

英大保险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-20210129）

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：	刘开俊	职务：	总经理
专业责任人：	李芝樑	职务：	副总经理
类别：	高级管理人员		

二、组织架构

整体评估情况：

经评估，公司股票投资组织架构符合《保险机构股票投资管理标准》。公司设置了独立的权益投资部、交易管理部、财务会计部、运营管理部、风险管理部（审计部）等部门。公司以正式文件发布了《关于权益投资部组织架构相关情况的通报》（英大资产组织[2021]25号）、《关于交易管理部组织架构相关情况的通报》（英大资产组织[2021]23号）、《关于股票投资管理建设人力配备情况的通报》（英大资产组织[2021]45号）等文件，明确了各部门职责、岗位职责、部门负责人和人力配备情况；公司设置了股票投资的研究、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；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。公司已根据账户/组合性质，配备独立的股票投资经理，并根据管理资金规模，设置了投资管理权限。公司股票投资人员之间建立了防火墙机制。股票投资经理与基金投资经理、投资经理与交易人员，投资管理人员与风险控制、绩效评估人员，清算人员与核算人员互不兼任。公司拥有足够的股票投资场所，单独设立交易室，集中交易办公区域完全隔离，公司《投资交易管理办法（2016年9月修订）》（英大资产交易[2016]44号）亦有明确规定。

股票投资部门：

1			
部门名称	交易管理部		
发文时间	2021-01-14	文件名称（含文号）	《关于交易管理部组织架构相关情况的通报》（英大资产组织（2021）23号）
岗位设置：	交易岗		
2			
部门名称	固定收益部		
发文时间	2021-01-14	文件名称（含文号）	《关于固定收益部组织架构相关情况的通报》（英大资产组织（2021）24号）
岗位设置：	宏观研究岗		
3			
部门名称	权益投资部		
发文时间	2021-01-14	文件名称（含文号）	《关于权益投资部组织架构相关情况的通报》（英大资产组织（2021）25号）
岗位设置：	研究岗，股票投资经理，部门负责人		
4			
部门名称	财务会计部		
发文时间	2021-01-14	文件名称（含文号）	《关于财务会计部组织架构相关情况的通报》（英大资产组织（2021）22号）
岗位设置：	投资核算岗		
5			

部门名称	运营管理部		
发文时间	2021-01-14	文件名称（含文号）	《关于运营管理部组织架构相关情况的通知》（英大资产组织〔2021〕18号）
岗位设置：	清算岗，系统建设兼运维岗，网络与安全管理岗		
6			
部门名称	风险管理部（审计部）		
发文时间	2021-01-14	文件名称（含文号）	《关于风险管理部（审计部）组织架构相关情况的通知》（英大资产组织〔2021〕13号）
岗位设置：	绩效评估岗，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：	公司以正式文件发布了《关于权益投资部组织架构相关情况的通知》（英大资产组织〔2021〕25号）、《关于交易管理部组织架构相关情况的通知》（英大资产组织〔2021〕23号）、《关于股票投资管理建设人力配备情况的通知》（英大资产组织〔2021〕45号）等文件，明确了权益投资部、交易管理部、运营管理部、财务会计部等部门、岗位的设置及职责；公司设置了股票投资的研究、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；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。公司股票投资人员之间建立了防火墙机制。股票投资经理与基金投资经理，投资经理与交易人员，投资管理人与风险控制、绩效评估人员，清算人员与核算人员互不兼任。		
投资场所：	公司为交易管理部设置了独立的交易室，集中交易工作区域与其他办公地区物理隔离。《集中交易室管理细则》（英大资产〔2016〕45号）明确规定，交易室为集中交易场所。投资交易指令由交易室集中统一执行。该《细则》还规定了交易室管理、交易人员管理、指令管理等内容，明确交易人员使用门禁卡方可进入交易室。非交易人员确因工作需要进入交易室，须经交易室负责人或公司相关领导批准。		

