

生命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（半年度披露-20210130）

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：	李荣辉	职务：	总经理
专业责任人：	贾殿村	职务：	权益投资部总经理
类别：	授权的相关资产管理部门负责人		

二、组织架构

整体评估情况：			
<p>公司设有独立的权益投资部，负责股票的投资及研究工作。同时设有独立的交易部，负责股票交易。公司的风险合规部、组合管理部、运营管理部、信息技术部分别设置相关岗位进行股票投资的风险控制、绩效评估、清算、核算以及系统支持。公司研究、投资、交易岗位实行专人专岗，与其他投资业务严格分离。公司下发《关于印发公司部门“四定”方案的通知》（生保资发【2021】14号）明确设立权益投资部，并在发文中明确权益投资部的部门职责、岗位职责及人员配置等。公司下发《关于贾殿村任职的通知》（生保资发【2017】9号）明确了权益投资部的部门负责人。</p> <p>公司根据账户或组合性质，配备独立的股票投资经理，且为有效隔离和防范股票投资风险及利益冲突，在股票投资经理与基金投资经理、投资经理与交易人员、投资管理人员与风险控制人员、投资管理人员与绩效评估人员、清算人员与核算人员等相应职能岗位之间建立了有效的防火墙机制。此外，公司设置独立的交易办公场所，能够确保集中交易办公区域完全隔离。</p>			
股票投资部门：			
1			
部门名称	交易部		
发文时间	2021-01-29	文件名称（含文号）	《关于印发公司部门“四定”方案的通知》生保资发【2021】14号
岗位设置：	场内交易员		
2			
部门名称	信息技术部		
发文时间	2021-01-29	文件名称（含文号）	《关于印发公司部门“四定”方案的通知》生保资发【2021】14号
岗位设置：	系统管理岗		
3			
部门名称	权益投资部		
发文时间	2021-01-29	文件名称（含文号）	《关于印发公司部门“四定”方案的通知》生保资发【2021】14号
岗位设置：	投资经理,研究员		
4			
部门名称	组合管理部		
发文时间	2021-01-29	文件名称（含文号）	《关于印发公司部门“四定”方案的通知》生保资发【2021】14号
岗位设置：	绩效分析岗		
5			
部门名称	运营管理部		
发文时间	2021-01-29	文件名称（含文号）	《关于印发公司部门“四定”方案的通知》生保资发【2021】14号

岗位设置:	估值核算岗,资金清算岗		
6			
部门名称	风险合规部		
发文时间	2021-01-29	文件名称(含文号)	《关于印发公司部门“四定”方案的通知》生保资发【2021】14号
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:	公司根据账户或组合性质,配备独立的股票投资经理,且为有效隔离和防范股票投资风险及利益冲突,在股票投资经理与基金投资经理、投资经理与交易人员、投资管理人员与风险控制人员、投资管理人员与绩效评估人员、清算人员与核算人员等相应职能岗位之间建立了有效的防火墙机制。		
投资场所:	公司设置独立的交易办公场所,能够确保集中交易办公区域完全隔离。		

三、专业队伍

整体评估情况:					
目前公司股票投资专职人员数量总计21人。其中:投资经理4人,研究员6人,交易员3人,风险控制人员1人,清算及核算人员4人,绩效评估人员1人、系统支持人员2人。股票投资负责人具有11年股票投资管理经验,投资经理均具有3年以上股票投资管理经验,研究员有4人从事行业研究3年以上。经自评,公司股票投资专业队伍建设符合监管标准规定。					
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	吴镇宇	场内交易员	否	交易员	8.75
2	邹壮锋	场内交易员	否	交易员	10.42
3	苏佳琦	场内交易员	否	交易员	5.58
4	周万里	系统管理岗	否	系统管理	10.33
5	张军	系统管理岗	否	系统管理	10.75
6	丁丹	投资经理	否	股票投资管理经验	6.08
7	徐雄晖	投资经理	否	股票投资管理经验	11.49
8	谭平	投资经理	否	股票投资管理经验	9.50
9	贾殿村	投资经理	否	股票投资管理经验	10.67
10	卢森堡	研究员	否	行业研究经验	9.67
11	刘威	研究员	否	行业研究经验	5.92
12	舒强	研究员	否	行业研究经验	5.66
13	李燕玲	研究员	否	行业研究经验	6.58
14	陈启航	研究员	否	行业研究经验	2.08
15	何佳天	研究员	否	行业研究经验	0.75
16	宋小军	绩效分析岗	否	绩效评估	2.66
17	杨海澜	估值核算岗	否	估值核算	3.92
18	黄茂秋	估值核算岗	否	估值核算	5.75
19	黄浩文	资金清算岗	否	资金清算	5.67
20	罗静云	资金清算岗	否	资金清算	3.99
21	袁泽燕	风险管理岗	否	风险合规	3.49

