

渤海人寿保险股份有限公司股票投资管理能力建设及 自评估情况 (年度披露-【20240131】)

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	吕英博	董事长	渤海人寿保险股份有限公司关于变更股票投资行政管理能力行政责任人的基本信息披露公告.pdf
专业责任人	万国平	资产管理中心副主任	渤海人寿保险股份有限公司关于变更股票投资管理专业责任人的基本信息披露公告.pdf

二、组织架构

整体评估情况
<p>公司按照“职责明确、分工合理”的原则，建立了股票投资组织架构。公司设立资产管理中心作为独立的资产管理业务部门，并在资产管理中心内正部门下设立独立的股票投资部，并配备具有丰富经验、具备相应岗位任职资格、具备相应岗位胜任能力、具备相应岗位专业背景、具备相应岗位工作经验、具备相应岗位专业资格、具备相应岗位专业能力的股票投资经理、行业研究员、交易、风险控制、绩效评估、清算、核算以及系统支持等相关岗位。股票投资部与基金投资经理之间、股票投资经理与风险控制、绩效评估人员之间、清算人员与核算人员之间均相互独立，不存在不相容岗位兼任的情况。公司设有充足、独立、封闭的交易场所，实现集中交易办公区完全隔离。总体上，公司股票投资组织架构符合保险机构股票投资管理标准。</p>

资产管理部设置		
部门名称	股票投资部	
股票投资部门 (团队)	发文时间	2022-05-18
	发文文号	渤海人寿人〔2022〕229号
	文件名称	《关于资产管理中心编制调整及部分人员重新任职、定岗的通知》
	岗位设置	投资总监、研究总监、投资经理、研究员、股票交易员、投资风控经理、投资清算经理、投资核算经理、系统支持经理、绩效评估经理
	投资经理	根据管理资金规模，配备独立的股票投资经理3名，负责制定股票投资策略，管理股票投资组合，下达股票投资指令。
	投资场所	资产管理中心下设独立、封闭的交易室，交易室实行门禁管理，严格隔离。

	防火墙机制	公司根据监管要求设立了严格的防火墙机制，科学合理、有效运作，与基金投资业务之间，清算人之间，不存在不相容岗位分离。股票投资与交易、绩效评估、风险控制、核算人员兼任的情况。
--	-------	---

三、专业队伍

整体评估情况
公司设立股票投资部，并配备了具有丰富经验和专业能力的业务人员。其中投资经理3名，主要研究人员4名，其他专职研究员2名。另配备3名交易员，1名清算人员，1名核算人员，1名风控人员，1名绩效评估人员，1名系统支持人员，相关专业人员从业经历均符合相关要求。总体上，公司股票投资专业队伍符合保险机构股票投资管理标准。

股票投资规模	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6名（主要研究人员4名）

序号	姓名	岗位	相关经验类型	经验年限(年)	是否兼职
1	王雪峰	投资总监	股票投资管理经验	9	否
2	魏强	投资经理	股票投资管理经验	10	否
3	李泽江	投资经理	股票投资管理经验	10	否
4	张远德	研究总监	行业研究	13	否
5	孙金琦	研究员	行业研究	8	否
6	万冬	研究员	行业研究	12	否
7	杨寅啸	研究员	行业研究	8	否
8	赵硕	研究员	行业研究	2	否
9	刘彤	研究员	行业研究	2	否

3-2、交易人员3名，风控人员1名，清算人员1名

序号	姓名	岗位	是否兼职
1	杨永齐	股票交易员	否
2	张艳楠	股票交易员	否
3	李钢	投资风控经理	否
4	董竹弘	投资清算经理	否
5	丁宗云	股票交易员	否

四、投资制度

整体评估情况

公司按照股票投资管理能力和标准建立了股票投资基本制度（包括股票投资岗位职责、业务流程、操作规程、会议制度、文档管理、绩效考核、清算与核算、信息系统管理、保密及危机处理等）、决策管理制度（包括投资决策体系、授权管理、实施与控制等）、研究管理制度（包括研究管理方法、股票池管理办法、交易单元管理方法等）、交易管理制度（包括集中交易、公平交易、交易权限管理和交易监控等），保障公司股票投资业务合法、合规、有序开展，相关管理制度文件均已有权机构批准并以公司正式文件形式下发执行。总体上，公司股票投资专业队伍符合保险机构股票投资管理标准。

