

信泰人寿保险股份有限公司股票投资管理能力建设及 自评估情况 (年度披露-【20230128】)

一、风险责任人

风险责任人	姓名	职务	风险责任人基本信息
行政责任人	谭宁	董事长	信泰人寿保险股份有限公司关于股票投资人的风险管理的基本信息披露公告.pdf
专业责任人	余跃年	总精算师	信泰人寿保险股份有限公司关于股票投资人的风险管理的基本信息披露公告.pdf

二、组织架构

整体评估情况
<p>公司建立健全的合规管理体系，遵循资产管理的独立性、流动性、安全性、投资回报率、流动性、投资组织架构图，明确了公司董事会、股东大会、董事、监事、高级管理人员、投资经理、风控、清算、核算等岗位职责，建立了股票投资、交易、清算、核算、风险管理等岗位分离、信息隔离、权限隔离、配置独立监控设备、配置独立股票投资管理能力标准。</p>

资产管理部门设置		
部门名称	资产管理中心	
股票投资部门 (团队)	发文时间	2021-01-20
	发文文号	信泰发〔2021〕27号、信泰人聘〔2021〕5号、信泰人聘〔2022〕14号
	文件名称	《信泰人寿保险股份有限公司关于明确资产管理中心组织架构及职责的通知》、《关于梁奉等人任职的通知》、《关于李杰等人任免的通知》
	岗位设置	投资经理、主要研究员、研究员、交易员、风险管理岗（负责股票投资的绩效评估相关工作）、资金清算岗、估值核算岗、系统管理岗，同时根据账户/组合性质、管理资金规模等，配备独立的股票投资经理。

	投资经理	设股票投资经理（不少于3人）、基金投资经理（不少于1人），同时根据账户/组合性质、管理资金规模等，配备独立的股票投资经理。符合“保险机构股票投资能力标准”中直接投资股票投资管理能力的相关要求。
	投资场所	公司设立独立的集中交易室，与公司其他办公区域完全隔离，集中交易室配置独立监控设备、独立指纹锁等设备，非交易员未经审批不得入内。
	防火墙机制	公司实行“投研一体化”管理模式，投资、研究、交易等岗位人员专岗，从人员、隔离、岗位隔离、权限隔离、报告管理机制、包括但不仅限于股票投资经理与基金经理之间、风险控制及绩效评估人员与清算人员与核算人员完全隔离，集中交易室与办公区域完全隔离，配置独立监控设备、独立指纹锁等岗位的设备，非交易员未经审批不得入内。公司各部门权限，隔离人员在各自投资系统中均配置了不同的权限，由风险控制部具体执行，各部门负责人汇报工作，独立考核，防火墙机制符合“保险机构股票投资管理能力标准”中直接投资股票投资管理能力的相关要求。

三、专业队伍

整体评估情况	公司已组建了专业的股票投资团队，实行“投研一体化”管理模式，股票投资团队共配备了16名熟悉股票投资业务专职人员，其中投资经理4人，研究人员6人（主要研究人员2人），交易人员3人，风控人员2人，清算人员1人。其中，股票投资部负责人具有10年以上金融证券从业经验及股票投资管理经验，具有证券从业资格、基金从业资格和期货从业资格等专业资质；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验的投资经理4名，均具有良好的业绩表现；主要研究人员均具有7年以上行业研究经验，研究行业覆盖军工、新能源、光伏、食品饮料、医药、消费电子、化工、建筑建材、轻工制造、家电、传媒、农林牧业等；风控人员均具备多年保险投资风险管理经验。相关专业人员从业经历达到要求。目前，股票投资团队具备较为专业的投资能力，并且可以对交易和投后过程中的各类风险进行有效识别和管控。投资、研究、交易人员与其他投资业务严格隔离。公司股票投资的专业团队符合“保险机构股票投资管理能力标准”中直接投资股票投资管理能力的相关要求。
--------	--

