

同方全球人寿保险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-【20210127】)

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	朱勇	公司总经理	同方全球人寿保险有限公司关于直接股票投资风险责任人的基本信息披露公告.pdf
专业责任人	刘思恩	资产管理事业部 总经理	同方全球人寿保险有限公司关于直接股票投资风险责任人的基本信息披露公告.pdf

二、组织架构

整体评估情况
同方全球人寿保险有限公司建立了职责明确、分工合理的股票投资组织架构：资产管理事业部是公司股票投资业务的具体执行部门，在资产管理事业部中设有股票投资团队，负责股票投资业务的具体执行。在股票投资岗位的职责分工方面，各岗位职责明确：团队负责人拥有超过14年的股票投资经验，同时兼任股票投资经理，统筹负责股票投资整体策略的制定、投资执行和投后管理；另外2名股票投资经理均具有超过10年的金融证券从业经历，独立进行投资决策，共享团队的投研资源；研究、投资、交易等岗位实施专人专岗，与其他投资业务严格分离。股票投资人员之间建立完善防火墙机制。具有独立的交易场所，交易室设有单独的门禁管理，交易电脑、电话、行情终端等设施均为交易室专用。

资产管理部设置		
部门名称	资产管理事业部	
股票投资部门 (团队)	发文时间	2021-01-06
	发文文号	同方全球人力[2021]1号
	文件名称	关于总公司资产管理事业部设立信用评估团队、股票投资团队、股权投资团队的通知
	岗位设置	股票投资团队所设岗位如下：投资经理岗、研究岗、交易岗、风控岗、清算岗、核算岗、绩效评估岗、系统支持岗。
	投资经理	股票投资团队有三名投资经理，均具备五年以上金融证券从业经历。
	投资场所	拥有足够的股票投资场所，确保集中交易办公区域完全隔离，交易室设有单独的门禁管理；所有交易均由交易员在集中交易室完成，交易电脑、电话、行情终端等设施均为交易室专用。
	防火墙机制	确保股票投资岗位之间相互分离、制约和监督，股票投资人员之间均设置防火墙，实现岗位职责分离：投资经理与交易人员之间岗位职责分离；投资管理人员与风险控制、绩效评估人员之间岗位职责分离；清算与核算人员之间岗位职责分离。

三、专业队伍

整体评估情况
我司积极完善股票投资团队的建设，目前股票投资团队中：股票投资负责人具有14年以上股票投资管理经验，统筹负责股票投资整体策略的制定、投资执行和投后管理，同时兼任股票投资经理；另外2名投资经理均拥有超过10年金融证券投资从业经验，独立进行投资决策，共享团队的投研资源；高级研究员2人，从事行业研究3年以上；研究员3人，交易员2人，风控1人，清算1人。团队成员专业素质过硬，经验丰富，符合监管对于从业经历、背景及经验的相关规定。

股票投资规模	不超过10亿元
--------	---------

专业队伍人员基本信息

3-1、投资经理3名，研究人员5名（主要研究人员2名）

3-2、交易人员2名，风控人员1名，清算人员1名

四、投资制度

整体评估情况
我司建立了完善、有效的股票投资管理制度体系，相关制度均经董事会或其授权的管理层批准，并以公司正式文件形式下发执行，其中基本制度涵盖了岗位职责、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、保密及危机处理，涵盖了股票投资行为的全流程，确立了股票投资的原则和纲领；在决策管理制度方面涵盖了决策制度体系、授权管理和实施与控制，为股票投资合规合法地科学决策制定了框架；在研究管理方面涵盖了研究管理办法、股票池管理方法和交易单元管理办法，厘清了股票投资研究和交易环节中各方面的要求和规定；在交易管理制度方面，明确规定了集中交易、交易权限管理和交易监控。

基本制度	
股票投资岗位职责	
制度明细	
文件名称	同方全球人寿保险有限公司股票投资业务管理办法
发文文号	同方全球规章资管〔2021〕4号
发文时间	2021-01-22
评估结果	符合规定
业务流程	
制度明细一	
文件名称	同方全球人寿保险有限公司股票投资业务管理办法
发文文号	同方全球规章资管〔2021〕4号
发文时间	2021-01-22
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	同方全球人寿保险有限公司股票投资决策管理办法
发文文号	同方全球规章资管〔2018〕56号
发文时间	2018-08-08
评估结果	符合规定
制度明细三	

