理（量化）岗、研究员（股票）岗、研究员（基金）岗、研究员（量化）岗、投后管理岗（基金）。且担任投资经理（股票）岗和研究员（股票）岗的人员不再承担基金投资业务职责。

此外，公司交易部、风险管理部、运营部、人力资源部及信息技术部共同构成公司股票投资团队，交易部权益交易员岗对股票投资业务进行交易操作，风险管理部风险管理岗对股票投资业务进行风险控制，运营部清算岗及核算岗分别对股票投资业务进行清算及核算，人力资源部人力资源管理岗对股票投资业务进行绩效考核，信息技术部应用系统管理岗对股票投资业务提供系统支持。

公司下发“华保资发〔2021〕3号”《关于下发〈华安财保资产管理有限责任公司各部门岗位职责及人员配置情况〉的通知》“华保资发〔2022〕43号”《关于下发〈华安财保资产管理有限责任公司各部门岗位职责〉的通知》，明确了权益投资部投资经理、研究员及交易部交易员的岗位职责及人员配置情况，公司股票投资团队采取“投研一体化”模式，具体人员配置情况如下：权益投资部股票投资经理和研究专职人员合计不少于8人，交易部负责股票交易专职人员配置不少于2人，股票投资经理、研究人员和交易人员等主要业务人员合计不少于12人。

（二）投资经理配备

公司根据账户/组合性质配备独立的投资经理。公司当前涉及股票投资的账户/组合主要分为两类：主动选股投资账户/组合和量化投资账户/组合。公司权益投资部就上述两类账户分别配备独立的投资经理。其中，主动选股投资账户/组合的股票组合管理规模依据其最近一年和三年的投资业绩，以及投资风格与市场展望的匹配程度，进行动态调节；量化投资账户/组合的具体策略包括复制指数和指数增强，具体策略的选择依据账户/组合的风险偏好来确定。

（三）防火墙机制

公司建立了相对健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的组织架构，投资、交易、风险控制、绩效评估、清算核算等工作在不同部门独立运作，按监管要求构成了前、中、后台分开，互相制约、相互制衡的资金运用管理模式。

权益投资部分别设置投资经理（股票）岗和投资经理（基金）岗，且股票投资经理与基金投资经理的任职人员不重合，实现了股票投资经理与基金投资经理之间的隔离；

权益投资部下设投资经理（股票）岗，交易部下设权益交易员岗，分别负责股票投资的投资职能和交易职能，实现了投资经理与交易人员之间的隔离；

公司设有独立的风险管理部 and 人力资源部，风险管理部下设风险管理岗，负责股票投资的风险控制；人力资源部下设人力资源管理岗，负责公司员工的绩效考核与评估，实现了投资管理人员与风险控制、绩效评估人员之间的隔离；

公司运营部设置清算岗及核算岗，分别负责股票投资的清算与核算，实现清算人员与核算人员的隔离。

经评估，符合《保险机构股票投资管理标准》要求。

（四）投资场所

公司设立集中交易室，交易室作为公司实现集中交易的场所，是重要保密区域。交易时间内，交易室实行门禁管理，未经批准其他人不得随意进入。

经评估，公司符合《保险机构股票投资能力标准》的要求。

股票投资部门：

1

|       |            |           |                                                                                  |
|-------|------------|-----------|----------------------------------------------------------------------------------|
| 部门名称  | 交易部        |           |                                                                                  |
| 发文时间  | 2022-08-01 | 文件名称（含文号） | “华保资发〔2013〕号003号”《关于公司部门设置的决定》、“华保资发〔2022〕44号”《关于下发〈华安财保资产管理有限责任公司部门职责及岗位设置〉的通知》 |
| 岗位设置： | 权益交易员岗     |           |                                                                                  |

