

安联保险资产管理有限公司股票投资管理能力建设及自评估情况（年度披露-20220127）

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: | 甄庆哲 | 职务: | 执行董事兼总经理 |
| 行政责任人类型: | 授权总经理 | 是否履行完备的授权程序: | 是 |
| 行政责任人性别 | 女 | 行政责任人出生年月 | 1971-06 |
| 行政责任人学历 | 研究生 | 行政责任人学位 | 硕士 |
| 行政责任人所在部门 | 公司高级管理人员 | 行政责任人入司时间 | 2021-05-01 |
| 行政责任人专业资质 | 北美精算师，金融风险分析师 | 行政责任人专业技术职务 | 无 |
| 专业责任人: | 杜毅 | 职务: | 部门负责人 |
| 专业责任人类型: | 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 | 男 | 专业责任人出生年月 | 1982-02 |
| 专业责任人学历 | 研究生 | 专业责任人学位 | 硕士 |
| 专业责任人入司时间 | 2021-06-01 | 专业责任人所在部门 | 权益投资部 |
| 专业责任人专业资质 | 专业责任人拥有13年资本市场投资管理、研究经验 | 专业责任人专业技术职务 | 无 |

二、组织架构

| | | | |
|---------|--|-----------|---|
| 整体评估情况: | 安联保险资产管理有限公司通过印发《关于安联保险资产管理有限公司部门设置的通知》《安联保险资产管理有限公司股票投资管理相关部门岗位职责规定》等文件，设立独立的股票投资部门，明确部门职责、岗位职责、部门负责人和专业人员配置情况，并设置了股票投资研究、投资、交易、风险控制、绩效评估、清算、核算以及信息系统支持等岗位。 一是设置专人专岗，明确对研究、投资、交易等关键岗位实行专人专岗，与其他投资业务严格分离，并根据投资账户或组合性质、资金规模等配备独立的股票投资经理。 二是建立防火墙机制，股票投资经理与基金投资经理在部门和岗位设置上相互独立，账户权限相互隔离；投资经理与交易人员在部门和岗位设置上相互独立；投资管理人员与风险控制、绩效评估人员之间在部门和岗位设置上相互独立；清算人员和核算人员在岗位设置上相互独立，上述人员均无相互兼任。 三是规范建设投资场所。公司建设了包括股票投资在内的投资场所（区域），并设置了满足物理隔离要求的集中交易室。 综合评估，公司建立了“结构合理、功能全面、分工明确、职责清晰、风险隔离”的股票投资管理组织架构，符合相关规定。 | | |
| 股票投资部门: | 1 | | |
| 部门名称 | 交易部 | | |
| 发文时间 | 2021-10-15 | 文件名称（含文号） | 《安联保险资产管理有限公司股票投资管理相关部门岗位职责规定》（安联资管人力〔2021〕50号） |
| 岗位设置: | 交易岗，部门负责人 | | |
| 2 | | | |
| 部门名称 | 信息技术部 | | |
| 发文时间 | 2021-10-15 | 文件名称（含文号） | 《安联保险资产管理有限公司股票投资管理相关部门岗位职责规定》（安联资管人力〔2021〕50号） |
| 岗位设置: | 系统支持岗，部门负责人 | | |

| | | | | |
|--------|--|-----------|---|--|
| 3 | 部门名称 | 权益投资部 | | |
| 发文时间 | 2021-10-15 | 文件名称（含文号） | 《安联保险资产管理有限公司股票投资管理相关部门岗位职责规定》（安联资管人力〔2021〕50号） | |
| 岗位设置： | 研究岗,股票投资经理岗,部门负责人 | | | |
| 4 | | | | |
| 部门名称 | 财务运营部 | | | |
| 发文时间 | 2021-10-15 | 文件名称（含文号） | 《安联保险资产管理有限公司股票投资管理相关部门岗位职责规定》（安联资管人力〔2021〕50号） | |
| 岗位设置： | 估值核算岗,清算岗,部门负责人 | | | |
| 5 | | | | |
| 部门名称 | 风险管理部 | | | |
| 发文时间 | 2021-10-15 | 文件名称（含文号） | 《安联保险资产管理有限公司股票投资管理相关部门岗位职责规定》（安联资管人力〔2021〕50号） | |
| 岗位设置： | 绩效评估岗,部门负责人,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>公司股票投资人员之间建立了防火墙机制，实行严格的业务分离制度，包括但不限于：</p> <ol style="list-style-type: none"> 股票投资经理与基金经理相互独立，不得兼任，账户和权限管理相互隔离； 投资部门与交易部门独立运作，投资经理与交易人员相互独立，不得兼任，投资下单与交易执行权限严格分离； 投资交易、风险管理和绩效评估部门分别独立运作，投资管理人员与风险控制、绩效评估人员之间相互独立，不得兼任； 清算人员与核算人员岗位设置相互独立，不得兼任。 <p>经合规评估，公司防火墙机制建设情况符合股票投资能力标准要求。</p> | | | |
| 评估结果： | 符合规定 | | | |
| 投资场所： | <p>投资场所及隔离情况符合规定。</p> <p>公司设置了满足投资需要且相对固定的股票投资场所（区域），集中交易室为物理隔离的独立空间，建立交易室行为准则，实施严格的门禁管理，交易时段大门全程关闭，非交易人员一律不得进入；集中交易室内安装摄像头，实时监控交易人员行为，交易室固定电话全程录音，即时通讯工具以及电子邮件全程监控并留痕，交易时段内集中交易人员通讯工具集中保管；交易业务使用特定电脑，且只能在公司的交易专用网络下使用。上述通讯资料和数据需保存五年。</p> | | | |
| 评估结果： | 符合规定 | | | |