基本制度	
股票投资岗位职责	
制度明细	
文件名称	《渤海人寿保险股份有限公司股票投资管理办法》
发文文号	渤海人寿资管〔2022〕187号
发文时间	2022-05-06
评估结果	符合规定
业务流程	
制度明细	
文件名称	《渤海人寿保险股份有限公司股票投资管理办法》
发文文号	渤海人寿资管〔2022〕187号
发文时间	2022-05-06
评估结果	符合规定
操作规程	
制度明细	
文件名称	《渤海人寿保险股份有限公司股票投资管理办法》
发文文号	渤海人寿资管〔2022〕187号
发文时间	2022-05-06
评估结果	符合规定
会议制度	
制度明细	
文件名称	《渤海人寿保险股份有限公司股票投资管理办法》
发文文号	渤海人寿资管〔2022〕187号
发文时间	2022-05-06
评估结果	符合规定
文档管理	
制度明细一	
文件名称	《渤海人寿保险股份有限公司股票投资管理办法》
发文文号	渤海人寿资管〔2022〕187号
发文时间	2022-05-06
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	《渤海人寿保险股份有限公司资产管理中心档案管理办法》
发文文号	资产管理中心〔2023〕1号
发文时间	2023-03-01
评估结果	符合规定

绩效考核	
制度明细	
文件名称	《渤海人寿保险股份有限公司绩效考核管理办法》
发文文号	渤海人寿人〔2018〕702号
发文时间	2018-08-06
评估结果	符合规定
清算与核算	
制度明细一	
文件名称	《渤海人寿保险股份有限公司投资清算管理办法》
发文文号	渤海人寿财〔2022〕183号
发文时间	2022-05-05
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	《渤海人寿保险股份有限公司投资资产会计核算管理办法》
发文文号	渤海人寿财〔2022〕184号
发文时间	2022-05-05
评估结果	符合规定
信息系统管理	
制度明细一	
文件名称	《渤海人寿保险股份有限公司信息系统访问权限操作规范》
发文文号	渤海人寿信〔2023〕156号
发文时间	2023-03-29
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	《渤海人寿保险股份有限公司信息系统数据提取管理办法》
发文文号	渤海人寿信〔2021〕376号
发文时间	2021-08-12
评估结果	符合规定
制度明细三	
文件名称	《渤海人寿保险股份有限公司信息系统突发事件 应急预案》
发文文号	渤海人寿信〔2022〕593号
发文时间	2022-12-18
评估结果	符合规定
保密及危机处理	
制度明细一	
文件名称	《渤海人寿保险股份有限公司保密管理办法》
发文文号	渤海人寿办〔2018〕174号
发文时间	2018-03-13
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	《渤海人寿股份有限公司投资人员个人股票投资行为管理制度》

发文文号	资产管理中心〔2019〕1号
发文时间	2019-06-26
评估结果	符合规定
制度明细三	
文件名称	《渤海人寿保险股份有限公司资金运用重大突发事件应急预案》
发文文号	渤海人寿资管〔2016〕675号
发文时间	2016-12-26
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	《渤海人寿保险股份有限公司投资决策与授权管理办法》
发文文号	渤海人寿资管〔2020〕148号
发文时间	2020-03-19
评估结果	符合规定

制度明细二

文件名称	《渤海人寿保险股份有限公司股票投资决策与授权管理实施细则》
发文文号	渤海人寿资管〔2022〕189号
发文时间	2022-05-06
评估结果	符合规定

授权管理

制度明细一

文件名称	《渤海人寿保险股份有限公司投资决策与授权管理办法》
发文文号	渤海人寿资管〔2020〕148号
发文时间	2020-03-19
评估结果	符合规定

制度明细二

文件名称	《渤海人寿保险股份有限公司股票投资决策与授权管理实施细则》
发文文号	渤海人寿资管〔2022〕189号
发文时间	2022-05-06
评估结果	符合规定

实施与控制

制度明细一

文件名称	《渤海人寿保险股份有限公司股票投资管理办法》
发文文号	渤海人寿资管〔2022〕187号
发文时间	2022-05-06
评估结果	符合规定

制度明细二

文件名称	《渤海人寿保险股份有限公司集中交易管理制度》
发文文号	渤海人寿资管〔2022〕569号

发文时间	2022-12-05
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	《渤海人寿保险股份有限公司股票投资研究工作管理办法》
发文文号	渤海人寿资管〔2022〕190号
发文时间	2022-05-06
评估结果	符合规定

股票池管理办法

制度明细	
文件名称	《渤海人寿保险股份有限公司股票池管理办法》
发文文号	渤海人寿资管〔2022〕191号
发文时间	2022-05-06
评估结果	符合规定

交易单元管理办法

制度明细	
文件名称	《渤海人寿保险股份有限公司交易单元管理办法》
发文文号	资产管理中心〔2022〕11号
发文时间	2022-12-08
评估结果	符合规定

交易管理制度

集中交易

制度明细一	
文件名称	《渤海人寿保险股份有限公司集中交易管理制度》
发文文号	渤海人寿资管〔2022〕569号
发文时间	2022-12-05
评估结果	符合规定