2

|       |            |           |                                                                                  |
|-------|------------|-----------|----------------------------------------------------------------------------------|
| 部门名称  | 人力资源部      |           |                                                                                  |
| 发文时间  | 2022-08-01 | 文件名称（含文号） | “华保资发〔2019〕74号”《关于公司组织架构调整的决定》、“华保资发〔2022〕44号”《关于下发〈华安财保资产管理有限责任公司部门职责及岗位设置〉的通知》 |
| 岗位设置： | 人力资源管理岗    |           |                                                                                  |

3

|      |       |  |  |
|------|-------|--|--|
| 部门名称 | 信息技术部 |  |  |
|------|-------|--|--|

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |           |                                                                                  |
|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------|----------------------------------------------------------------------------------|
| 发文时间   | 2022-08-01                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | 文件名称（含文号） | “华保资发（2013）号003号”《关于公司部门设置的决定》、“华保资发（2022）44号”《关于下发〈华安财保资产管理有限责任公司部门职责及岗位设置〉的通知》 |
| 岗位设置：  | 信息技术部副总经理（主持工作），应用系统管理岗                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |           |                                                                                  |
| 4      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |           |                                                                                  |
| 部门名称   | 权益投资部                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |           |                                                                                  |
| 发文时间   | 2023-10-24                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | 文件名称（含文号） | “华保资发（2018）28号”《关于公司组织架构调整的决定》、“华保资发（2023）74号”《关于华安财保资产管理有限责任公司岗位及职责调整的通知》       |
| 岗位设置：  | 投资经理（股票）岗，研究员（股票）岗                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |           |                                                                                  |
| 5      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |           |                                                                                  |
| 部门名称   | 运营部                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |           |                                                                                  |
| 发文时间   | 2022-08-01                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | 文件名称（含文号） | “华保资发（2018）28号”《关于公司组织架构调整的决定》、“华保资发（2022）44号”《关于下发〈华安财保资产管理有限责任公司部门职责及岗位设置〉的通知》 |
| 岗位设置：  | 核算岗，清算岗，运营部总经理                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |           |                                                                                  |
| 6      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |           |                                                                                  |
| 部门名称   | 风险管理部                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |           |                                                                                  |
| 发文时间   | 2022-08-01                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | 文件名称（含文号） | “华保资发（2013）号003号”《关于公司部门设置的决定》、“华保资发（2022）44号”《关于下发〈华安财保资产管理有限责任公司部门职责及岗位设置〉的通知》 |
| 岗位设置：  | 风险管理岗                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |           |                                                                                  |
| 投资经理：  | 已根据账户/组合性质、管理资金规模等配备了独立的股票投资经理                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |           |                                                                                  |
| 防火墙机制： | <p>公司建立了相对健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的组织架构，投资、交易、风险控制、绩效评估、清算核算等工作在不同部门独立运作，按监管要求构成了前、中、后台分开，互相制约、相互制衡的资金运用管理模式，部门之间形成有效的防火墙机制。</p> <p>权益投资部分别设置股票投资经理岗和基金投资经理岗，且股票投资经理与基金投资经理的任职人员不重合，实现了股票投资经理与基金投资经理之间的隔离；权益投资部下设投资经理岗，交易部下设交易员岗，分别负责股票投资的投资职能和交易职能，实现了投资经理与交易人员之间的隔离；</p> <p>公司设有独立的风险管理部 and 人力资源部，风险管理部下设风险管理岗，负责股票投资的风险控制；人力资源部下设人力资源管理岗，负责公司员工的绩效考核与评估，实现了投资管理人员与风险控制、绩效评估人员之间的隔离；</p> <p>公司运营部设置基金会计岗，负责股票投资的清算与核算，清算与核算工作分别由不同人员负责，实现清算人员与核算人员的隔离。</p> <p>经评估，公司符合《保险机构股票投资能力标准》的要求。</p> |           |                                                                                  |
| 评估结果：  | 符合规定                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |           |                                                                                  |
| 投资场所：  | <p>公司设立集中交易室，交易室作为公司实现集中交易的场所，是重要保密区域。交易时间内，交易室实行门禁管理，未经批准其他人不得随意进入。</p> <p>经评估，公司符合《保险机构股票投资能力标准》的要求。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |           |                                                                                  |
| 评估结果：  | 符合规定                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |           |                                                                                  |