三、专业队伍

| 整体评估情况： | <p>公司股票投资规模不超过10亿元，股票投资相关专业人员共15人，其中专职人员12人，具体包括股票投资经理3人、研究人员5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。</p> <p>从专业人员资质看，股票投资负责人具有13年股票投资管理经验及相关专业资质；股票投资经理具备3年以上股票投资管理经验或5年以上金融证券投资从业经验，具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>综合评估，上述股票投资管理专业队伍建设符合相关要求。</p> | | | | |
|-------------|--|-------|----------------|------------|--------|
| 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 | 林卉 | 交易岗 | 是 | 金融证券投资从业经验 | 10.85 |
| 2 | 颜茹云 | 交易岗 | 是 | 金融证券投资从业经验 | 3.32 |
| 3 | 周舟 | 系统支持岗 | 否 | 其他 | 8.72 |
| 4 | 曾劭 | 研究岗 | 是 | 行业研究经验 | 0.90 |

| | | | | | |
|----|-----|---------|---|------------|-------|
| 5 | 陈朝阳 | 研究岗 | 是 | 行业研究经验 | 2.23 |
| 6 | 边鑫 | 研究岗 | 是 | 行业研究经验 | 1.44 |
| 7 | 王鹏宇 | 研究岗 | 是 | 行业研究经验 | 3.55 |
| 8 | 尤汗青 | 研究岗 | 是 | 行业研究经验 | 6.54 |
| 9 | 耿耿 | 股票投资经理岗 | 是 | 金融证券投资从业经验 | 5.29 |
| 10 | 杜毅 | 股票投资经理岗 | 是 | 股票投资管理经验 | 13.31 |
| 11 | 汪鹏 | 股票投资经理岗 | 是 | 股票投资管理经验 | 4.43 |
| 12 | 曹懿 | 估值核算岗 | 否 | 其他 | 11.56 |
| 13 | 司梦 | 清算岗 | 是 | 其他 | 8.08 |
| 14 | 刘梦泽 | 绩效评估岗 | 否 | 其他 | 11.55 |
| 15 | 赵宇恒 | 风险管理岗 | 是 | 其他 | 7.20 |

四. 投资制度

整体评估情况:

公司通过印发《安联保险资产管理有限公司股票投资管理办法》等文件建立了股票投资基本制度、决策管理制度、研究管理制度、交易管理制度体系。

(一) 股票投资基本制度规定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、信息系统观管理、保密及危机处理等内容。