股票投资规模	超过10亿元
--------	--------

专业队伍人员基本信息

3-1、投资经理4名，研究人员6名（主要研究人员2名）

序号	姓名	岗位	相关经验类型	经验年限(年)	是否兼职
1	梁奉	股票投资部负责人	股票投资管理经 验	12	否

股票投资岗位职责	
制度明细一	
文件名称	《信泰人寿保险股份有限公司股票投资管理办法》 (2020修订版)
发文文号	信泰发〔2020〕527号
发文时间	2020-12-21
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	《信泰人寿保险股份有限公司基金投资管理实施细则》
发文文号	信泰发〔2021〕611号
发文时间	2021-12-23
评估结果	符合规定
业务流程	
制度明细一	
文件名称	《信泰人寿保险股份有限公司股票投资管理办法》 (2020修订版)
发文文号	信泰发〔2020〕527号
发文时间	2020-12-21
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	《信泰人寿保险股份有限公司基金投资管理实施细则》 (2021修订版)
发文文号	信泰发〔2021〕611号
发文时间	2021-12-23
评估结果	符合规定
操作规程	
制度明细	
文件名称	《信泰人寿保险股份有限公司股票投资管理办法》 (2020修订版)
发文文号	信泰发〔2020〕527号
发文时间	2020-12-21
评估结果	符合规定
会议制度	
制度明细	
文件名称	《信泰人寿保险股份有限公司股票投资管理办法》 (2020修订版)
发文文号	信泰发〔2020〕527号
发文时间	2020-12-21
评估结果	符合规定
文档管理	
制度明细一	
文件名称	《信泰人寿保险股份有限公司档案管理办法》 (2019)版》
发文文号	信泰发〔2019〕216号
发文时间	2019-02-22

评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	《信泰人寿保险股份有限公司股票投资管理办法》 (2020修订版)
发文文号	信泰发〔2020〕527号
发文时间	2020-12-21
评估结果	符合规定
制度明细三	
文件名称	《信泰人寿保险股份有限公司基金投资管理实施细则》 (2021修订版)
发文文号	信泰发〔2021〕611号
发文时间	2021-12-23
评估结果	符合规定
绩效考核	
制度明细一	
文件名称	《信泰人寿保险股份有限公司资金运用绩效考核管理办法》
发文文号	信泰发〔2019〕574号
发文时间	2019-08-12
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	《信泰人寿保险股份有限公司股票投资管理办法》 (2020修订版)
发文文号	信泰发〔2020〕527号
发文时间	2020-12-21
评估结果	符合规定
清算与核算	
制度明细一	
文件名称	《信泰人寿保险股份有限公司资产管理中心资金清算管理办法》
发文文号	信泰发〔2020〕491号
发文时间	2020-12-12
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	《信泰人寿保险股份有限公司投资资产会计核算办法》
发文文号	信泰发〔2021〕627号
发文时间	2021-12-28
评估结果	符合规定
信息系统管理	
制度明细	
文件名称	《信泰人寿保险股份有限公司资金运用信息系统管理办法》 (2021修订)
发文文号	信泰发〔2021〕625号
发文时间	2021-12-28
评估结果	符合规定

保密及危机处理	
制度明细一	
文件名称	《信泰人寿保险股份有限公司股票、权益类基金投资风险管理制度实施细则》
发文文号	信泰发〔2020〕527号
发文时间	2020-12-21
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	《信泰人寿保险股份有限公司集中交易管理办法》
发文文号	信泰发〔2020〕500号
发文时间	2020-12-16
评估结果	符合规定
制度明细三	
文件名称	《信泰人寿保险股份有限公司投资管理人员行为规范管理办法（2022版）》
发文文号	信泰发〔2022〕571号
发文时间	2022-11-17
评估结果	符合规定
制度明细四	
文件名称	《信泰人寿保险股份有限公司股票投资相关人员行为规范管理实施细则》
发文文号	信泰发〔2020〕283号
发文时间	2020-07-29
评估结果	符合规定

决策管理制度

投资决策体系	
制度明细	
文件名称	《信泰人寿保险股份有限公司股票及基金投资授权审批管理实施细则》
发文文号	信泰发〔2021〕613号
发文时间	2021-12-23
评估结果	符合规定
授权管理	
制度明细一	
文件名称	《信泰人寿保险股份有限公司投资授权审批管理办法（2022版）》
发文文号	信泰发〔2022〕410号
发文时间	2022-07-28
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	《信泰人寿保险股份有限公司股票及基金投资授权审批管理实施细则》（2021修订）
发文文号	信泰发〔2021〕613号
发文时间	2021-12-23
评估结果	符合规定

实施与控制	
制度明细一	
文件名称	《信泰人寿保险股份有限公司股票投资管理办法》 (2020修订版)
发文文号	信泰发〔2020〕527号
发文时间	2020-12-21
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	《信泰人寿保险股份有限公司股票及基金投资授权审批管理实施细则》(2021修订)
发文文号	信泰发〔2021〕613号
发文时间	2021-12-23
评估结果	符合规定
其他(非必填)	
制度明细	
文件名称	《信泰人寿保险股份有限公司新股投资管理实施细则》 (2021修订)
发文文号	信泰发〔2021〕612号
发文时间	2021-12-23
评估结果	符合规定

