

泰康养老保险股份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-【20210729】)

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	李艳华	泰康养老保险股份有限公司董事长兼首席执行官，泰康养老保险股份有限公司执行董事兼泰康养老资产管理有限公司执行副总裁	泰康养老保险股份有限公司关于直接责任信息披露.pdf
专业责任人	丁振寰	助理总裁兼首席投资官兼基金经理	泰康养老保险股份有限公司关于直接责任信息披露.pdf

二、组织架构

整体评估情况
公司已建立明确的分工和制约的机制，各部门岗位职责清晰、相互制约、权责分明。公司建立完善的股票投资管理岗位设置、岗位描述、岗位职责、绩效考核等制度，确保各岗位工作有章可循、有据可依。公司建立完善的股票投资管理岗位轮换制度，确保各岗位人员能够胜任岗位要求。公司建立完善的股票投资管理岗位培训制度，确保各岗位人员能够不断提升专业技能和综合素质。公司建立完善的股票投资管理岗位监督制度，确保各岗位人员能够严格按照规章制度开展工作。公司建立完善的股票投资管理岗位考核制度，确保各岗位人员能够不断提升工作质量和效率。公司建立完善的股票投资管理岗位激励制度，确保各岗位人员能够不断提升工作积极性和创造性。公司建立完善的股票投资管理岗位退出制度，确保各岗位人员能够始终保持队伍的稳定和优化。公司建立完善的股票投资管理岗位储备制度，确保各岗位人员能够始终保持队伍的活力和竞争力。公司建立完善的股票投资管理岗位评价制度，确保各岗位人员能够始终保持队伍的素质和水平。公司建立完善的股票投资管理岗位晋升制度，确保各岗位人员能够始终保持队伍的发展空间和动力。公司建立完善的股票投资管理岗位淘汰制度，确保各岗位人员能够始终保持队伍的纪律和规矩。公司建立完善的股票投资管理岗位奖惩制度，确保各岗位人员能够始终保持队伍的荣誉和尊严。公司建立完善的股票投资管理岗位申诉制度，确保各岗位人员能够始终保持队伍的公平和正义。公司建立完善的股票投资管理岗位复议制度，确保各岗位人员能够始终保持队伍的和谐和稳定。公司建立完善的股票投资管理岗位和解制度，确保各岗位人员能够始终保持队伍的团结和统一。公司建立完善的股票投资管理岗位调解制度，确保各岗位人员能够始终保持队伍的和睦和友爱。公司建立完善的股票投资管理岗位协商制度，确保各岗位人员能够始终保持队伍的协作和配合。公司建立完善的股票投资管理岗位沟通制度，确保各岗位人员能够始终保持队伍的交流和互动。公司建立完善的股票投资管理岗位合作制度，确保各岗位人员能够始终保持队伍的互助和共赢。公司建立完善的股票投资管理岗位支持制度，确保各岗位人员能够始终保持队伍的坚强后盾和有力保障。公司建立完善的股票投资管理岗位配合制度，确保各岗位人员能够始终保持队伍的默契和配合。公司建立完善的股票投资管理岗位协同制度，确保各岗位人员能够始终保持队伍的协同和共振。公司建立完善的股票投资管理岗位联动制度，确保各岗位人员能够始终保持队伍的联动和协同。公司建立完善的股票投资管理岗位联动制度，确保各岗位人员能够始终保持队伍的联动和协同。

资产管理部部门设置		
部门名称	投资管理部	
股票投资部门 (团队)	发文时间	2021-04-14
	发文文号	泰康养人发[2021]39号，泰康养人发[2021]47号，泰康养人聘[2021]第19号
	文件名称	关于下发泰康养老保险股份有限公司总分公司组织机构与部门职责的通知，关于明确股票投资业务团队组织结构及岗位职责的通知，权益投资部总经理聘任通知
	岗位设置	设有股票投资团队负责人、股票投资岗、行业研究岗、策略研究岗、宏观研究岗、权益交易岗、投资风险岗、组合绩效管理岗、投资运营岗(清算)、投资运营岗(核算)、投资系统管理岗

