

泰康资产管理有限责任公司股票投资管理能力建设及自评估情况（半年度披露-20210128）

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：	段国圣	职务：	总经理
专业责任人：	邢怡	职务：	副总经理、首席投资官
类别：	高级管理人员		

二、组织架构

整体评估情况：			
<p>公司设置独立的股票研究、投资、交易、风险控制、清算核算以及系统支持部门，并以正式发文的形式明确了部门职责、岗位职责。公司设置股票投资的研究、投资、交易、风险控制、绩效评估、清算、核算以及系统支持等岗位；公司研究、投资、交易岗位均专人专岗，与其他投资业务严格分离。</p> <p>公司建立了防火墙机制。公司股票投资经理、基金投资经理、交易人员、风险控制人员、绩效评估人员、清算人员与核算人员均分属不同部门，各部门之间独立运作；同时公司在公司层面设立《信息隔离墙管理办法》，从制度层面规定不同业务板块及不同职能部门之间的信息隔离机制。</p> <p>公司拥有足够的股票投资场所，集中交易办公区域完全隔离。根据公司《集中交易管理办法》，公司集中交易室实行门禁管理，交易时间内，未经批准，其他人不得随意进入。</p> <p>经评估，公司股票投资管理组织架构建设符合《关于优化保险机构投资管理能力监管有关事项的通知》的相关要求。</p>			
股票投资部门：			
1			
部门名称	IT及互联网中心		
发文时间	2021-01-04	文件名称（含文号）	《关于进一步明确与投资管理能力建设有关的部门、岗位及人员配置的通知》（泰康资发[2021]1号）
岗位设置：	系统支持岗		
2			
部门名称	合规法律部		
发文时间	2021-01-04	文件名称（含文号）	《关于进一步明确与投资管理能力建设有关的部门、岗位及人员配置的通知》（泰康资发[2021]1号）
岗位设置：	合规管理岗		
3			
部门名称	权益投资部		
发文时间	2021-01-04	文件名称（含文号）	《关于进一步明确与投资管理能力建设有关的部门、岗位及人员配置的通知》（泰康资发[2021]1号）
岗位设置：	股票投资岗		
4			
部门名称	研究部		
发文时间	2021-01-04	文件名称（含文号）	《关于进一步明确与投资管理能力建设有关的部门、岗位及人员配置的通知》（泰康资发[2021]1号）关工作
岗位设置：	主要研究人员，股票研究岗		
5			

部门名称	运营管理中心估值核算部		
发文时间	2021-01-04	文件名称 (含文号)	《关于进一步明确与投资管理能力建设有关的部门、岗位及人员配置的通知》(泰康资发[2021]1号)
岗位设置:	投资核算岗		
6			
部门名称	运营管理中心登记结算部		
发文时间	2021-01-04	文件名称 (含文号)	《关于进一步明确与投资管理能力建设有关的部门、岗位及人员配置的通知》(泰康资发[2021]1号)
岗位设置:	投资结算岗,运营数据管理岗		
7			
部门名称	集中交易室		
发文时间	2021-01-04	文件名称 (含文号)	《关于进一步明确与投资管理能力建设有关的部门、岗位及人员配置的通知》(泰康资发[2021]1号)
岗位设置:	权益投资交易岗		
8			
部门名称	风险控制部		
发文时间	2021-01-04	文件名称 (含文号)	《关于进一步明确与投资管理能力建设有关的部门、岗位及人员配置的通知》(泰康资发[2021]1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:	公司股票投资经理、基金投资经理、交易人员、风险控制人员、绩效评估人员、清算人员与核算人员均分属不同部门,各部门之间独立运作;同时公司在公司层面设立《信息隔离墙管理办法》,从制度层面规定不同业务板块及不同职能部门之间的信息隔离机制。		
投资场所:	公司拥有足够的股票投资场所,集中交易办公区域完全隔离。根据公司《集中交易管理办法》,公司集中交易室实行门禁管理,交易时间内,未经批准,其他人不得随意进入。		

三、专业队伍

整体评估情况:
公司股票投资规模超过10亿元,专职人员40人;其中股票投资经理8人;研究人员12人(包括主要研究人员5人),交易人员4人,风控人员2人,清算人员2人,核算人员2名,系统支持人员7人,绩效评估人员3人。其中股票投资负责人具18年以上金融证券从业经历及相关专业资质,投资经理具有3年以上股票投资管理经验或者5年以上金融证券投资从业经验,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。经评估,公司股票投资管理专业队伍建设符合《关于优化保险机构投资管理能力监管有关事项的通知》的相关要求。