研究管理制度	
研究管理办法	
制度明细一	
文件名称	《信泰人寿保险股份有限公司投资研究管理办法》 (2020修订)
发文文号	信泰发〔2020〕507号
发文时间	2020-12-21
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	《信泰人寿保险股份有限公司标准化产品投资研究细则》 (2020修订)
发文文号	信泰发〔2020〕507号
发文时间	2020-12-21
评估结果	符合规定
股票池管理办法	
制度明细一	
文件名称	《信泰人寿保险股份有限公司股票投资池管理实施细则》
发文文号	信泰发〔2020〕406号
发文时间	2020-10-20
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	《信泰人寿保险股份有限公司基金投资池管理实施细则》
发文文号	信泰发〔2020〕527号
发文时间	2020-12-21

评估结果	符合规定
交易单元管理办法	
制度明细	
文件名称	《信泰人寿保险股份有限公司交易单元管理实施细则》
发文文号	信泰发〔2019〕513号
发文时间	2019-07-15
评估结果	符合规定
其他（非必填）	
制度明细	
文件名称	《信泰人寿保险股份有限公司资金运用问责与责任追究管理办法》
发文文号	信泰发〔2020〕528号
发文时间	2020-12-21
评估结果	符合规定

交易管理制度	
集中交易	
制度明细	
文件名称	《信泰人寿保险股份有限公司集中交易管理办法》
发文文号	信泰发〔2020〕500号
发文时间	2020-12-16
评估结果	符合规定
公平交易	
制度明细	
文件名称	《信泰人寿保险股份有限公司公平交易管理办法》
发文文号	信泰发〔2020〕500号
发文时间	2020-12-16
评估结果	符合规定
交易权限管理	
制度明细	
文件名称	《信泰人寿保险股份有限公司集中交易管理办法》
发文文号	信泰发〔2020〕500号
发文时间	2020-12-16
评估结果	符合规定
交易监控	
制度明细一	
文件名称	《信泰人寿保险股份有限公司集中交易管理办法》
发文文号	信泰发〔2020〕500号
发文时间	2020-12-16
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	《信泰人寿保险股份有限公司公平交易管理办法》
发文文号	信泰发〔2020〕500号
发文时间	2020-12-16

评估结果	符合规定
------	------

五、系统建设

整体评估情况

我司已采购恒生投资管理交易系统软件VO3.2、HUNDSUN资产估值与会计核算系统软件V2.6、HUNDSUN投资绩效评估与风险管理系统软件V3.0、以及HUNDSUN保监会报送报表系统软件V3.0、携宁投资研究管理平台软件V3.3，足股票投资的业务投前、投中、投后的监管要求和内部管理需求。具体支持股票业务的研究分析、入池、审批、投资池管理、交易审批、交易执行、清算管理、估值核算、持仓管理、合规比例监控、限额管理、投资收益分析等功能。上述系统全面实现自动对接，运行情况良好。确保公司的股票投资业务全程均通过系统进行管控及监测，并设定严格的风险管理的指标、流程及权限，未经系统审批的投融资流程无法开展，是投资交易的必要工具。同时，在信息系统方面，我司分别采购了万得和财汇资讯终端，资讯信息及时、准确，为投资决策及风险管理工作中提供信息支持，满足标准规定。符合“保险机构股票投资管理能力的直接投资股票投资管理能力的有关要求”。

研究分析系统

系统名称	上线时间	评估结果
携宁投资研究管理平台软件V3.3	2021-01-25	符合规定

主要功能

主要包括内部研究报告、外部研报管理（含研报整理服务）、资产配置模型、行业配置模型、个股估值模型、管理组合策略、投资池管理、工单操作平台、机构打分等模块，支持流程化制定与审批；支持财汇资讯数据接口，并支持投资池自动导出至交易系统，支持投资池校验和提醒功能；实现了移动的办公APP审批功能，包括内外部研报、投资池的查看及审批，市场新闻的查看等。资产配置模块主要基于大类资产、行业的评分模型，进行定期评价。同时以大类资产配置模型、行业配置模型定期进阶资产配置结果计算，给投资研究提供辅助。评分模型、资产配置模型、行业配置模型等模型指标都可以基于公司的研究体系进行灵活扩展和调整，以满足业务的发展及研究方法论的优化迭代；个股估值模型提供多种估值方式，评估股票内在价值，提供一套符合财务勾稽关系的报表体系，满足大部分的市场需求，便于研究人员对上市公司进行分析和预测。携宁投资研究管理平台软件V3.3功能主要包括金融数据中心、晨会管理、研究报告管理、公司行业研究、投资池、投资组合、行业/股票分管、股票研究成果管理、考核管理、系统管理等多个功能模块，研究报告管理主要功能包括研究报告的编写、提交、评审、修改和入库，报告入库后可以报告进行多条件组合检索、研究报告阅读、研究报告统计等。内部研究报告支持的类型有公司类、行业类、通用类、债券类等报告类型，并且对报告的可以设置不同的权限，如查看、撰写、下载原文、下载PDF。符合“保险机构股票投资管理能力的直接投资股票投资管理能力的有关要求”。