文件名称	同方全球人寿保险有限公司股票研究管理办法
发文文号	同方全球规章资管〔2018〕54号
发文时间	2018-08-08
评估结果	符合规定
制度明细四	
文件名称	同方全球人寿保险有限公司股票投资交易管理办法
发文文号	同方全球规章资管〔2018〕55号
发文时间	2018-08-08
评估结果	符合规定
操作规程	
制度明细	
文件名称	同方全球人寿保险有限公司股票投资业务管理办法
发文文号	同方全球规章资管〔2021〕4号
发文时间	2021-01-22
评估结果	符合规定
会议制度	
制度明细一	
文件名称	同方全球人寿保险有限公司股票投资业务管理办法
发文文号	同方全球规章资管〔2021〕4号
发文时间	2021-01-22
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	同方全球人寿保险有限公司股票研究管理办法
发文文号	同方全球规章资管〔2018〕54号
发文时间	2018-08-08
评估结果	符合规定
制度明细三	
文件名称	同方全球人寿保险有限公司投资委员会议事规则
发文文号	同方全球规章资管〔2018〕20号
发文时间	2018-04-09
评估结果	符合规定
文档管理	
制度明细一	
文件名称	同方全球人寿保险有限公司股票投资业务管理办法
发文文号	同方全球规章资管〔2021〕4号
发文时间	2021-01-22
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	同方全球人寿保险有限公司档案管理办法（暂行）
发文文号	同方全球规章总办〔2017〕87号
发文时间	2017-12-15
评估结果	符合规定
绩效考核	
制度明细	

文件名称	同方全球人寿保险有限公司绩效考核管理办法 (2020年版)
发文文号	同方全球规章人力〔2020〕47号
发文时间	2020-08-07
评估结果	符合规定
清算与核算	
制度明细	
文件名称	同方全球人寿保险有限公司会计核算办法
发文文号	同方全球规章财务〔2017〕7号
发文时间	2017-01-17
评估结果	符合规定
信息系统管理	
制度明细	
文件名称	同方全球人寿保险有限公司投资交易系统管理办法
发文文号	同方全球规章资管〔2019〕85号
发文时间	2019-11-26
评估结果	符合规定
保密及危机处理	
制度明细一	
文件名称	同方全球人寿保险有限公司股票投资业务管理办法
发文文号	同方全球规章资管〔2021〕4号
发文时间	2021-01-22
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	同方全球人寿保险有限公司股票投资业务风险管理办 法
发文文号	同方全球规章法规〔2019〕70号
发文时间	2019-10-09
评估结果	符合规定
制度明细三	
文件名称	同方全球人寿保险有限公司重大突发事件应急处理管 理办法
发文文号	同方全球规章法规〔2018〕18号
发文时间	2018-04-09
评估结果	符合规定
制度明细四	
文件名称	同方全球人寿保险有限公司资产管理重大突发事件应 急预案与报告管理办法
发文文号	同方全球规章法规〔2018〕76号
发文时间	2018-09-27
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	同方全球人寿保险有限公司股票投资决策管理办法

发文文号	同方全球规章资管〔2018〕56号
发文时间	2018-08-08
评估结果	符合规定
授权管理	
制度明细	
文件名称	同方全球人寿保险有限公司股票投资决策管理办法
发文文号	同方全球规章资管〔2018〕56号
发文时间	2018-08-08
评估结果	符合规定
实施与控制	
制度明细	
文件名称	同方全球人寿保险有限公司股票投资决策管理办法
发文文号	同方全球规章资管〔2018〕56号
发文时间	2018-08-08
评估结果	符合规定

研究管理制度	
研究管理办法	
制度明细	
文件名称	同方全球人寿保险有限公司股票研究管理办法
发文文号	同方全球规章资管〔2018〕54号
发文时间	2018-08-08
评估结果	符合规定
股票池管理办法	
制度明细	
文件名称	同方全球人寿保险有限公司股票池管理办法
发文文号	同方全球规章资管〔2019〕71号
发文时间	2019-10-09
评估结果	符合规定
交易单元管理办法	
制度明细	
文件名称	同方全球人寿保险有限公司服务券商选择和评价管理细则
发文文号	同方全球规章资管〔2018〕52号
发文时间	2018-08-08
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	同方全球人寿保险有限公司股票投资交易管理办法
发文文号	同方全球规章资管〔2018〕55号
发文时间	2018-08-08
评估结果	符合规定
公平交易	

制度明细一	
文件名称	同方全球人寿保险有限公司股票投资交易管理办法
发文文号	同方全球规章资管〔2018〕55号
发文时间	2018-08-08
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	同方全球人寿保险有限公司公平交易及交易量分配管理细则
发文文号	同方全球规章资管〔2018〕51号
发文时间	2018-08-08
评估结果	符合规定
交易权限管理	
制度明细	
文件名称	同方全球人寿保险有限公司股票投资交易管理办法
发文文号	同方全球规章资管〔2018〕55号
发文时间	2018-08-08
评估结果	符合规定
交易监控	
制度明细	
文件名称	同方全球人寿保险有限公司股票投资业务管理办法
发文文号	同方全球规章资管〔2021〕4号
发文时间	2021-01-22
评估结果	符合规定

五、系统建设

整体评估情况
<p>我司对外采购了多家业内领先公司所提供的成熟信息系统，以支持股票投资业务的开展，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，确保股票投资研究的各个环节：信息收集、信息归纳、股票研究、股票池管理、股票交易、授权和监控、风控、核算和清算、业绩核算等各个方面的业务顺利开展。</p>