	投资经理	根据账户/组合性质、管理资金规模等，公司配备独立的股票投资经理。股票投资经理负责管理投资组合，在授权范围内作出投资决策，下达股票投资指令。
	投资场所	公司拥有足够的股票投资场所，集中交易室与公司其他部门及岗位实行严格的物理隔离。公司对集中交易室实行独立门禁管理，门禁卡仅限集中交易室投资交易岗位人员持有。
	防火墙机制	公司严格分离投资前、中、后台岗位责任，部门和岗位的设置权责分明，确保投资业务不相容岗位相互分离、制约和监督。公司在股票投资业务人员之间建立防火墙机制，确保股票投资经理与基金投资经理、投资控制人员、交易人员、投资管理人员与绩效评估人员、清算人员与核算人员之间相互独立。同时，股票投资业务的研究、投资、交易岗位实行专人专岗，与其他投资业务严格分离。

三、专业队伍

整体评估情况
公司配备14名熟悉股票投资业务的专职人员，其中股票投资经理4人、研究人员5人（其中主要研究人员2人），交易人员2人、风控人员2人、清算人员1人。各岗位人员均具备相关的经验及资质能力，工作经历均满足投资管理标准要求。其中，股票投资负责人具有12年金融证券从业经历及相关专业资质，投资经理均具有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，主要研究人员均从事行业研究3年以上。综上，公司股票投资管理专业队伍建设情况符合投资管理标准要求。

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4名，研究人员5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	黄海平	股票投资岗	金融证券投资从业经验	13	否
2	秦亮	股票投资岗	金融证券投资从业经验	10	否
3	庄凡	股票投资岗	金融证券投资从业经验	6	否
4	史雷鸣	股票投资岗	行业研究	4	是
5	肖丹	研究岗	行业研究	4	否
6	许利天	研究岗	行业研究	2	否
7	白羽	研究岗	金融证券从业经历	8	否
8	王泽涵	研究岗	金融证券从业经历	3	否

9	范明月	股票投资岗	金融证券投资从业经验	8	否
---	-----	-------	------------	---	---

3-2、交易人员2名，风控人员2名，清算人员1名

序号	姓名	岗位	是否兼职
1	周仁	权益交易岗	否
2	黄江	权益交易岗	否
3	周妍	投资风险管理岗	否
4	吕雪	风险管理岗	否
5	徐文博	投资运营岗	否

四、投资制度

整体评估情况
<p>公司建立了完善、有效的投资管理制度，以保障股票投资工作平稳有序开展。公司股票投资管理制度体系包括股票投资管理基本制度、股票投资决策管理制度、研究管理制度的及交易管理制度。（1）股票投资管理基本制度包含股票投资业务相关的岗位职责、业务流程、操作规程、会议制度、文档管理、绩效考核、清算、核算、信息系统管理、保密及危机处理等，明确了研究、投资、交易、风险管理、绩效管理、清算、核算、系统管理等岗位的职责，确定了投资研究、投资决策、指令下达、合同签署、交易执行、业务资料保管、运营管理、投后管理以及绩效评估等环节的主要工作内容和操作规范要求。（2）股票投资决策管理制度涵盖股票投资决策机构、决策体系、权限管理、决策实施与控制机制等内容；（3）研究管理制度明确了研究职责、工作流程、调研管理、股票池管理、交易单元管理等内容，详细规定了股票池的分类、构建、维护、管理，还明确了为公司提供交易席位及清算服务的证券公司的准入标准和评级管理方法。（4）交易管理制度明确了公司实行集中交易管理，基于独立制衡、公平交易的原则，对保险资金的投资进行统一交易、统一管理；明确了公平交易的具体要求、防范利益输送的措施和管理要求，规定了交易权限范围、审批流程、操作流程以及合规检查等；明确了交易监控的布排、维护、执行、管理、以及资料保存的分工和管理要求。上述制度均经董事会、经营管理层或其授权机构批准，并以公司正式文件形式下发执行。综上，公司股票投资管理相关制度符合股票投资管理标准规定。</p>