信息资讯系统

系统名称	上线时间	评估结果
Wind金融终端	2014-12-08	符合规定
大智慧大数据终端	2018-03-01	符合规定

主要功能

主要包含内部研究报告、外部研报管理（含研报整理服务）、资产配置模型、行业配置模型、个股估值模型、管理组策略、投资池管理、数据平台、机构支持、移动办公APP审批功能，包括内外部研报、投资池的查看及审批；实现了新闻配置模型、行业配置模型、以及个股估值模型管理。资产配置模型、行业配置模型、资产配置模型、进行定期评价。同时以大类资产配置模型、行业配置模型、资产配置模型等模型指标都可进行研究提供基于公司的研究体系，进行灵活扩展和调整，以满足业务的发展及研究方便论的优化迭代；个股估值模型提供多种估值方式，评估股票内在价值，提供一套符合财务勾稽关系的报表体系，满足大部分的市场需求，便于研究人员对上市公司进行分析预测。携宁投资研究管理平台软件V3.3功能主要包括金融数据中心、晨会管理、研究报告管理、公司行业研究、投资池、投资组合、行业/股票分管、股票研究成果管理、考核管理、系统管理等多个功能模块，研究报告管理主要功能包括研究报告的编写、提交、评审、修改和入库，报告入库后可以对报告进行多条组合检索、研究报告阅读、研究报告统计等。内部研究报告支持的类型有公司类、行业类、通用类、债券类等报告类型，并且对报告的可以设置不同的权限，如查看、撰写、下载原文、下载PDF。符合“保险机构股票投资管理标准”中直接投资股票的投资管理能力的要求。

交易管理系统		
系统名称	上线时间	评估结果
恒生投资交易管理系统软件VO3.2	2012-05-31	符合规定
主要功能		
<p>我司于2012年4月采购了恒生投资交易管理系统软件VO3.2，后续陆续补充了相关的业务模块，满足监管标准。截止目前，系统功能上支持我司开展所需要的投资流程管理、风险管理、基础数据管理、权限管理、交易接口、以及清算管理等。系统支持通过设置投资流程、设定风控阈值、布置投资池等方式，自动化进行授权管理的实现对应权限审批，通过投资池及风控阈值等方式实现合规控制。支持的交易功能包括交易所股票、基金、债券的买卖交易，交易所质押式回购，银行间市场的债券买卖与质押式回购，场外开放式基金申赎投资，银行的定期/通知存款业务、科创板、创业板、港股通等业务；支持网下申购、大宗交易、协议平台、固收平台、新股申购等业务模式；非标准化资产的管理单独采购了非标资产管理系统软件V2.0。符合“保险机构股票投资管理标准”中直接投资股票的投资管理能力的要求。</p>		

资产估值和核算系统		
系统名称	上线时间	评估结果
HUNDSUN资产估值与会计核算系统软件V2.6	2012-05-31	符合规定
主要功能		

<p>风险管理系统</p>	<p>公司已建立覆盖事前控制、事中监督、事后评价的风险管理系统软件VO3.2及HUNDSUN投资绩效评估与风险管理系统。其中，恒生投资交易系统软件VO3.2包含合规和管理、指标管理、阈值管理等功能，结合监管要求和公司需要设置投资相关指标，通过系统并对其进行计算、预警和追踪，从风险控制与合规管理的角度对投资组合进行监测和预警，投资交易均通过合规性审核后方可进行。投资绩效评估与风险管理系具有资产分析、组合查询、组合风险、组合绩效、组合管理等功，能够对资金运用的持仓结构、流动性风险、压力测试等进行计量与分析。公司风险管理系统符合“保险机构股票投资管理能力标准”中直接投资股票的投资管理能力的相</p>
<p>压力测试系统</p>	<p>公司已建立覆盖事前控制、事中监督、事后评价的风险管理系统。HUNDSUN投资绩效评估与风险管理系具有资产分析、组合查询、组合风险、组合绩效、组合管理等功，能够对资金运用的持仓结构、流动性风险、压力测试等进行计量与分析。可以对股票持仓位、行业集中度、个股集中度进行压力测试，评估投资组合产生的影响，风险管理等职能部门依据压力测试结果及实际市场情况制定相应应急预案。公司包含压力测试的系统符合“保险机构股票投资管理能力标准”中直接投资股票的投资管理能力的相</p>

自评估结果及承诺

根据《关于优化保险机构投资管理能力和监管有关事项的通知》及相关监管规定，我对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。