四. 投资制度

整体评估情况:

公司建立了完善、有效的股票投资管理相关制度，包括股票投资制度、决策管理制度、研究管理制度、交易管理制度、绩效考核制度、清算核算制度、档案管理制度、风险应急管理制度等，并以公司正式文件形式下发执行。

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：生命保险资产管理有限公司股票投资管理办法， 发文字号：生保资发【2020】38号， 发文时间：2020-06-16；
绩效考核	符合规定	文件名称：生命保险资产管理有限公司薪酬与绩效管理 办法， 发文字号：生保资发【2016】29号， 发文时间：2016-05-05；
清算与核算	符合规定	文件名称：生命保险资产管理有限公司受托资产会计 核算办法， 发文字号：生保资发【2017】74号， 发文时间：2017-09-19； 文件名称：生命保险资产管理有限公司受托资金清算 管理办法， 发文字号：生保资发【2019】42号， 发文时间：2019-08-26；
文档管理	符合规定	文件名称：生命保险资产管理有限公司档案管理办法， 发文字号：生保资发【2018】59号， 发文时间：2018-11-19；
操作规程	符合规定	文件名称：生命保险资产管理有限公司股票投资管理 办法， 发文字号：生保资发【2020】38号， 发文时间：2020-06-16；
信息系统管理	符合规定	文件名称：生命保险资产管理有限公司投资业务信息 系统管理办法， 发文字号：生保资发【2018】40号， 发文时间：2018-08-02；
保密及危机处理	符合规定	文件名称：生命保险资产管理有限公司股票投资风险 事件应急预案实施细则， 发文字号：生保资发【2019】62号， 发文时间：2019-11-27； 文件名称：生命保险资产管理有限公司防火墙管理办 法， 发文字号：生保资发【2017】49号， 发文时间：2017-09-01； 文件名称：生命保险资产管理有限公司重大突发事件 应急预案实施规范， 发文字号：生保资发【2020】70号， 发文时间：2020-11-04； 文件名称：生命保险资产管理有限公司突发事件应急 管理办法， 发文字号：生保资发【2020】6号， 发文时间：2020-01-07；
会议制度	符合规定	文件名称：生命保险资产管理有限公司权益投资研究 管理办法， 发文字号：生保资发【2018】79号， 发文时间：2018-12-17；
业务流程	符合规定	文件名称：生命保险资产管理有限公司股票投资管理 办法， 发文字号：生保资发【2020】38号， 发文时间：2020-06-16；

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：生命保险资产管理有限公司投资交易授权 管理办法， 发文字号：生保资发【2021】13号， 发文时间：2019-04-19；
投资决策体系	符合规定	文件名称：生命保险资产管理有限公司投资审核委员 会资产配置专业委员会工作细则， 发文字号：生保资发【2019】21号， 发文时间：2019-04-19；