基本制度	
股票投资岗位职责	
制度明细	
文件名称	泰康养老保险股份有限公司股票投资管理办法
发文文号	泰康养投发[2021]8号
发文时间	2021-04-22
评估结果	符合规定
业务流程	
制度明细	
文件名称	泰康养老保险股份有限公司股票投资管理办法
发文文号	泰康养投发[2021]8号
发文时间	2021-04-22
评估结果	符合规定
操作规程	
制度明细	
文件名称	泰康养老保险股份有限公司股票投资管理办法

发文文号	泰康养投发[2021]8号
发文时间	2021-04-22
评估结果	符合规定
会议制度	
制度明细一	
文件名称	泰康养老保险股份有限公司股票投资管理办法
发文文号	泰康养投发[2021]8号
发文时间	2021-04-22
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	泰康养老保险股份有限公司股票投资业务会议管理实施细则
发文文号	泰康养投发[2021]8号
发文时间	2021-04-22
评估结果	符合规定
文档管理	
制度明细	
文件名称	泰康养老保险股份有限公司股票投资管理办法
发文文号	泰康养投发[2021]8号
发文时间	2021-04-22
评估结果	符合规定
绩效考核	
制度明细一	
文件名称	泰康养老保险股份有限公司股票投资管理办法
发文文号	泰康养投发[2021]8号
发文时间	2021-04-22
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	泰康养老保险股份有限公司投资绩效评估管理细则
发文文号	泰康养投发[2021]12号
发文时间	2021-05-13
评估结果	符合规定
清算与核算	
制度明细	
文件名称	泰康养老保险股份有限公司股票投资管理办法
发文文号	泰康养投发[2021]8号
发文时间	2021-04-22
评估结果	符合规定
信息系统管理	
制度明细	
文件名称	泰康养老保险股份有限公司股票投资管理办法
发文文号	泰康养投发[2021]8号
发文时间	2021-04-22
评估结果	符合规定
保密及危机处理	

制度明细一	
文件名称	泰康养老保险股份有限公司股票投资管理办法
发文文号	泰康养投发[2021]8号
发文时间	2021-04-22
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	泰康养老保险股份有限公司突发事件应对管理基本制度
发文文号	泰康养风发[2021]1号
发文时间	2021-03-08
评估结果	符合规定
制度明细三	
文件名称	泰康养老保险股份有限公司投资资产专项应急预案
发文文号	泰康养投发[2021]6号
发文时间	2021-01-29
评估结果	符合规定

决策管理制度	
投资决策体系	
制度明细一	
文件名称	泰康养老保险股份有限公司投资管理基本制度
发文文号	泰康养投发[2021]3号
发文时间	2021-01-27
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	泰康养老保险股份有限公司股票投资决策管理办法
发文文号	泰康养投发[2021]8号
发文时间	2021-04-22
评估结果	符合规定
授权管理	
制度明细一	
文件名称	泰康养老保险股份有限公司投资权限基本制度
发文文号	泰康养投发[2020]3号
发文时间	2020-09-30
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	泰康养老保险股份有限公司股票投资决策管理办法
发文文号	泰康养投发[2021]8号
发文时间	2021-04-22
评估结果	符合规定
实施与控制	
制度明细	
文件名称	泰康养老保险股份有限公司股票投资决策管理办法
发文文号	泰康养投发[2021]8号
发文时间	2021-04-22

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	泰康养老保险股份有限公司股票研究管理实施细则
发文文号	泰康养投发[2021]8号
发文时间	2021-04-22
评估结果	符合规定