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	张新	系统支持岗	否	IT系统经验	4.50
2	胡博超	系统支持岗	否	IT系统经验	9.31
3	赵旭	系统支持岗	否	IT系统经验	3.54
4	赵兴元	系统支持岗	否	IT系统经验	8.33
5	陈亮	系统支持岗	否	IT系统经验	12.78
6	程毅杰	系统支持岗	否	IT系统经验	8.13
7	张宝昌	系统支持岗	否	IT系统经验	7.58
8	姜丽文	合规管理岗	否	金融证券从业经验	9.25
9	都春燕	合规管理岗	否	金融证券从业经验	5.58
10	富迪	股票投资岗	否	股票投资管理经验	9.52

11	刘志强	股票投资岗	否	股票投资管理经验	20.10
12	方源	股票投资岗	否	股票投资管理经验	11.44
13	管镠	股票投资岗	否	股票投资管理经验	10.51
14	王琦	股票投资岗	否	股票投资管理经验	22.51
15	张烁	股票投资岗	否	股票投资管理经验	11.44
16	王建军	股票投资岗	否	股票投资管理经验	18.88
17	颜运鹏	股票投资岗	否	股票投资管理经验	18.76
18	高狄	主要研究人员	否	行业研究经验	6.66
19	魏自儒	主要研究人员	否	行业研究经验	6.66
20	邹志	主要研究人员	否	行业研究经验	4.27
21	涂健	主要研究人员	否	行业研究经验	4.52
22	张欣星	主要研究人员	否	行业研究经验	4.60
23	陈璟	股票研究岗	否	行业研究经验	4.52
24	刘若石	股票研究岗	否	行业研究经验	5.02
25	王成	股票研究岗	否	行业研究经验	3.48
26	段中喆	股票研究岗	否	行业研究经验	7.69
27	张永兴	股票研究岗	否	行业研究经验	4.50
28	刘玲弟	股票研究岗	否	行业研究经验	3.52
29	刘巍放	股票研究岗	否	行业研究经验	4.68
30	张嫒	投资核算岗	否	金融证券从业经验	10.53
31	孟良	投资核算岗	否	金融证券从业经验	9.53
32	张萌	投资结算岗	否	金融证券从业经验	10.59
33	殷华	运营数据管理岗	否	金融证券从业经验	14.78
34	车睿	权益投资交易岗	否	金融证券从业经验	1.45
35	陈威	权益投资交易岗	否	金融证券从业经验	5.19
36	白安琪	权益投资交易岗	否	金融证券从业经验	4.49
37	杨傲然	权益投资交易岗	否	金融证券从业经验	1.74
38	郑梦灵	风险管理岗	否	金融证券从业经验	2.53
39	许润哲	风险管理岗	否	金融证券从业经验	3.78
40	石劭磊	风险管理岗	否	金融证券从业经验	10.78

四. 投资制度

整体评估情况：		
<p>公司正式发布了《权益投资决策管理细则》、《权益研究管理细则》、《集中交易管理办法》、《权益投资股票备选库管理细则》、《投资结算业务管理办法》、《投资绩效评估办法》等制度，涵盖股票投资基本制度、决策管理制度、研究管理制度等各个方面。公司建立了完善、有效的股票投资管理制度，相关制度均经经营管理层或其授权机构批准，以公司正式文件形式下发执行。</p> <p>经评估，公司股票投资管理相关管理制度、体系建设符合《关于优化保险机构投资管理能力监管有关事项的通知》的相关要求。</p>		
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：《权益投资决策管理细则》， 发文文号：泰康资发[2020]ZD94号， 发文时间：2020-11-03； 文件名称：《权益类量化投资经理权限管理细则》， 发文文号：泰康资发[2019]ZD108号， 发文时间：2019-11-05；