制度明细二	
文件名称	《渤海人寿保险股份有限公司股票交易管理制度》
发文文号	资产管理中心〔2022〕2号
发文时间	2022-12-08
评估结果	符合规定

公平交易

制度明细	
文件名称	《渤海人寿保险股份有限公司公平交易制度》
发文文号	渤海人寿资管〔2022〕568号
发文时间	2022-12-05
评估结果	符合规定

交易权限管理

制度明细一	
文件名称	《渤海人寿保险股份有限公司集中交易管理制度》

发文文号	渤海人寿资管〔2022〕569号
发文时间	2022-12-05
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	《渤海人寿保险股份有限公司股票交易管理制度》
发文文号	资产管理中心〔2022〕2号
发文时间	2022-12-08
评估结果	符合规定
交易监控	
制度明细	
文件名称	《渤海人寿保险股份有限公司股票交易管理制度》
发文文号	资产管理中心〔2022〕2号
发文时间	2022-12-08
评估结果	符合规定

五、系统建设

整体评估情况
公司已建立包括研究分析系统、信息资讯系统、股票交易系统、业务搭建系统、资产估值系统、核算与操作体系、恒生投资池、终端系统、应用环境下的平稳、高效的管理能力标准》规定。

研究分析系统		
系统名称	上线时间	评估结果
恒生投资研究管理平台系统	2017-03-27	符合规定
恒生绩效评估与风险管理系统	2015-01-29	符合规定
主要功能		
公司使用恒生投资研究管理平台系统、恒生绩效评估与风险管理系统作为股票投资研究分析系统。恒生投资研究管理平台系统旨在提升研究工作效率，该系统能够模拟组合绩效，为研究部门提供研究工具。恒生绩效评估与风险管理系统旨在提升研究过程的规范化和研究成果的标准化，为研究部门提供研究工具。恒生投资研究管理平台系统旨在提升研究过程的规范化和研究成果的标准化，为研究部门提供研究工具。恒生绩效评估与风险管理系统旨在提升研究过程的规范化和研究成果的标准化，为研究部门提供研究工具。		

信息资讯系统		
系统名称	上线时间	评估结果

万得金融终端	2015-08-03	符合规定
大智慧大数据终端	2018-07-03	符合规定
主要功能		
<p>为据终端、各等研、行、券、商、研、究、支、持、符、合、股、票、投、资、信、息、系、统、资、产、配、置、和、运、用、信、息、为、股、票、投、资、业、务、研、究、报、告、投、资、研、究、分、析、的、各、项、要、求。</p>		

交易系统		
系统名称	上线时间	评估结果
恒生投资交易系统	2017-11-21	符合规定
主要功能		
<p>公司配置并运行恒生投资交易系统作为股票投资业务的管理系统。该系统具备授权管理、风险控制、清算、交易指令管理、证券池管理、审批权限管理、风控管理等模块功能，能够实现对股票投资交易的全流程管理，在业务执行过程中，能够对交易进行实时监控。该系统能够保障公司投资交易的安全、稳定和准确。</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	2015-01-29	符合规定
主要功能		
<p>公司使用恒生资产估值与会计核算系统作为公司资产估值和会计核算的系统。该系统能够实现与恒生投资交易系统的无缝对接，能够对股票投资业务的资产估值和会计核算进行全流程管理，保障资产估值和会计核算的准确性和及时性。</p>		

六、风险控制体系

整体评估情况

<p>公司建立了以合规经营为基本的全程风险控制体系，并强化从完善组织等几个维度入手，加强了股票投资风险控制，并建立了较为完善的评估预警机制，对股票投资风险控制进行了全面、深入的评估和预警，确保股票投资风险控制的有效性。</p>	<p>公司建立了以合规经营为基本的全程风险控制体系，并强化从完善组织等几个维度入手，加强了股票投资风险控制，并建立了较为完善的评估预警机制，对股票投资风险控制进行了全面、深入的评估和预警，确保股票投资风险控制的有效性。</p>
<p>风险管理度</p>	<p>为保障股票投资业务平稳开展，公司制定了《渤海人寿保险股份有限公司市场风险管理规范》、《渤海人寿保险股份有限公司股权投资风险管理规范》等制度和具体方法，明确了股票投资风险控制策略及考核机制，依据法律法规追究相关人员责任。</p>
<p>风险管理系统</p>	<p>为提升风险控制能力，公司配备了投资绩效与风控系统，根据公司的风险偏好和资产配置计划，采用定量与定性相结合的方式进行持续监测，并具备评估功能，可以帮助评估人与收益相匹配。为加大信息资源，公司还购置了Wind金融终端、大数据终端等，通过积极运用金融信息，能够实时、全面地掌握金融市场信息。</p>
<p>压力测试系统</p>	<p>公司股票投资压力测试系统为“恒生投资绩效评估与风险管理”系统。该系统具备投资组合、行业集中度、个股集中度等进行压力测试，评估投资组合在出现剧烈波动时，对持仓股票进行压力测试，并依照《渤海人寿保险股份有限公司应急预案》、《渤海人寿保险股份有限公司重大突发事件应急预案》进行处置。综合系统符合《保险机构股票投资管理标准》的规定。</p>

自评估结果及承诺

根据《关于优化保险机构投资管理能力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。