

# 交银康联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-20210727）

## 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:	张宏良	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:	1966-11
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:	董事会	行政责任人入司时间:	2019-06-18
行政责任人专业资质:	金融工作10年以上工作经历	行政责任人专业技术职务:	高级经济师
专业责任人:	陈建新	职务:	权益业务总监
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:	男	专业责任人出生年月:	1983-01
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:	2019-06-18	专业责任人所在部门:	股票与基金投资部
专业责任人专业资质:	股票投资领域10年以上从业经历	专业责任人专业技术职务:	无

## 二、组织架构

整体评估情况:			
按照《保险机构股票投资管理标准》相关要求, 我司从五个方面进行自评: 1、我司通过《关于调整部分部门职责的通知》(交银康联资管发【2019】13号)和《交银康联资产管理有限公司股票投资管理办法》(交银康联资管综【2019】33号)以及各部门管理制度明确了股票投资的相关岗位职责和架构设置, 我司设置股票与基金投资部负责股票的投资, 研究部负责股票的研究; 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, 部门架构完整; 2、股票投资经理与基金投资经理, 股票投资经理与交易员, 股票投资前台人员与中后台风控、绩效评估人员, 核算和清算人员之间防火墙设置完善; 3、股票投资经理账户独立、管理职责清晰; 4、股票投资人员数量和投资研究经验均满足能力标准要求; 5、投资场所做到合理的区域安排, 集中交易办公区域完全隔离, 物理防火墙有效, 监控系统完备。整体自评认为, 股票投资人员配备齐全、能力适当、架构完整, 做到了职责明确、分工合理和能力适当, 防火墙设置严密可靠, 符合股票直接投资能力建设的基本要求。			
股票投资部门:			
1			
部门名称	交易管理部		
发文时间	2019-12-23	文件名称(含文号)	《关于调整部分部门职责的通知》(交银康联资管发【2019】13号)
岗位设置:	交易员, 清算员		
2			
部门名称	研究部		
发文时间	2019-09-20	文件名称(含文号)	《关于部分部门架构调整的通知》(交银康联资管发(2019)6号)
岗位设置:	行业研究员		
3			
部门名称	综合管理部		

发文时间	2019-12-23	文件名称 (含文号)	《关于调整部分部门职责的通知》(交银康联资管发【2019】13号)
岗位设置:	运维管理员		
4			
部门名称	股票与基金投资部		
发文时间	2019-12-23	文件名称 (含文号)	《关于调整部分部门职责的通知》(交银康联资管发【2019】13号)
岗位设置:	股票投资经理		
5			
部门名称	预算财务部		
发文时间	2019-12-23	文件名称 (含文号)	《关于调整部分部门职责的通知》(交银康联资管发【2019】13号)
岗位设置:	财务核算员		
6			
部门名称	风险与合规管理部		
发文时间	2019-12-23	文件名称 (含文号)	《关于调整部分部门职责的通知》(交银康联资管发【2019】13号)
岗位设置:	风险管理专员		
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:	我司按照能力标准要求和实际操作的风控需求,在股票投资涉及的不同部门间建立了完备的防火墙机制,实行严格的业务分离管理,我司下发的《交银康联资产管理有限责任公司股票投资管理办法》(交银康联资管综(2019)33号)中规定:公司设置股票投资的研究、投资、交易、风险控制、清算、核算和绩效评估等岗位。股票投资人员应专人专岗,不得与固定收益投资人员、基础设施投资人员、基金投资人员、风险管理人员、交易人员、清算人员等互相兼职。我司依据防火墙制度要求,从业务流程、岗位部门设置、人员团队、物理区间各个方面实现严格的隔离管控,保证前台、中台和后台在相互独立基础上,相互制约、监督、各负其责。经评估符合能力标准的防火墙要求。		
投资场所:	我司交易室配备独立的办公场所,实行门禁卡进出管理制度,安装高清摄像头,实行严格的物理隔离和监控;股票投资团队、研究团队、中后台业务部门区域相对独立。符合物理隔离的要求。		