(二) 股票投资决策权限管理制度涵盖了投资决策体系、授权管理、实施与控制等内容。

(三) 股票研究管理相关制度涵盖了研究管理、股票池管理、交易单元管理等内容。

(四) 股票交易管理相关制度涵盖了集中交易、公平交易、交易权限管理和交易监控等内容。

上述制度会同公司全面风险管理制度、投资管理制度、财务管理制度、信息化工作管理制度等基本制度共同构成股票投资业务制度体系。

综合评估，公司股票投资管理能力相关制度规则符合相关要求。

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：《安联保险资产管理有限公司股票投资管理办法》， 发文文号：安联资管权益〔2021〕48号， 发文时间：2021-10-15； |
| 业务流程 | 符合规定 | 文件名称：《安联保险资产管理有限公司股票投资管理办法》， 发文文号：安联资管权益〔2021〕48号， 发文时间：2021-10-15； |
| 操作规程 | 符合规定 | 文件名称：《安联保险资产管理有限公司股票投资管理办法》， 发文文号：安联资管权益〔2021〕48号， 发文时间：2021-10-15； |
| 会议制度 | 符合规定 | 文件名称：《安联保险资产管理有限公司股票投资管理办法》， 发文文号：安联资管权益〔2021〕48号， 发文时间：2021-10-15； |
| 文档管理 | 符合规定 | 文件名称：《安联保险资产管理有限公司股票投资管理办法》， 发文文号：安联资管权益〔2021〕48号， 发文时间：2021-10-15； |
| 绩效考核 | 符合规定 | 文件名称：《安联保险资产管理有限公司股票投资管理办法》， 发文文号：安联资管权益〔2021〕48号， 发文时间：2021-10-15； 文件名称：《安联保险资产管理有限公司投资绩效评估管理制度》， 发文文号：安联资管风控〔2021〕46号， 发文时间：2021-10-15； |
| 清算与核算 | 符合规定 | 文件名称：《安联保险资产管理有限公司股票投资管理办法》， 发文文号：安联资管权益〔2021〕48号， 发文时间：2021-10-15； |

| | | |
|----------------|------|--|
| 信息系统管理 | 符合规定 | 文件名称：《安联保险资产管理有限公司股票投资管理办法》， 发文文号：安资管权益〔2021〕48号， 发文时间：2021-10-15； |
| 保密及危机处理 | 符合规定 | 文件名称：《安联保险资产管理有限公司股票投资管理办法》， 发文文号：安资管权益〔2021〕48号， 发文时间：2021-10-15； |
| 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：《安联保险资产管理有限公司股票投资决策管理办法》， 发文文号：安资管权益〔2021〕48号， 发文时间：2021-10-15； |
| 授权管理 | 符合规定 | 文件名称：《安联保险资产管理有限公司股票投资决策管理办法》， 发文文号：安资管权益〔2021〕48号， 发文时间：2021-10-15； |
| 实施与控制 | 符合规定 | 文件名称：《安联保险资产管理有限公司股票投资决策管理办法》， 发文文号：安资管权益〔2021〕48号， 发文时间：2021-10-15； |
| 研究管理制度： | | |
| 制度内容 | 评估结果 | 制度明细 |
| 研究管理办法 | 符合规定 | 文件名称：《安联保险资产管理有限公司股票研究管理办法》， 发文文号：安资管权益〔2021〕48号， 发文时间：2021-10-15； |
| 股票池管理办法 | 符合规定 | 文件名称：《安联保险资产管理有限公司股票池管理办法》， 发文文号：安资管权益〔2021〕48号， 发文时间：2021-10-15； |
| 交易单元管理办法 | 符合规定 | 文件名称：《安联保险资产管理有限公司交易量分配办法》， 发文文号：安资管交易〔2021〕47号， 发文时间：2021-10-15； 文件名称：《安联保险资产管理有限公司交易券商选择和评价管理办法》， 发文文号：安资管权益〔2021〕48号， 发文时间：2021-10-15； |
| 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：《安联保险资产管理有限公司交易权限管理办法》， 发文文号：安资管交易〔2021〕47号， 发文时间：2021-10-15； |
| 交易权限管理 | 符合规定 | 文件名称：《安联保险资产管理有限公司交易权限管理办法》， 发文文号：安资管交易〔2021〕47号， 发文时间：2021-10-15； |
| 公平交易 | 符合规定 | 文件名称：《安联保险资产管理有限公司公平交易管理实施细则》， 发文文号：安资管风控〔2021〕21号， 发文时间：2021-08-26； |
| 交易监控 | 符合规定 | 文件名称：《安联保险资产管理有限公司交易权限管理办法》， 发文文号：安资管交易〔2021〕47号， 发文时间：2021-10-15； |

五. 系统建设

整体评估情况：

安联保险资产管理有限公司建设了功能齐备的股票投资相关信息系统，包括：研究分析系统、信息资讯系统、交易管理系统、资产估值和核算系统等。交易管理系统采购了恒生投资交易管理系统，该系统具备授权管理、合规控制和交易功能，并能提供覆盖前、中、后台的风险控制与管理功能，能对投资组合进行实时监控与管控；研究分析系统采取内部开发模式，形成了以资产配置、行业配置为模型的投资分析系统；资讯系统包括万德、彭博、聚源等主流研究资讯系统，同时公司获得了多家券商研究服务支持；公司的资产估值和核算系统为恒生的资产估值与会计核算系统，该系统具备安全、高效的清算交割、财务核算等功能，能够每日进行清算和估值，实现报表自动生成等。