股票池管理办法

制度明细

文件名称	泰康养老保险股份有限公司股票池管理办法
发文文号	泰康养投发[2021]8号
发文时间	2021-04-22
评估结果	符合规定

交易单元管理办法

制度明细

文件名称	泰康养老保险股份有限公司券商选择管理办法（试行）
发文文号	泰康养投发[2020]6号
发文时间	2020-11-27
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	泰康养老保险股份有限公司集中交易管理办法
发文文号	泰康养投发[2021]7号
发文时间	2021-03-04
评估结果	符合规定

公平交易

制度明细

文件名称	泰康养老保险股份有限公司公平交易管理办法
发文文号	泰康养投发[2021]1号
发文时间	2021-01-05
评估结果	符合规定

交易权限管理

制度明细

文件名称	泰康养老保险股份有限公司投资权限基本制度
发文文号	泰康养投发[2020]3号
发文时间	2020-09-30
评估结果	符合规定

交易监控

制度明细

文件名称	泰康养老保险股份有限公司集中交易管理办法
------	----------------------

发文文号	泰康养投发[2021]7号
发文时间	2021-03-04
评估结果	符合规定

五、系统建设

整体评估情况

公司使用的信息技术系统包括研究分析系统、信息资讯系统、交易管理系统、资产估值和核算系统。研究分析系统采用通联数据萝卜投资研究系统，该系统涵盖资产配置模型、行业配置模型、个股估值模型等分析模型，同时提供内部研究报告管理、外部研报整合、股票池管理、基金管理、模拟组合、绩效考评等功能，在减少研究人员工作量的前提下，为研究人员提供专业的数据、资讯、模型、模拟组合管理、风险管理等研究分析功能。

万得金融终端资讯系统、财汇金融大数据终端资讯系统、知丘（看研报）系统，实现实时行情、实时成交、实时清算、实时交割、实时估值、实时影响。公司信息系统建设符合投资管理能力标准规定。

研究分析系统

系统名称	上线时间	评估结果
萝卜投资研究系统	2021-05-14	符合规定
主要功能		
萝卜投资投研系统提供股票、基金等投资品类的研究分析工具，该系统包括资产配置模型、行业配置模型、个股估值模型等分析模型，同时提供内部研究报告管理、外部研报整合、股票池管理、基金管理、模拟组合、绩效考评等功能，在减少研究人员工作量的前提下，为研究人员提供专业的数据、资讯、模型、模拟组合管理、风险管理等研究分析功能。		

信息资讯系统

系统名称	上线时间	评估结果
万得金融终端资讯系统	2018-10-30	符合规定
财汇金融大数据终端资讯系统	2019-07-25	符合规定
知丘（看研报）系统	2020-07-01	符合规定
主要功能		
万得金融终端覆盖全球金融市场的信息与数据，内容包括股票、债券、期货、外汇、基金、指数、权证、宏观行业等多项品种，提供准确、及时、完整的金融数据资讯。万得经济数据整合海量全球宏观和行业统计数据，数据及时准确，查找、分析和图形功能强大，支持在Excel动态提取数据。		
财汇金融大数据终端覆盖全球主要证券交易市场，涵盖多证券品种，提供快速level 2行情、全息盘口、DDE决策、主题投资，全方位揭示市场真实交易本质。该系统拥有证券市场数据库、宏观行业数据库、理财产品数据库、PE/VC数据库等，通过数据浏览器、证券权益系统、多维专题报表等，以数据和图形相结合的方式，全面满足投资研究需求。		
知丘（看研报）系统提供市场上主流券商和研究机构的研究成果，汇集海量行业、个股、策略等研究报告。		

交易管理系统

系统名称	上线时间	评估结果
------	------	------

恒生投资管理系统	2015-07-01	符合规定
主要功能		
恒生投资管理系统具备授权管理、指令管理、合规控制、交易管理、财务管理、资金管理、日终清算等功能，覆盖投资组合分析、资金管理、指定下达、风险合规控制、交易执行、日终清算、报表生成等投资交易流程，支持银行间、交易所的债券、回购、股票、期货等投资业务交易运营，为大规模的资产管理提供强有力的支持。		