### 三、专业队伍

整体评估情况:					
我司股票投资专业队伍符合能力标准要求;股票投资人员数量与资产管理规模相匹配,人员数量符合基本要求;股票投资相关人员均来自于国内外知名院校,硕士以上学历占比较高,从业经验丰富,相关业务人员资格证书齐备。具体看,专职人员14人,其中股票投资经理3人,研究人员5人(主要研究人员3人),交易人员4人,风控人员1人,清算人员1人。其中,股票投资负责人具有9年股票投资管理经验和5年行业研究经验,投资经理均具有3年以上股票投资管理或5年以上金融证券投资从业经验,过往业绩表现良好;主要研究人员从事行业研究5年以上。					
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	高帆	交易员	是	金融证券投资从业经验	14.78
2	傅华一	交易员	是	金融证券投资从业经验	7.16
3	鲜佳慧	交易员	是	金融证券投资从业经验	1.37
4	叶艺舟	交易员	是	金融证券投资从业经验	4.38
5	陈美丽	清算员	是	金融证券投资从业经验	9.01
6	郭昊	行业研究员	是	行业研究经验	6.15
7	赵超	行业研究员	是	行业研究经验	3.94
8	王玉英	行业研究员	是	行业研究经验	7.12
9	许怡婷	行业研究员	是	行业研究经验	6.06

10	曹锐钢	行业研究员	是	行业研究经验	7.04
11	寇敬岗	运维管理员	否	金融证券投资从业经验	2.80
12	蒋宁	股票投资经理	是	股票投资管理经验	7.08
13	王耀永	股票投资经理	是	金融证券投资从业经验	6.96
14	陈建新	股票投资经理	是	股票投资管理经验	8.94
15	秦莹	核算员	否	金融证券投资从业经验	5.44
16	章丽琴	风险管理专员	否	金融证券投资从业经验	5.15
17	潘璠	风险管理专员	是	金融证券投资从业经验	6.87

#### 四. 投资制度

整体评估情况：		
<p>经评估，我司已建立完善、有效的股票投资业务管理制度体系，相关制度均经过公司经营管理层批准，并以公司正式文件形式下发执行。该制度体系包括股票投资岗位职责、基本业务、流程、操作规程、会议制度、档案管理、绩效考核、清算与核算、信息系统管理和保密及危机处理等内容；股票投资决策权限管理制度包含了投资决策体系、授权管理和实施与控制等内容；股票研究管理制度包含了研究管理办法、股票池管理办法和交易单元管理办法等内容；股票交易管理制度包含了集中交易、公平交易、交易权限管理和交易监控等内容。</p>		
股票投资基本制度：		
制度内容	评估结果	制度明细
绩效考核	符合规定	文件名称：交银人寿资管公司2020年度考核分配办法及工作要求， 发文文号：交银人寿办（2020）32号， 发文时间：2020-07-01；
信息系统管理	符合规定	文件名称：交银康联资产管理有限公司投资管理系统使用管理规定， 发文文号：交银康联资管综（2019）68号， 发文时间：2019-12-20；
操作规程	符合规定	文件名称：交银康联资产管理有限公司股票投资管理办法， 发文文号：交银康联资管综（2019）33号， 发文时间：2019-11-22；
股票投资岗位职责	符合规定	文件名称：交银康联资产管理有限公司股票投资管理办法， 发文文号：交银康联资管综（2019）33号， 发文时间：2019-11-22；
清算与核算	符合规定	文件名称：交银康联资产管理有限公司会计核算办法（修订版）， 发文文号：交银康联资管综（2020）29号， 发文时间：2020-07-29； 文件名称：交银康联资产管理有限公司金融工具公允价值计量管理办法， 发文文号：交银康联资管综（2020）33号， 发文时间：2020-09-27； 文件名称：交银康联资产管理有限公司投资业务清算管理办法， 发文文号：交银康联资管综（2019）54号， 发文时间：2019-12-11； 文件名称：交银康联资产管理有限公司金融工具管理办法， 发文文号：交银康联资管综（2020）39号， 发文时间：2020-11-16；