研究分析系统		
系统名称	上线时间	评估结果
Wind资讯系统	2015-03-01	符合规定
主要功能		
<p>万得资讯具有一系列围绕信息检索、数据提取、投资组合管理应用等领域的专业分析软件与应用工具，能够提供全球宏观经济数据、国内外各资本市场实时行情、行业数据库、上市公司公告及财务信息、金融研究报告、资产管理与投资组合、新闻检索等功能，包括资产配置模型、行业配置模型、个股估值模型，能全方位满足股票投资研究的需求，为投资经理的投资决策提供支持。</p>		

信息资讯系统		
系统名称	上线时间	评估结果
Wind资讯系统和恒生投资管理系统内置的聚源资讯系统	2017-12-01	符合规定

主要功能
<p>万得资讯具有一系列围绕信息检索、数据提取、投资组合管理应用等领域的专业分析软件与应用工具，能够提供全球宏观经济数据、国内外各资本市场的实时行情、行业数据库、上市公司公告及财务信息、金融研究报告、资产管理与投资组合、新闻检索等功能，能全方位满足股票投资研究的需求。聚源资讯系统是依据恒生各业务系统要求，在聚源基础数据库上进行数据的二次清洗、转换和加载，为股票投资提供量身定制的数据库产品。</p>

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	2017-12-01	符合规定
主要功能		
<p>恒生投资交易管理系统有投资决策、风险控制，指令管理，交易管理，日终清算，财务管理，信息查询，系统管理等几大功能的模块组成，其内置的账户权限功能确保了各岗位使用人员仅能在被授权的范围内进行操作，不同岗位之间均有复核、审查的机制；同时系统设定了合规性和风险指标阈值，将风险监控的各项要素固化到相关信息技术系统中，降低操作风险、防止道德风险，能全面支持我司的股票投资需求。</p>		

资产估值和核算系统		
系统名称	上线时间	评估结果
恒生资产估值与会计核算系统软件	2018-10-01	符合规定
主要功能		
<p>根据会计准则要求，通过读取场内外投资业务的交易数据、行情等交易数据，进行清算交割。支持批量核算、批量凭证生成、批量记账、批量结账，批量生成估值表等报表，实现资产的每日清算和估值。同时，系统提供财务导出接口功能，提供标准有效的财务凭证接口。</p>		

六、风险控制体系

整体评估情况	
<p>公司股票投资业务的风险管理遵循：独立制衡原则、全面控制原则、适时适用原则和责任追究的原则。公司通过风险识别、评估、度量、控制、监控和报告等环节，建立了事前控制、事中监督、事后评估的风险控制体系，全面管理股票投资业务合规风险、市场风险、投资决策风险、交易执行及投后管理风险、财务报告及信息披露风险。</p>	
<p>风险管理制度</p>	<p>公司搭建了绩效评估与风险管理系统，其中《同方全球人寿保险有限公司偿付能力风险管理办法》第四条明确了风险管理的基本原则、《同方全球人寿保险有限公司市场风险管理办法》第三条明确了市场风险管理工作的原则；《同方全球人寿保险有限公司权益价格风险管理办法》第五章明确了股票投资风险计量的手段、频率、流程等内容；《同方全球人寿保险有限公司市场风险管理办法》第二条明确了股票投资相关风险点，第二至第四章明确了风险控制职责、内容、方法、流程、工具等；《同方全球人寿保险有限公司员工违规处罚及责任追究办法》明确了员工违反规章制度、工作流程时的责任追究机制；《同方全球人寿保险有限公司偿付能力风险管理办法》要求公司建立风险绩效考核机制，该机制涵盖了股票投资相关的风险点。</p>

<p>风险管理系统</p>	<p>公司搭建了风险管理信息系统，目前系统支持关键风险指标的计算、预警、存储、查询和导出，其中包含股票上市权益资产占比、权益VAR、权益风险敏感度和股票投资相关指标，并以关键风险指标为基础，对投资组合进行风险状况进行列示、分析和预警，严格把控投资风险。恒生投资交易管理系统中对合规性、风险指标进行了设定，囊括了风险监控的要素，在事前、事中和事后都能对风险进行有效管理。</p>
<p>压力测试系统</p>	<p>公司采购的恒生系统中包含压力测试模块，可以实现对股票持仓、行业集中度、个股集中度等风险压力指标的输出，能够评估投资组合风险状况，并基于市场损益的不同涨跌情景，分析权益组合在不同情形下的损益情况。压力测试系统为公司股票风险控制提供了量化的依据，以及进行进一步分析的数据基础，根据《全球人寿人保有限公司股票投资业务风险管理办法》第四章中，对股票投资经理持仓集中度、超限后的处理方案、买入标的下跌超阈值后的处理方案、重大突发事件的处理方案均有明确规定。</p>

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。