

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（半年度披露-20210127）

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
专业责任人：	谢朵	职务：	总裁助理
类别：	高级管理人员		

二、组织架构

整体评估情况：			
<p>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，负责股票资产、股票类金融产品等权益资产的研究、配置和投资。</p> <p>公司下发“华保资发（2020）59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》，根据该发文：权益投资部部门职责为：负责根据公司投资管理委员会和账户投资指引等的相关要求，在公司内外部研究支持基础上，遵循合法合规、谨慎安全原则，进行股票和权益类基金的日常投资运作。权益投资部岗位设置为：设股票投资经理岗、基金投资经理岗和研究员岗。且担任股票投资经理岗和研究员岗的人员不再承担其他投资业务职责。此外，公司风险管理部、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，风险管理部风险管理岗对股票投资业务进行风险控制，运营部基金会计岗对公司股票投资业务进行清算核算，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。</p> <p>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》，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。</p> <p>（二）投资经理配备</p> <p>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。</p> <p>（三）防火墙机制</p> <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。</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；</p> <p>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和人力资源部，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>（四）投资场所</p> <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>			
股票投资部门：			
1			
部门名称	交易部		
发文时间	2013-09-10	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》
岗位设置：	交易员岗		
2			

部门名称	交易部		
发文时间	2020-10-30	文件名称 (含文号)	“华保资发(2020)59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:			
3			
部门名称	人力资源部		
发文时间	2019-08-19	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》
岗位设置:	人力资源管理岗		
4			
部门名称	人力资源部		
发文时间	2020-10-30	文件名称 (含文号)	“华保资发(2020)59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:			
5			
部门名称	信息技术部		
发文时间	2020-10-30	文件名称 (含文号)	“华保资发(2020)59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:	信息技术部总经理助理		
6			
部门名称	信息技术部		
发文时间	2013-09-10	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》
岗位设置:	应用系统管理岗		
7			
部门名称	权益投资部		
发文时间	2020-10-30	文件名称 (含文号)	“华保资发(2020)59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:	权益投资部副总经理		
8			
部门名称	权益投资部		
发文时间	2018-08-15	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》
岗位设置:	投资经理岗,研究员岗		
9			
部门名称	运营部		
发文时间	2020-10-30	文件名称 (含文号)	“华保资发(2020)59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:			
10			
部门名称	运营部		
发文时间	2018-08-15	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》
岗位设置:	基金会计岗,运营部副总经理(主持工作)		

11			
部门名称	风险管理部		
发文时间	2013-09-10	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》
岗位设置：	风险管理岗,风险管理部副总经理（主持工作）		
12			
部门名称	风险管理部		
发文时间	2020-10-30	文件名称（含文号）	“华保资发（2020）59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：			
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。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和人力资源部，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>		
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。		

三、专业队伍

整体评估情况：					
<p>公司股票投资规模超过10亿元，专职人员23人，不少于12人，其中股票投资经理5人，研究人员5人（主要研究人员2人），交易人员3人，风控人员4人，清算人员2人；核算人员2人；绩效评估人员1人；系统支持人员1人。投资经理、研究人员和交易人员等主要业务人员14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。</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>					
专业队伍人员基本信息：					
序号	姓名	岗位	是否兼职	相关经验类型	相关经验年限
1	文超武	交易员岗	否	金融证券从业经验	1.27
2	张子千	交易员岗	否	金融证券从业经验	2.55
3	董一鸣	交易员岗	否	金融证券从业经验	3.58
4	陈曦	人力资源管理岗	否	人力资源管理相关经验	0.00
5	张国强	信息技术部总经理助理	否	信息技术相关经验	10.58
6	余元	投资经理岗	否	股票投资管理经验	7.07
7	于华杰	投资经理岗	否	行业研究经验	3.34
8	张文浩	投资经理岗	否	行业研究经验	4.54
9	庞雅菁	投资经理岗	否	行业研究经验	4.94
10	廖乐一	投资经理岗	否	金融证券从业经验	5.58
11	房晓	投资经理岗	否	金融证券从业经验	7.61
12	李泉霖	投资经理岗	否	股票投资管理经验	9.49
13	孙楠	权益投资部副总经理	否	股票投资管理经验	8.49
14	李阳	研究员岗	否	行业研究经验	5.86

15	李亚鑫	研究员岗	否	行业研究经验	0.56
16	赵阳	基金会计岗	否	运营相关经验	4.57
17	刘雁哲	基金会计岗	否	运营相关经验	2.28
18	刘珊珊	基金会计岗	否	金融证券从业经验	3.57
19	朱云	运营部副总经理（主持工作）	否	运营相关经验	3.95
20	陈震宇	风险管理岗	否	风险管理相关经验	0.58
21	卫西文	风险管理岗	否	风险管理相关经验	9.33
22	邴春晔	风险管理岗	否	风险管理相关经验	2.30
23	徐梓倩	风险管理部副总经理（主持工作）	是	风险管理相关经验	7.23