经评估，公司股票投资信息技术系统建设符合《保险机构股票投资管理能力标准》的规定。

交易管理系统：

| | | | |
|------|--|------|------|
| 系统名称 | 投资交易系统 | | |
| 上线时间 | 2021-08-17 | 评估结果 | 符合规定 |
| 主要功能 | 投资交易管理系统是公司日常投资工作开展使用的核心应用系统，具备授权管理、合规控制和交易等核心功能。 系统支持的业务类型，包括交易所业务、银行间业务、开放式基金业务、网下申购业务、存款业务等。 通过交易管理系统可以方便的建立投资组合，快速下达指令、委托。 系统具备完善的授权管理和合规风控管理功能，通过嵌入风控规则，进行有效的风险管理及合规控制。 系统丰富的信息查询功能可以对投资信息进行多维度的查询。 | | |

信息资讯系统：

| | | | |
|------|---|------|------|
| 系统名称 | 聚源、万得、彭博 | | |
| 上线时间 | 2021-08-17 | 评估结果 | 符合规定 |
| 主要功能 | 信息资讯系统集成聚源、万得、彭博等多家终端，为股票投资业务提供全面、准确的数据、资讯信息，并获得多家头部券商研究服务支持。 | | |

研究分析系统：

| | | | |
|------|---|------|------|
| 系统名称 | iCube研究分析系统 | | |
| 上线时间 | 2021-10-14 | 评估结果 | 符合规定 |
| 主要功能 | iCube研究分析系统（原名i-Connect）为公司自主开发，主要功能： 一是资产配置模型，能够根据配置建议、负债现金流状况、风险约束、市场预期等多方面因素，对投资组合进行规划，模拟包含投资收益、久期差在内的多维度配置结果。 二是行业配置模型：能够从行业景气度和行业动量等多方面因素进行行业轮动。 三是个股估值模型：通过常用估值指标如PE、PB、PS等对股票进行估值，通过对时间序列和同行业标的进行分析，对估值合理性进行判断。研究报告系统采购聚源研报系统，支持研究员使用系统撰写相关研报并存档。 | | |

资产估值和核算系统：

| | | | |
|------|---|------|------|
| 系统名称 | 资产估值与会计核算系统 | | |
| 上线时间 | 2021-08-17 | 评估结果 | 符合规定 |
| 主要功能 | 资产估值与会计核算系统是对投资运营情况进行会计核算的管理系统，具备安全高效的清算交割、财务核算功能，支持每日清算估值和自动报表功能。 系统主要实现对资金交易的清算交割、做账功能，集成资讯、投资交易及后台管理系统的接口文件进行清算，清算结果自动生成财务凭证，最后生成各种报表完成最后资产的估值。 | | |

六. 风险控制

整体评估情况：

安联保险资产管理有限公司建立由董事会负最终责任、监事有效监督、总经理全面负责的全面风险管理架构。在全面风险管理目标指导下，公司建立风险管理三道防线，其中包括：一线部门及岗位人员自我控制、自我管理、自我约束为基础的第一道监控防线；发挥法律合规、风险管理、财务运营等部门对公司全流程的风险监控，相关部门、相关岗位之间相互监督制衡的第二道监控防线，以内部审计对各岗位、部门、机构和业务实施监督反馈的第三道监控防线。通过合理的风险管理组织架构、健全的风险管理指标、高效的风险管理模型系统、深度的绩效考核体系、独立于投资管理的报告制度等，完成针对投资业务事前控制、事中监督、事后评价全流程的覆盖。

经评估，公司风险管理体系符合《保险机构股票投资管理能力标准》的相关要求。

压力测试系统：

| | | | |
|------|--|------|------|
| 系统名称 | 投资绩效评估与风险管理系统 | | |
| 上线时间 | 2021-08-17 | 评估结果 | 符合规定 |
| 主要功能 | 恒生投资绩效评估与风险管理系统V3.0具备压力测试功能模块，支持对股票仓位、行业集中度、个股集中度等指标的压力测试功能，并基于不同的压力情景评估对投资组合产生的影响，以此制定相应的应急预案形成有效支持。经评估，符合《保险机构股票投资管理能力标准》相关要求。 | | |

风险管理系统：

| | | | |
|------|--|------|------|
| 系统名称 | 投资绩效评估与风险管理系统 | | |
| 上线时间 | 2021-08-17 | 评估结果 | 符合规定 |
| 主要功能 | 风险管理系统采用恒生的投资绩效评估与风险管理系统V3.0以及投资管理系统风险控制模块，能够支持对投资组合进行风险预警、合规监控及限额管理，支持对资产数据的查询与分析，支持对组合风险与组合绩效的分析与评估，同时可以按照要求生成相应的各类监管报表等。经评估，符合《保险机构股票投资管理能力标准》相关要求。 | | |

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。