### 三、专业队伍

|         |
|---------|
| 整体评估情况： |
|---------|

公司股票投资规模超过10亿元，专职人员15人，不少于12人，其中股票投资经理4人，研究人员7人（主要研究人员2人），交易人员2人，风控人员1人，清算人员1人；另有核算人员1人，绩效评估人员1人，系统支持人员1人。公司股票投资团队采取“投研一体化”模式，具体人员配置情况如下：权益投资部股票投资经理和研究专职人员合计11人，不少于8人；交易部负责股票交易专职人员配置不少于2人，股票投资经理、研究人员和交易人员等主要业务人员合计13人，不少于12人。其中股票投资负责人具有5年以上股票投资管理经验或者6年以上金融证券从业经历及相关专业资质，投资经理具有3年以上股票投资管理经验或者5年以上金融证券从业经历，有良好的过往业绩表现，主要研究人员从事行业研究3年以上。

经评估，公司符合《保险机构股票投资能力标准》的要求。

专业队伍人员基本信息：

| 序号 | 姓名  | 岗位              | 是否为能力标准要求的专职人员 | 相关经验类型     | 相关经验年限 |
|----|-----|-----------------|----------------|------------|--------|
| 1  | 王子轩 | 权益交易员岗          | 是              | 金融证券投资从业经验 | 8.56   |
| 2  | 文超武 | 权益交易员岗          | 是              | 金融证券投资从业经验 | 4.26   |
| 3  | 陈曦  | 人力资源管理岗         | 否              | 其他         | 13.74  |
| 4  | 陈伟元 | 信息技术部副总经理（主持工作） | 否              | 其他         | 17.32  |
| 5  | 于华杰 | 投资经理（股票）岗       | 是              | 股票投资管理经验   | 6.33   |
| 6  | 李权葆 | 投资经理（股票）岗       | 是              | 行业研究经验     | 6.54   |
| 7  | 房晓  | 投资经理（股票）岗       | 是              | 金融证券投资从业经验 | 10.60  |
| 8  | 廖乐一 | 投资经理（股票）岗       | 是              | 金融证券投资从业经验 | 8.57   |
| 9  | 李泉霖 | 投资经理（股票）岗       | 是              | 股票投资管理经验   | 12.48  |
| 10 | 李阳  | 研究员（股票）岗        | 是              | 行业研究经验     | 8.84   |
| 11 | 李艳  | 研究员（股票）岗        | 是              | 行业研究经验     | 1.56   |
| 12 | 张世良 | 研究员（股票）岗        | 是              | 行业研究经验     | 5.56   |
| 13 | 陈玥昕 | 研究员（股票）岗        | 是              | 行业研究经验     | 1.81   |
| 14 | 白书坤 | 研究员（股票）岗        | 是              | 行业研究经验     | 4.90   |
| 15 | 沈知  | 研究员（股票）岗        | 是              | 行业研究经验     | 12.89  |
| 16 | 刘珊珊 | 核算岗             | 否              | 其他         | 6.56   |
| 17 | 刘雁哲 | 清算岗             | 是              | 其他         | 5.27   |
| 18 | 邴春晔 | 风险管理岗           | 是              | 其他         | 5.29   |