绩效考核	符合规定	文件名称：《投资绩效评估办法》， 发文文号：泰康资发[2020]ZD79号， 发文时间：2020-09-27；
清算与核算	符合规定	文件名称：《投资结算业务管理办法》， 发文文号：泰康资发[2020]ZD114号， 发文时间：2020-12-04； 文件名称：《受托资产会计核算办法》， 发文文号：泰康资发[2019]409号， 发文时间：2019-08-28；
文档管理	符合规定	文件名称：《档案管理细则》， 发文文号：泰康资发[2019]ZD120号， 发文时间：2019-12-02；
操作规程	符合规定	文件名称：《权益投资决策管理细则》， 发文文号：泰康资发[2020]ZD94号， 发文时间：2020-11-03； 文件名称：《投资结算业务管理办法》， 发文文号：泰康资发[2020]ZD114号， 发文时间：2020-12-04； 文件名称：《权益投资股票备选库管理细则》， 发文文号：泰康资发[2020]ZD17号， 发文时间：2020-05-15； 文件名称：《集中交易管理办法》， 发文文号：泰康资发〔2016〕495号， 发文时间：2016-12-13； 文件名称：《权益研究管理细则》， 发文文号：泰康资发[2019]ZD50号， 发文时间：2019-06-03；
信息系统管理	符合规定	文件名称：《IT运维管理细则》， 发文文号：泰康资发[2020]ZD65号， 发文时间：2020-09-11； 文件名称：《IT系统开发管理细则》， 发文文号：泰康资发[2019]ZD130号， 发文时间：2019-12-19；
保密及危机处理	符合规定	文件名称：《集中交易室权益投资交易应急管理细则》， 发文文号：泰康资发[2015]ZD50号， 发文时间：2015-08-19； 文件名称：《保密信息管理办法》， 发文文号：泰康资发[2017]241号， 发文时间：2017-04-24；
会议制度	符合规定	文件名称：《权益投资部会议管理细则》， 发文文号：泰康资发[2018]ZD124号， 发文时间：2018-12-24；
业务流程	符合规定	文件名称：《权益投资决策管理细则》， 发文文号：泰康资发[2020]ZD94号， 发文时间：2020-11-03； 文件名称：《投资结算业务管理办法》， 发文文号：泰康资发[2020]ZD114号， 发文时间：2020-12-04； 文件名称：《权益投资股票备选库管理细则》， 发文文号：泰康资发[2020]ZD17号， 发文时间：2020-05-15； 文件名称：《集中交易管理办法》， 发文文号：泰康资发〔2016〕495号， 发文时间：2016-12-13； 文件名称：《权益研究管理细则》， 发文文号：泰康资发[2019]ZD50号， 发文时间：2019-06-03；
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：《权限管理办法》， 发文文号：泰康资发[2020]ZD84号， 发文时间：2020-10-12；
投资决策体系	符合规定	文件名称：《投资决策管理办法》， 发文文号：泰康资发[2010]第066号， 发文时间：2010-07-23；

实施与控制	符合规定	文件名称：《权限管理办法》， 发文文号：泰康资发[2020]ZD84号， 发文时间：2020-10-12； 文件名称：《信息隔离墙管理办法》， 发文文号：泰康资发[2020]2号， 发文时间：2020-01-05；
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：《权益投资股票备选库管理细则》， 发文文号：泰康资发[2020]ZD17号， 发文时间：2020-05-15； 文件名称：《保险资金禁投股票管理实施细则》， 发文文号：泰康资发[2020]ZD21号， 发文时间：2020-05-29；
研究管理办法	符合规定	文件名称：《权益研究管理细则》， 发文文号：泰康资发[2019]ZD50号， 发文时间：2019-06-03；
交易单元管理办法	符合规定	文件名称：《服务券商选择与管理细则》， 发文文号：泰康资发[2019]ZD40号， 发文时间：2019-05-10； 文件名称：《券商服务评价管理细则》， 发文文号：泰康资发[2019]ZD41号， 发文时间：2019-05-10；
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：《集中交易管理办法》， 发文文号：泰康资发〔2016〕495号， 发文时间：2016-12-13；
公平交易	符合规定	文件名称：《公平交易管理办法》， 发文文号：泰康资发[2017]234号， 发文时间：2017-04-24；
交易监控	符合规定	文件名称：《集中交易补充管理办法》， 发文文号：泰康资发[2019]350号， 发文时间：2019-07-31；
交易权限管理	符合规定	文件名称：《投资交易权限分配表》， 发文文号：泰康资发[2020]ZD118号， 发文时间：2020-12-10；