资产估值和核算系统		
系统名称	上线时间	评估结果
恒生估值核算系统	2015-07-01	符合规定
主要功能		
恒生估值核算系统对股票、基金、债券等投资品种的资产进行估值核算。该系统根据会计准则和投资交易数据，每日进行清算估值和会计核算，实时生成资产估值表、余额表、资产负债表、利润表、净资产变动表等各种日常报表。		

六、风险控制体系

整体评估情况
公司股票投资业务的风险管理制度完善，风险管理相关组织架构及流程清晰完整。风险控制体系全面覆盖事前、事中监督和事后评价的全流程，对主要风险的控制措施明确可行。公司实行独立于投资管理的报告制度，风险管理部定期、不定期向管理层报告资金运用风险管理状况。具体而言，公司股票风险控制涵盖投研管理、投资决策、合规检查、事中控制、风险预警、指标监控、绩效评价、压力测试等环节，覆盖合规风险、市场风险、流动性风险、操作风险、声誉风险等各类风险，现有信息管理系统能充分支持前述各风险控制环节。公司股票投资风险要素控制体系包括管理制度、流程、方法、评估、报告、信息系统配备等要素，内容全面，体系完善，符合股票投资管理能力标准规定。

<p>风险管理制度</p>	<p>公司制定了健全的股票投资管理制度，制度包括风险管理原则、风险计量、风险点与控制手段、责任追究机制及绩效评估等。（1）《泰康养老保险股份有限公司股票投资管理办法（试行）》（泰康养发[2021]11号）明确股票投资风险管理全面性、审慎性、有效性原则；（2）《泰康养老保险股份有限公司股票投资管理办法（试行）》、《泰康养老保险股份有限公司权益价格风险管理办法》（泰康养发[2019]第007号）规定了股票投资的风险计量指标与工具；（3）《泰康养老保险股份有限公司市场风险管理办法》（泰康养发[2019]第005号）、《泰康养老保险股份有限公司股票投资风险管理办法（试行）》明确了股票投资的风险点与控制手段；（4）《泰康养老保险股份有限公司处罚管理办法》（泰康养发[2020]1号）、《泰康养老保险股份有限公司股票投资管理办法》（泰康养发[2021]8号）、《泰康养老保险股份有限公司案件责任追究管理规定》（泰康养发[2017]9号）明确了违法违规行为及案件责任追究机制；（5）《泰康养老保险股份有限公司股票投资管理办法》、《泰康养老保险股份有限公司投资绩效评估管理细则》（泰康养发[2021]12号）规定了股票投资绩效评估原则、内容、指标、程序、方法及评估结果应用。公司相关制度明确了股票投资风险管理的组织架构和风险识别、评估、控制、报告流程，针对合规、市场、流动性、声誉等主要风险明确了详细控制措施及要求，规定了投资决策管理、授权管理、限额管理、指标监控、绩效评估等环节管理要求。公司风险管理制度建设情况符合规定。</p>
<p>风险管理系统</p>	<p>公司投资风险管理系统与恒生投资和交易系统风控模块、平台检查、能衡泰投为基评绩归管、合规系统符合规定。衡泰投资绩效与风险管理系统的主要功能包括：投资交易系统设置、风险控制、投资绩效事前评估、资产配置、业绩归因、绩效管理等。系统整合了投资交易数据、风控数据、投资绩效数据、资产配置数据、业绩归因数据等，支持多维度、多场景的分析与监控。系统可实现事前预警、事中监控、事后评估的全流程风险管理。系统符合规定。</p>
<p>压力测试系统</p>	<p>衡泰投资绩效与风险管理系统压力测试包括情景压力测试、专项压力测试、资产压力测试、流动性压力测试、集中度压力测试、集中度压力测试、集中度压力测试等。系统可模拟不同情景下的资产价值变动，评估其对投资组合的影响。系统符合规定。</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。