#### 四. 投资制度

整体评估情况：

公司通过《股票投资管理办法》《股票投资操作规程》《新股网下申购业务管理规范》《股票研究管理办法》《股票池管理办法》《港股通股票池管理办法》《量化投资股票池管理办法》等制度构建公司股票投资管理体系，《股票投资管理办法》作为公司股票投资的核心和基本制度，明确了股票投资岗位职责、业务流程、操作规程、会议制度、文档管理、绩效考核、清算与核算、信息系统管理、保密及危机处理等各项内容，同时明确了股票投资决策权限管理机制，具体包括投资决策体系、授权管理、实施与控制等内容。此外，公司制定《决策授权及审批管理办法》及各年度业务授权方案作为整体授权决策管理制度，明确了按不同账户/产品、不同业务类型以及不同交易规模进行分级授权和业务事前的逐级审批。《股票投资操作流程》明确了公司股票投资的基本操作程序，具体涵盖投前准备、投资执行、投资信息反馈、交易清算及交收、投后管理等流程中的操作程序事项。《股票研究管理办法》规定了公司股票投资的投资策略、行业 and 个股研究、投资报告制度、调研管理制度等内容。《股票池管理办法》《港股通股票池管理办法》《量化投资股票池管理办法》分别对主动管理账户/组合的可投标的池、港股通投资的可投标的池，以及量化投资账户/组合的可投标的池进行管理，包括股票池筛选的标准、出入池流程等。《股票禁池池管理办法》，明确了公司股票禁池构建、禁池股票的调出管理、禁池股票的预警和处置等事项。《证券经营机构交易单元管理办法》明确了租用交易单元的合作证券经营机构的选择标准以及服务质量评估职责、评估周期、评估标准等内容。《集中交易管理办法》中，明确了权限管理、交易监控、交易指令管理、指令审核与分发（体现权限管理系）等内容。《公平交易管理办法》中明确了公平控制原则及公平交易执行程序，并明确公司应对投资交易系统进行公平委托设置，由风险管理部门可对公平委托设置查询并提出修改建议，并负责交易全流程的监督以及参与异常交易的评判与处理。经评估，公司符合《保险机构股票投资管理标准》的要求。

| 股票投资基本制度： |      |                                                                                                                                                                                                                                    |
|-----------|------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 制度内容      | 评估结果 | 制度明细                                                                                                                                                                                                                               |
| 信息系统管理    | 符合规定 | 文件名称：华安财保资产管理有限责任公司信息系统用户和权限管理规范，<br>发文文号：华保资发〔2023〕98号，<br>发文时间：2023-12-19；<br>文件名称：华安财保资产管理有限责任公司股票投资管理办法，<br>发文文号：华保资发〔2023〕106号，<br>发文时间：2023-12-20；                                                                           |
| 业务流程      | 符合规定 | 文件名称：华安财保资产管理有限责任公司股票投资管理办法，<br>发文文号：华保资发〔2023〕106号，<br>发文时间：2023-12-20；                                                                                                                                                           |
| 清算与核算     | 符合规定 | 文件名称：华安财保资产管理有限责任公司投资清算管理办法，<br>发文文号：华保资发〔2020〕60号，<br>发文时间：2020-10-30；<br>文件名称：华安财保资产管理有限责任公司投资核算管理办法，<br>发文文号：华保资发〔2023〕106号，<br>发文时间：2023-12-20；<br>文件名称：华安财保资产管理有限责任公司股票投资管理办法，<br>发文文号：华保资发〔2023〕106号，<br>发文时间：2023-12-20；    |
| 绩效考核      | 符合规定 | 文件名称：华安财保资产管理有限责任公司员工绩效考核管理办法，<br>发文文号：华保资发〔2018〕45号，<br>发文时间：2018-09-19；<br>文件名称：华安财保资产管理有限责任公司股票投资管理办法，<br>发文文号：华保资发〔2023〕106号，<br>发文时间：2023-12-20；                                                                              |
| 操作规程      | 符合规定 | 文件名称：华安财保资产管理有限责任公司股票投资操作规程，<br>发文文号：华保资发〔2023〕106号，<br>发文时间：2023-12-20；<br>文件名称：华安财保资产管理有限责任公司股票投资管理办法，<br>发文文号：华保资发〔2023〕106号，<br>发文时间：2023-12-20；<br>文件名称：华安财保资产管理有限责任公司新股网下申购业务管理规范，<br>发文文号：华保资发〔2024〕7号，<br>发文时间：2024-01-10； |
| 会议制度      | 符合规定 | 文件名称：华安财保资产管理有限责任公司股票投资管理办法，<br>发文文号：华保资发〔2023〕106号，<br>发文时间：2023-12-20；                                                                                                                                                           |