实施与控制	符合规定	文件名称：生命保险资产管理有限公司投资组合管理办法， 发文字号：生保资发【2019】22号， 发文时间：2019-04-19；
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：生命保险资产管理有限公司港股股票库管理办法， 发文字号：生保资发【2020】37号， 发文时间：2020-06-16； 文件名称：生命保险资产管理有限公司人民币普通股股票库管理办法， 发文字号：生保资发【2020】40号， 发文时间：2020-06-19；
研究管理办法	符合规定	文件名称：生命保险资产管理有限公司权益投资研究管理办法， 发文字号：生保资发【2018】79号， 发文时间：2018-12-17；
交易单元管理办法	符合规定	文件名称：生命保险资产管理有限公司服务券商管理办法， 发文字号：生保资发【2020】36号， 发文时间：2020-06-16；
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：生命保险资产管理有限公司公平交易管理办法， 发文字号：生保资发【2013】158号， 发文时间：2013-12-09； 文件名称：生命保险资产管理有限公司证券交易管理办法， 发文字号：生保资发【2020】80号， 发文时间：2021-01-05；
公平交易	符合规定	文件名称：生命保险资产管理有限公司公平交易管理办法， 发文字号：生保资发【2013】158号， 发文时间：2013-12-09； 文件名称：生命保险资产管理有限公司证券交易管理办法， 发文字号：生保资发【2020】80号， 发文时间：2021-01-05；
交易监控	符合规定	文件名称：生命保险资产管理有限公司公平交易管理办法， 发文字号：生保资发【2013】158号， 发文时间：2013-12-09； 文件名称：生命保险资产管理有限公司证券交易管理办法， 发文字号：生保资发【2020】80号， 发文时间：2021-01-05；
交易权限管理	符合规定	文件名称：生命保险资产管理有限公司公平交易管理办法， 发文字号：生保资发【2013】158号， 发文时间：2013-12-09； 文件名称：生命保险资产管理有限公司证券交易管理办法， 发文字号：生保资发【2020】80号， 发文时间：2021-01-05；

五. 系统建设

整体评估情况：
公司股票投资相关系统包括恒生投资交易系统、恒生估值系统、携宁投研系统、万得资讯系统、同花顺资讯系统等。其中恒生投资交易系统具备授权管理、合规控制和交易功能等；恒生估值系统具备安全、高效的清算交割、财务核算功能，能够每日进行清算和估值，实现报表自动生成等；携宁投研系统具备内部研究报告管理、股票库管理等功能；万得资讯系统和同花顺资讯系统获得多家券商研究服务支持，且具备资产配置模型、行业配置模型、个股估值模型等功能。经自评估，公司股票投资信息系统符合监管标准规定。
交易管理系统：

系统名称	恒生投资交易管理系统软件 V03.2		
上线时间	2011-01-01	评估结果	符合规定
主要功能	涵盖了授权管理、合规控制和交易功能等多项投资交易权限。		
信息资讯系统：			
系统名称	万得金融终端、同花顺IFIND金融数据终端		
上线时间	2011-01-01	评估结果	符合规定
主要功能	包括2种研究资讯系统，线上、线下获得多家券商研究支持服务。		
研究分析系统：			
系统名称	携宁投研管理平台SIRM、万得金融终端		
上线时间	2014-01-01	评估结果	符合规定
主要功能	研究分析系统包括资产配置模型、行业配置模型、个股估值模型、内部研究报告系统等相关功能。		
资产估值和核算系统：			
系统名称	恒生资产估值与会计核算系统软件企业版 V2.6		
上线时间	2011-01-01	评估结果	符合规定
主要功能	具备安全、高效的清算交割、财务核算系统，每日可进行清算和估值，实现报表自动生成等功能。		

六. 风险控制

整体评估情况：			
公司股票投资风险管理制度包括《生命保险资产管理有限公司全面风险管理办法》、《生命保险资产管理有限公司市场风险管理办法》、《生命保险资产管理有限公司风险事件责任追究管理办法》、《生命保险资产管理有限公司2020年度风险管理考核方案》等，包括风险管理原则和制度要求、风险管理组织体系、风险管理量、风险点与风险控制、风险流程管理、风险责任追究机制及绩效评估等相关内容。公司股票投资、风险管理系统包括恒生风险管理与绩效评估系统、金贝塔探雷工兵系统等，其中恒生风险管理与绩效评估系统包含了压力测试功能，可对股票仓位、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，金贝塔探雷工兵系统具备股票预警功能，并以此制定相应的应急预案。经自评，公司股票投资风险控制体系符合监管标准规定。			
压力测试系统：			
系统名称	恒生投资绩效评估与风险管理系统软件 V3.0		
上线时间	2011-01-01	评估结果	符合规定
主要功能	具备对股票仓位、行业集中度、个股集中度进行压力测试能力，评估投资组合产生的影响，并已制定了相应的应急预案		
风险管理系统：			
系统名称	恒生投资绩效评估与风险管理系统软件 V3.0		
上线时间	2011-01-01	评估结果	符合规定
主要功能	包括风险预警与合规管理系统、绩效评估系统等功能		

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。