保密及危机处理	符合规定	文件名称：交银康联资产管理有限公司相关人员股票投资信息登记申报管理规定， 发文文号：交银康联资管综（2019）51号， 发文时间：2019-12-02； 文件名称：交银康联资产管理有限公司档案管理办法， 发文文号：交银康联资管综（2019）65号， 发文时间：2019-12-20； 文件名称：交银康联资产管理有限公司权益投资相关人员通讯工具管理办法， 发文文号：交银康联资管综（2019）50号， 发文时间：2019-12-02； 文件名称：交银康联资产管理有限公司突发事件管理预案（试行）， 发文文号：交银康联资管综（2019）45号， 发文时间：2019-11-22；
会议制度	符合规定	文件名称：交银康联资产管理有限公司股票投资管理办法， 发文文号：交银康联资管综（2019）33号， 发文时间：2019-11-22；
文档管理	符合规定	文件名称：交银康联资产管理有限公司档案管理办法， 发文文号：交银康联资管综（2019）65号， 发文时间：2019-12-20；
业务流程	符合规定	文件名称：交银康联资产管理有限公司股票投资管理办法， 发文文号：交银康联资管综（2019）33号， 发文时间：2019-11-22；
决策管理制度：		
制度内容	评估结果	制度明细
实施与控制	符合规定	文件名称：交银康联资产管理有限公司股票组合管理办法， 发文文号：交银康联资管综（2019）31号， 发文时间：2019-11-07； 文件名称：交银康联资产管理有限公司股票申购管理办法， 发文文号：交银康联资管综（2019）28号， 发文时间：2019-11-07； 文件名称：交银康联资产管理有限公司港股通业务投资管理办法（修订版）， 发文文号：交银康联资管综（2021）16号， 发文时间：2021-03-30；
授权管理	符合规定	文件名称：交银康联资产管理有限公司投资业务授权管理办法， 发文文号：交银康联资管综（2019）38号， 发文时间：2019-11-22；
投资决策体系	符合规定	文件名称：交银康联资产管理有限公司股票投资管理办法， 发文文号：交银康联资管综（2019）33号， 发文时间：2019-11-22；
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：交银康联资产管理有限公司股票池选择指标细则（2021版）， 发文文号：交银康联资管综（2021）19号， 发文时间：2021-04-20； 文件名称：交银康联资产管理有限公司股票池管理办法（2021年修订版）， 发文文号：交银康联资管综（2021）20号， 发文时间：2021-04-28；
交易单元管理办法	符合规定	文件名称：交银康联资产管理有限公司交易单元管理办法的通知， 发文文号：交银康联资管综（2020）30号， 发文时间：2020-08-10；
研究管理办法	符合规定	文件名称：交银康联资产管理有限公司股票研究管理办法（修订版）， 发文文号：交银康联资管综（2021）1号， 发文时间：2021-01-20； 文件名称：交银康联资产管理有限公司上市公司调研工作管理规定， 发文文号：交银康联资管综（2019）32号， 发文时间：2019-11-07；

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：交银康联资产管理有限公司交易管理办法， 发文文号：交银康联资管综（2019）52号， 发文时间：2019-12-11；
交易监控	符合规定	文件名称：交银康联资产管理有限公司交易管理办法， 发文文号：交银康联资管综（2019）52号， 发文时间：2019-12-11；
公平交易	符合规定	文件名称：交银康联资产管理有限公司公平交易管理办法， 发文文号：交银康联资管综（2019）53号， 发文时间：2019-12-11；
交易权限管理	符合规定	文件名称：交银康联资产管理有限公司交易管理办法， 发文文号：交银康联资管综（2019）52号， 发文时间：2019-12-11；

五. 系统建设

整体评估情况：

经评估，我司已按照能力标准要求建立包含研究分析系统、信息资讯系统、交易管理系统、资产估值和核算系统的股票投资技术系统体系，相关系统的建设、功能、使用、运行情况总体符合相关规定。其中：自主开发及外购的研究分析类系统具备资产配置模型、行业配置模型、个股估值模型和内部研究报告管理等功能；使用的两种研究资讯系统符合相关要求，并通过使用交易单元途径获得海通证券、招商证券、天风证券、国金证券等多家券商的研究服务支持；使用的交易系统具备授权管理、合规控制和交易等功能要求；使用的资产估值和核算系统具备安全、高效的清算交割、财务核算系统，能够每日进行清算和估值，实现报表自动生成等功能。