|          |      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|----------|------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 文档管理     | 符合规定 | 文件名称：华安财保资产管理有限责任公司股票投资管理办法，<br>发文文号：华保资发〔2023〕106号，<br>发文时间：2023-12-20；<br>文件名称：华安财保资产管理有限责任公司档案管理办法，<br>发文文号：华保资发〔2019〕58号，<br>发文时间：2019-06-13；                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 保密及危机处理  | 符合规定 | 文件名称：华安财保资产管理有限责任公司资产管理重大风险事件应急预案及管理办法，<br>发文文号：华保资发〔2021〕16号，<br>发文时间：2021-03-26；<br>文件名称：华安财保资产管理有限责任公司员工违规违纪及失职行为处理办法，<br>发文文号：华保资发〔2019〕24号，<br>发文时间：2019-03-11；<br>文件名称：华安财保资产管理有限责任公司股票投资管理办法，<br>发文文号：华保资发〔2023〕106号，<br>发文时间：2023-12-20；<br>文件名称：华安财保资产管理有限责任公司问责管理办法，<br>发文文号：华保资发〔2020〕64号，<br>发文时间：2020-11-09；<br>文件名称：华安财保资产管理有限责任公司保密管理办法，<br>发文文号：华保资发〔2013〕002号，<br>发文时间：2013-09-09； |
| 股票投资岗位职责 | 符合规定 | 文件名称：华安财保资产管理有限责任公司股票投资管理办法，<br>发文文号：华保资发〔2023〕106号，<br>发文时间：2023-12-20；                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 决策管理制度：  |      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 制度内容     | 评估结果 | 制度明细                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 投资决策体系   | 符合规定 | 文件名称：华安财保资产管理有限责任公司股票投资管理办法，<br>发文文号：华保资发〔2023〕106号，<br>发文时间：2023-12-20；<br>文件名称：华安财保资产管理有限责任公司决策授权及审批管理办法，<br>发文文号：华保资发〔2023〕80号，<br>发文时间：2023-11-14；                                                                                                                                                                                                                                              |
| 授权管理     | 符合规定 | 文件名称：华安财保资产管理有限责任公司股票投资管理办法，<br>发文文号：华保资发〔2023〕106号，<br>发文时间：2023-12-20；<br>文件名称：华安财保资产管理有限责任公司决策授权及审批管理办法，<br>发文文号：华保资发〔2023〕80号，<br>发文时间：2023-11-14；                                                                                                                                                                                                                                              |
| 实施与控制    | 符合规定 | 文件名称：华安财保资产管理有限责任公司股票投资管理办法，<br>发文文号：华保资发〔2023〕106号，<br>发文时间：2023-12-20；<br>文件名称：华安财保资产管理有限责任公司决策授权及审批管理办法，<br>发文文号：华保资发〔2023〕80号，<br>发文时间：2023-11-14；                                                                                                                                                                                                                                              |
| 研究管理制度：  |      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 制度内容     | 评估结果 | 制度明细                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 交易单元管理办法 | 符合规定 | 文件名称：华安财保资产管理有限责任公司证券经营机构交易单元管理办法，<br>发文文号：华保资发〔2023〕106号，<br>发文时间：2023-12-20；                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |

|         |      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|---------|------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 研究管理办法  | 符合规定 | 文件名称：华安财保资产管理有限责任公司股票投资管理办法，<br>发文文号：华保资发（2023）106号，<br>发文时间：2023-12-20；<br>文件名称：华安财保资产管理有限责任公司股票研究管理办法，<br>发文文号：华保资发（2021）5号，<br>发文时间：2021-01-21；                                                                                                                                                                                                                                        |
| 股票池管理办法 | 符合规定 | 文件名称：华安财保资产管理有限责任公司港股通股票池管理办法，<br>发文文号：华保资发（2023）106号，<br>发文时间：2023-12-20；<br>文件名称：华安财保资产管理有限责任公司股票投资管理办法，<br>发文文号：华保资发（2023）106号，<br>发文时间：2023-12-20；<br>文件名称：华安财保资产管理有限责任公司量化投资股票池管理办法，<br>发文文号：华保资发（2023）106号，<br>发文时间：2023-12-20；<br>文件名称：华安财保资产管理有限责任公司股票池管理办法，<br>发文文号：华保资发（2021）5号，<br>发文时间：2021-01-21；<br>文件名称：华安财保资产管理有限责任公司股票禁投池管理办法，<br>发文文号：华保资发（2021）5号，<br>发文时间：2021-01-21； |
| 交易管理制度： |      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 制度内容    | 评估结果 | 制度明细                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 交易监控    | 符合规定 | 文件名称：华安财保资产管理有限责任公司集中交易管理办法，<br>发文文号：华保资发（2021）5号，<br>发文时间：2021-01-21；                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 公平交易    | 符合规定 | 文件名称：华安财保资产管理有限责任公司公平交易管理办法，<br>发文文号：华保资发（2021）5号，<br>发文时间：2021-01-21；                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 交易权限管理  | 符合规定 | 文件名称：华安财保资产管理有限责任公司集中交易管理办法，<br>发文文号：华保资发（2021）5号，<br>发文时间：2021-01-21；                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 集中交易    | 符合规定 | 文件名称：华安财保资产管理有限责任公司集中交易管理办法，<br>发文文号：华保资发（2021）5号，<br>发文时间：2021-01-21；                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |

## 五. 系统建设

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                                                                                                                                         |      |      |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------|------|
| 整体评估情况：                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |                                                                                                                                         |      |      |
| 公司先后引入了恒生聚源研报系统、万得、同花顺数据终端服务、看研报等平台和数据服务，以此为基础，实现了资产配置模型、行业配置模型、个股估值模型、内部研究报告等投资研究管理。公司具备万德、同花顺等多个资讯分析系统，可以获得多家券商的研究服务支持。投资交易管理系统引入目前行业主流的恒生032系统，该系统作为绝大多数的保险公司、基金公司、资产管理公司的选择，可有效对接国内的各交易市场的主流交易品种。032系统具备授权管理体系，可以从账户、品种、规模、业务类型等多个维度实现对投资交易的授权管理、合规管理和交易控制等。投资估值管理系统引入恒生估值系统，该系统可无缝对接恒生交易系统，处理国内的各交易市场包括股票在内的全部交易品种。系统完整的覆盖了投资组合估值核算的所有价值链，可以每日进行估值与清算，并自动生成相应报表，为我司投资运营提供了保障。上述系统共同构建起公司股票投资的信息技术系统，并对公司股票投资行为及投资管理等产生实质影响。 |                                                                                                                                         |      |      |
| 交易管理系统：                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |                                                                                                                                         |      |      |
| 系统名称                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 恒生投资交易03.2                                                                                                                              |      |      |
| 上线时间                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 2014-11-10                                                                                                                              | 评估结果 | 符合规定 |
| 主要功能                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 投资交易管理系统引入目前行业主流的恒生032系统，该系统作为绝大多数的保险公司、基金公司、资产管理公司的选择，可有效对接国内的各交易市场的主流交易品种。032系统具备授权管理体系，可以从账户、品种、规模、业务类型等多个维度实现对投资交易的授权管理、合规管理和交易控制等。 |      |      |