五. 系统建设

整体评估情况：			
<p>公司已经建设了一套比较完善的信息管理系统架构，以及信息系统配套相关制度和信息安全制度等，保障股票投资资金运用的信息系统安全和满足业务能力的要求。公司分别在研究分析系统、信息资讯系统、交易管理系统、资产估值和核算系统等与股票投资密切相关的各类信息系统的建设、功能、试用、运行等方面持续投入相应的资源，建设了比较成熟完备的系统体系支持公司股票投资业务。</p> <p>经评估，公司股票投资信息技术系统建设符合《关于优化保险机构投资管理能力监管有关事项的通知》的相关要求。</p>			
交易管理系统：			
系统名称	恒生投资交易管理系统		
上线时间	2008-12-15	评估结果	符合规定
主要功能	恒生投资管理信息系统，主要包括基金账户投资、指令分发、交易下单和资金清算业务，是公司核心业务信息系统之一。该系统是提供给投资经理、交易员、监察稽核、财务以及运营保障等业务人员，进行账户投资、指令分发、交易、监控及统计、查询等日常投资操作的交易管理系统，包括授权管理、合规控制、交易功能。		
信息资讯系统：			
系统名称	知丘		
上线时间	2015-12-02	评估结果	符合规定
主要功能	该系统包括外部主流研究机构报告、行业资讯、新媒体资讯等信息，获得多家券商研究服务支持，是股票投研的外部补充力量。		
系统名称	wind金融终端		
上线时间	2006-04-01	评估结果	符合规定

主要功能	该系统的信息资讯涵盖市场行情、财务数据、公司公告、财经新闻等内容，获得多家券商研究服务支持，能比较完整、准确的提供股票研究所需的数据。		
系统名称	启明星证券研究终端		
上线时间	2010-05-20	评估结果	符合规定
主要功能	该系统提供从2002年始至今各类主流机构研报检索，获得多家券商研究服务支持，内容涉及宏观、行业、公司等20个分类，为股票投研提供外部研究支持。		
研究分析系统：			
系统名称	投研平台		
上线时间	2011-05-31	评估结果	符合规定
主要功能	该系统集成个股估值模型、内部研究报告、股票池等模块，功能完善，不断沉淀公司股票研究成果。		
系统名称	公开市场投资分析平台		
上线时间	2019-12-16	评估结果	符合规定
主要功能	公开市场投资分析平台（Titan）是面向产品化设计思路打造的投研一体化分析平台，全面整合组合分析功能、研究部门研究成果、中台研究分析成果，通过网页版+Excel的方式对公开市场投资支持，功能包括基于资产配置模型实现的投资经理层针对不同基准的股票及基金穿透行业配置情况分析功能以及基于行业配置模型实现的账户层面大类资产配置分析及业绩归因分析等。		
资产估值和核算系统：			
系统名称	Neoxam GP3估值核算系统		
上线时间	2012-07-01	评估结果	符合规定
主要功能	GP3系统每日可支持安全、高效处理股票投资业务的估值核算，自动生成估值表等会计报表。		

六. 风险控制

整体评估情况：			
公司针对股票投资业务建立了事前、事中、事后全覆盖的风险管控流程和独立于投资管理的报告制度。经评估，公司风险控制体系符合《关于优化保险机构投资管理能力监管有关事项的通知》的相关要求。			
压力测试系统：			
系统名称	风险绩效分析系统		
上线时间	2017-12-11	评估结果	符合规定
主要功能	公司风险管理系统包含业绩及市场风险、集中度风险、流动性风险、业绩归因、风险归因、压力测试等板块。定期监测投资组合的仓位水平、集中度、流动性等，包括对股票仓位、行业集中度、个股集中度进行压力测试，评估当市场处于不利情形下对投资组合的影响。公司制定了相应的应急机制和管理预案。		
风险管理系统：			
系统名称	风险绩效分析系统		
上线时间	2017-12-11	评估结果	符合规定
主要功能	公司风险管理系统建设符合规定。恒生投资交易系统风险控制包括审批权限维护、投资风险设置、风险预警查询、静态风险监控以及止盈止损监控设置等。公司风险绩效分析系统包括对风险和绩效指标的计算、分析。		
系统名称	恒生投资交易管理系统		
上线时间	2008-12-15	评估结果	符合规定
主要功能	公司风险管理系统建设符合规定。恒生投资交易系统风险控制包括审批权限维护、投资风险设置、风险预警查询、静态风险监控以及止盈止损监控设置等。公司风险绩效分析系统包括对风险和绩效指标的计算、分析。		

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。