交易管理系统：

系统名称	恒生投资管理系统V03.2		
上线时间	2019-06-18	评估结果	符合规定
主要功能	该系统是行业最主流的交易管理系统，具备能力标准所要求的授权管理、合规控制和交易实施等功能。		

信息资讯系统：

系统名称	Wind资讯金融终端		
上线时间	2019-06-18	评估结果	符合规定
主要功能	该系统是行业主流的资讯系统，可提供经济、金融领域的资讯、数据和研报信息，功能符合能力标准的要求。在研报方面，通过使用交易单元的途径获得海通证券、招商证券、天风证券、国金证券等多家券商的研究服务支持。		
系统名称	财汇金融大数据终端		
上线时间	2020-01-01	评估结果	符合规定
主要功能	该系统是行业内较主流的资讯系统，可提供主要经济、金融领域的资讯、数据和研报信息，功能符合能力标准的相关要求。		

研究分析系统：

系统名称	行业配置模型（自主开发）		
上线时间	2019-06-18	评估结果	符合规定
主要功能	根据自身行业配置需要自主开发的模型，具有投资时钟设定、行业数据追踪、行业综合评分等功能，符合能力标准关于行业配置分析功能的要求。		
系统名称	Wind资讯金融终端（含AMS资管系统）		
上线时间	2019-06-18	评估结果	符合规定
主要功能	该系统是行业主流的资讯及研究分析系统，在研究分析方面包括基本研究分析模块和AMS资管系统等专用模块，具备组合管理、个股估值模型和内部研究报告管理等系统功能。		
系统名称	国泰君安B-L资产配置平台		
上线时间	2019-06-18	评估结果	符合规定
主要功能	根据自身资产配置需要合作自建的系统，具有多层次时间序列数据输入、宏观参数设定、经济周期定位、资产配置约束规则设定、资产配置组合输出及分析等功能，符合能力标准关于资产配置分析功能的要求。		

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V2.6		
------	-------------------	--	--

上线时间	2019-06-18	评估结果	符合规定
主要功能	该系统是行业主流的估值与核算系统，具备能力标准所要求的安全、高效的清算交割、财务核算系统，能够每日进行清算和估值，实现报表自动生成等要求功能。		

## 六. 风险控制

整体评估情况：			
<p>我司在股票投资管理能力的风险控制方面符合相关规定，我司坚持以审慎负责的态度来进行股票投资风险管理，前、中、后台业务在股票资产风险处理过程中分工明确，职责范围划分清晰，制度体系齐全，三道防线的体系稳固。我司始终采用定性、定量相结合的风险管理手段，开展与实施风险识别、分析、评价与报告的工作，确保股票风险管理贯穿投前、投中、投后整个投资经营过程。我司建立了独立、完善的风险报告机制，确保股票投资风险管理信息能够在公司内部及时报告、宣导与传达。针对重大风险、突发事件或市场异常情况，公司设有专项风险评估报告机制与突发事件应急管理预案机制。同时，公司严格落实内部控制与管理的各项工作，建立了明确细致的责任追究机制与绩效评估方案。</p>			
压力测试系统：			
系统名称	恒生风险管理与绩效评估系统		
上线时间	2019-06-18	评估结果	符合规定
主要功能	该系统具备对股票仓位、行业集中度、个股集中度进行压力测试的功能，可以评估与试算特定压力情景下投资组合的相关影响，我司制定了针对重大资产管理突发事件、以及对压力测试结果的应急管控相关预案。		
风险管理系统：			
系统名称	同花顺证券风险预警系统		
上线时间	2021-05-11	评估结果	符合规定
主要功能	该系统具备对于全市场证券及其主体的风险预警、负面舆情监控等风险提示功能，协助风控人员结合公司实际持仓情况，定向对投资相关人员传递与示警风险信息。		
系统名称	恒生风险管理与绩效评估系统		
上线时间	2019-06-18	评估结果	符合规定
主要功能	该系统具备风险计量、组合风险分析、绩效评估、归因分析、敏感性分析、在险价值分析、风险报告等一系列风险管理功能，可以及时对接采集投资与估值系统信息，有效开展风险管理。		

## 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。