|            |                                                                                                                                             |      |      |
|------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------|------|
| 信息资讯系统:    |                                                                                                                                             |      |      |
| 系统名称       | 同花顺iFind                                                                                                                                    |      |      |
| 上线时间       | 2018-11-01                                                                                                                                  | 评估结果 | 符合规定 |
| 主要功能       | 公司具备万德、同花顺等不少于2种研究资讯分析系统, 7x24小时更新中国近五十家证券或行业研究机构的研报发布平台, 可以获得多家券商的研究服务支持。符合《关于优化保险机构投资管理能力监管有关事项的通知》要求。                                    |      |      |
| 系统名称       | Wind金融终端                                                                                                                                    |      |      |
| 上线时间       | 2018-11-01                                                                                                                                  | 评估结果 | 符合规定 |
| 主要功能       | 公司具备万德、同花顺等不少于2种研究资讯分析系统, 7x24小时更新中国近五十家证券或行业研究机构的研报发布平台, 可以获得多家券商的研究服务支持。符合《关于优化保险机构投资管理能力监管有关事项的通知》要求。                                    |      |      |
| 研究分析系统:    |                                                                                                                                             |      |      |
| 系统名称       | 恒生聚源研报系统                                                                                                                                    |      |      |
| 上线时间       | 2015-11-17                                                                                                                                  | 评估结果 | 符合规定 |
| 主要功能       | 公司先后引入了恒生聚源研报系统、万得、同花顺数据终端服务、看研报等平台和数据服务, 相关系统能够提供投研数据服务, 以此为基础, 实现了资产配置模型、行业配置模型、个股估值模型、内部研究报告等投资研究管理。                                     |      |      |
| 系统名称       | 同花顺iFind                                                                                                                                    |      |      |
| 上线时间       | 2018-11-01                                                                                                                                  | 评估结果 | 符合规定 |
| 主要功能       | 公司先后引入了恒生聚源研报系统、万得、同花顺数据终端服务等平台和数据服务, 相关系统能够提供投研数据服务, 以此为基础, 实现了资产配置模型、行业配置模型、个股估值模型、内部研究报告等投资研究管理。                                         |      |      |
| 系统名称       | Wind金融终端                                                                                                                                    |      |      |
| 上线时间       | 2018-11-01                                                                                                                                  | 评估结果 | 符合规定 |
| 主要功能       | 公司先后引入了恒生聚源研报系统、万得、同花顺数据终端服务、看研报等平台和数据服务, 相关系统能够提供投研数据服务, 以此为基础, 实现了资产配置模型、行业配置模型、个股估值模型、内部研究报告等投资研究管理。                                     |      |      |
| 资产估值和核算系统: |                                                                                                                                             |      |      |
| 系统名称       | 恒生估值核算系统                                                                                                                                    |      |      |
| 上线时间       | 2014-11-10                                                                                                                                  | 评估结果 | 符合规定 |
| 主要功能       | 投资估值管理系统引入恒生估值系统, 该系统可无缝对接恒生交易系统, 处理国内各交易市场包括股票在内的全部交易品种。系统具备安全、高效的清算交割、财务核算系统, 完整的覆盖了投资组合估值核算的所有价值链, 可以每日进行估值与清算, 并自动生成相应报表, 为公司投资运营提供了保障。 |      |      |

## 六. 风险控制

|                                                                                                                                                                                                                                              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 整体评估情况:                                                                                                                                                                                                                                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 公司《股票投资风险管理办法》对股票投前限额控制和禁投管理、投中交易流程风险控制、投后风险评估、风险应对及报告等流程进行规范, 构建了覆盖事前控制、事中监督、事后评价的风险控制体系; 明确了独立于投资管理的报告机制: 风险管理部门定期、不定期向管理层、董事会、监管机构提交风险评估报告; 明确了当股票投资出现重大风险事件时, 应根据公司《重大风险事件应急预案及管理办法》相关要求, 定期不定期向公司管理层提交风险评估报告。经评估, 符合《保险机构股票投资管理能力标准》要求。 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 评估结果                                                                                                                                                                                                                                         | 符合规定                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 风险管理制度:                                                                                                                                                                                                                                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 制度名称                                                                                                                                                                                                                                         | 《华安财保资产管理有限责任公司股票投资风险管理办法》-“华保资发〔2023〕106号”-2023.12.20-经营管理层                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 评估情况                                                                                                                                                                                                                                         | 公司制定《全面风险管理办法》作为风险管理基本制度, 明确了公司总体风险管理的组织架构以及风险识别、风险评估、风险预警、风险应对、风险报告流程。在此基础上, 公司针对股票投资制定《股票投资风险管理办法》其中明确股票投资风险管理的全面性、审慎性、分散性原则; 并规定对股票仓位、Beta分析、个股及行业集中度、波动率、风险价值VAR、压力测试情况、投资策略执行情况等进行计量和评估; 明确了投资和交易环节中禁止买入情形、持仓异常、指令发出、指令审核、指令执行等关键风险点的控制手段; 明确风险管理部门定期通过绩效评估与风险管理系统, 对公司受托账户或产品中股票资产进行风险收益分析; 明确了股票投资的风险考核原则、考核维度、考核方案制定和问责、处罚情形, 同时公司制定有《问责管理办法》及《员工违规违纪及失职行为处理办法(试行)》对股票投资中的决策失误、工作失职、滥用职权等行为进行问责及责任追究。 |