四. 投资制度

整体评估情况：

公司通过《股票投资管理办法》《股票池管理办法》《股票投资管理流程》《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》《量化的投资股票池管理办法》等制度构建公司股票投资管理制度体系，《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有限管理机制，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（试行）》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、不同业务类型本操作程序事项。《股票研究管理办法》规定了公司、股票投资的投资策略、行业和个人研究、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。《股票禁投池管理办法》，明确了公司股票禁投池的构建、禁投池股票的调出管理、禁投池股票的预警和处置等事项。《租用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）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设置公平委托的公平委托设置，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。相关制度已经过公司总裁办公会审议批准，并通过“华保资发〔2021〕5号”《关于调整股票投资相关制度的通知》下发。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
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， 发文文号：华保资发〔2021〕5号， 发文时间：2021-01-21；
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股票投资管理办法， 发文文号：华保资发〔2021〕5号， 发文时间：2021-01-21；
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股票投资管理办法， 发文文号：华保资发〔2021〕5号， 发文时间：2021-01-21； 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， 发文文号：华保资发〔2020〕60号， 发文时间：2020-10-30； 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， 发文文号：华保资发〔2020〕61号， 发文时间：2020-10-30；

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， 发文文号：华保资发〔2021〕5号， 发文时间：2021-01-21； 文件名称：华安财保资产管理有限责任公司档案管 理办法， 发文文号：华保资发〔2019〕58号， 发文时间：2019-06-13；
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 管理 办法， 发文文号：华保资发〔2021〕5号， 发文时间：2021-01-21； 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， 发文文号：华保资发〔2021〕5号， 发文时间：2021-01-21；
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股票投资 管 理办法， 发文文号：华保资发〔2021〕5号， 发文时间：2021-01-21；
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股票投资 管 理办法， 发文文号：华保资发〔2021〕5号， 发文时间：2021-01-21； 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， 发文文号：华保资发〔2020〕62号， 发文时间：2020-11-06；
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， 发文文号：华保资发〔2021〕5号， 发文时间：2021-01-21；
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， 发文文号：华保资发〔2021〕5号， 发文时间：2021-01-21；
决策管理制度：		
制度内容	评估结果	制度明细
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， 发文文号：华保资发〔2021〕5号， 发文时间：2021-01-21； 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（试行）， 发文文号：华保资发〔2018〕72号， 发文时间：2018-12-14；
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， 发文文号：华保资发〔2021〕5号， 发文时间：2021-01-21； 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（试行）， 发文文号：华保资发〔2018〕72号， 发文时间：2018-12-14；
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， 发文文号：华保资发〔2021〕5号， 发文时间：2021-01-21； 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（试行）， 发文文号：华保资发〔2018〕72号， 发文时间：2018-12-14；
研究管理制度：		
制度内容	评估结果	制度明细

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股票投资管理 办法， 发文文号：华保资发〔2021〕5号， 发文时间：2021-01-21； 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， 发文文号：华保资发〔2021〕5号， 发文时间：2021-01-21； 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， 发文文号：华保资发〔2021〕5号， 发文时间：2021-01-21； 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， 发文文号：华保资发〔2021〕5号， 发文时间：2021-01-21； 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， 发文文号：华保资发〔2021〕5号， 发文时间：2021-01-21；
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， 发文文号：华保资发〔2021〕5号， 发文时间：2021-01-21； 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， 发文文号：华保资发〔2021〕5号， 发文时间：2021-01-21；
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租用证券 经营机构交 易单元管理办 法， 发文文号：华保资发〔2021〕5号， 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
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， 发文文号：华保资发〔2021〕5号， 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， 发文文号：华保资发〔2021〕5号， 发文时间：2021-01-21；
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， 发文文号：华保资发〔2021〕5号， 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， 发文文号：华保资发〔2021〕5号， 发文时间：2021-01-21；

五. 系统建设

整体评估情况：			
<p>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，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。公司具备万得、同花顺以及大智慧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产生实质影响。</p>			
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O32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。 O32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	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、同花顺以及大智慧等多个资讯分析系统，可以获得多家券商的研究服务支持。		
系统名称	大智慧大数据终端		
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、同花顺以及大智慧等多个资讯分析系统，可以获得多家券商的研究服务支持。		
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、同花顺以及大智慧等多个资讯分析系统，可以获得多家券商的研究服务支持。		
研究分析系统：			
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，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	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。		
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。		
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；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、监管提交风险评估报告。			
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《股票投资风险管理办法》明确风险管理部门定期通过公司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”模块中可实现股票资产的上述压力测试功能。《股票投资风险管理办法》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。公司制定《重大风险事件应急预案及管理办法》，当股票出现重大风险事件时按此执行。		
风险管理系统：			

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	公司风险管理系统包括恒生投资管理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的“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及组合绩效模块实现。		
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的“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及组合绩效模块实现。		

七、自评估结果及承诺

根据《关于优化保险机构投资管理监管有关事项的通知》及相关监管规定，我对保险资管机构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，我达到了该项能力的基本要求，现按规定披露相关信息。

我承诺对本公告披露的及时性、内容的真实性、完整性负责。