|         |                                                                                                                                                                                                                                                                                               |      |      |
|---------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------|------|
| 评估结果    | 符合规定                                                                                                                                                                                                                                                                                          |      |      |
| 压力测试系统: |                                                                                                                                                                                                                                                                                               |      |      |
| 系统名称    | 风险管理与绩效评估系统                                                                                                                                                                                                                                                                                   |      |      |
| 上线时间    | 2014-11-10                                                                                                                                                                                                                                                                                    | 评估结果 | 符合规定 |
| 主要功能    | 公司《股票投资风险管理暂行办法》明确风险管理部门定期通过绩效评估与风险管理系统进行包括股票仓位、行业集中度和个股集中度在内的压力测试。公司恒生绩效评估与风险管理系统“组合风险”模块下“股票资产压力测试”以及“报告管理”模块下“权益类风险评估报告”功能,可实现对股票资产进行上述压力测试的功能,评估不同情形下的损失情况。《股票投资风险管理暂行办法》同时明确风险管理部门应结合压力测试情况对股票投资业务风险状况进行评估。公司《资产管理重大风险事件应急预案及管理办法》明确风险情形、重大损失定义以及响应和处置流程,当股票出现重大风险事件时,按照该办法股指定进行处置、采取措施。 |      |      |
| 风险管理系统: |                                                                                                                                                                                                                                                                                               |      |      |
| 系统名称    | 风险管理与绩效评估系统                                                                                                                                                                                                                                                                                   |      |      |
| 上线时间    | 2014-11-10                                                                                                                                                                                                                                                                                    | 评估结果 | 符合规定 |
| 主要功能    | 公司风险管理系统包括恒生投资管理的系统以及恒生绩效评估与风险管理系统,风险预警与合规功能由投资管理系统“风险控制”模块以及“风险监控与处置”模块实现;绩效评估由绩效评估与风险管理系统中“资产分析”模块以及“组合绩效”模块等实现。                                                                                                                                                                            |      |      |
| 系统名称    | 恒生投资交易03.2                                                                                                                                                                                                                                                                                    |      |      |
| 上线时间    | 2014-11-10                                                                                                                                                                                                                                                                                    | 评估结果 | 符合规定 |
| 主要功能    | 公司风险管理系统包括恒生投资管理的系统以及恒生绩效评估与风险管理系统,风险预警与合规功能由投资管理系统“风险控制”模块以及“风险监控与处置”模块实现;绩效评估由绩效评估与风险管理系统中“资产分析”模块以及“组合绩效”模块等实现。                                                                                                                                                                            |      |      |

## 七、自评估结果及承诺

根据《关于优化保险机构投资管理能力监管有关事项的通知》及相关监管规定,我公司对保险资管公司股票投资管理能力建设进行了调研论证和自我评估,经过充分论证和评估,我公司达到了该项能力的基本要求,现按规定披露相关信息。

我公司承诺对本公告披露的及时性、内容的真实性、完整性负责。