三、专业队伍

整体评估情况：					
专业队伍建设符合《保险机构股票投资管理标准》相关要求。经评估，我司股票投资规模超过10亿元，配置了股票投资专职人员14人，其中股票投资经理4人，研究人员6人（主要研究人员6人），交易人员2人，风控人员1人，清算人员1人。兼职人员5人，其中核算人员2人，绩效评估人员1人，系统支持人员2人。其中股票投资负责人具有5年以上股票投资管理及相关专业资质，投资经理均具有3年以上股票投资管理经验，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。					
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	万朝晖	交易岗	否	证券交易	5.21
2	刘尔宁	交易岗	否	证券交易	13.17
3	冯庆	宏观研究岗	否	金融证券从业经验	6.60
4	王喆	研究岗	否	行业研究经验	4.03
5	张成	研究岗	否	行业研究经验	7.43
6	王京乐	研究岗	否	行业研究经验	11.69
7	陈慧姣	研究岗	否	行业研究经验	4.67
8	徐文浩	研究岗	否	行业研究经验	4.52
9	卢琼	股票投资岗	否	股票投资管理经验	6.52
10	罗义锋	股票投资岗	否	股票投资管理经验	11.64
11	张明昕	股票投资岗	否	股票投资管理经验	8.90
12	李海	部门负责人	否	股票投资管理经验	8.99
13	付谋拼	投资核算岗	是	投资核算	11.09
14	贾秀红	投资核算岗	是	投资核算	8.53
15	王琳	清算岗	否	投资清算	4.36
16	陶锋	系统建设兼运维岗	是	系统建设与运维	13.59

17	范学志	网络与安全管 理岗	是	网络与安全管理岗	12.21
18	房笑妮	绩效评估岗	是	绩效评估	3.36
19	胡月诗	风险管理岗	否	风险管理	5.59

四. 投资制度

整体评估情况:		
投资制度符合《保险机构股票投资管理标准》的相关要求。		
(一) 基本制度 公司《股票投资管理办法(2016年5月修订)》(英大资产权益[2016]30号)为公司股票投资的基本制度,内容涵盖业务流程、操作规程、会议制度、文档管理等内容。《投资决策委员会工作规则(2016年9月修订)》(英大资产组合(2016)51号)规定了投资决策委员会作为协助经营层进行经营管理决策的常设机构,并规定了投资决策委员会的工作机制和职责。 公司制订了《绩效考核管理实施办法(2019)》(英大资产组织(2019)58号)、《绩效考核管理实施细则》(英大资产组织(2019)59号),并下发绩效考核方案。 公司制订了《投资清算管理办法(2020年12月修订)》(英大资产运营[2020]41号)、《金融资产会计核算细则》(英大资产财务(2015)54号),规定了股票的投资清算与核算。 公司制订了《信息系统运行维护管理办法》(英大资产运营(2015)37号)、《信息系统用户权限管理细则(2019年4月修订)》(英大资产运营(2019)13号)、《信息系统数据管理细则(2017年5月修订)》(英大资产运营[2017]18号),规定了系统运行与维护、用户权限、数据管理等事项。 公司《保密工作管理办法(2018年12月修订)》(英大资产行政[2018]22号)有保密的相关内容;《资金运用重大突发事件应急处理规则》(英大资产风险(2015)40号)规定了资金运用重大突发事件应急处理的组织机构与职责、应急预案和应急准备、应急处理、报告和信息发布等;《投资止损管理细则(2020年7月修订)》(英大资产风险(2020)20号)规定了止损标准及处理等;《市场风险应急预案(2020年12月修订)》(英大资产风险[2021]2号)规定了市场风险重大市场风险事件的标准、组织机构与职责、监测与预警、预防与应急准备、应急响应与处置等。《关于权益投资部组织架构相关情况的通知》(英大资产组织(2021)25号)明确了岗位职责。		
(二) 决策管理制度 《投资决策委员会工作规则(2016年9月修订)》(英大资产组合(2016)51号)、《股票投资管理办法(2016年5月修订)》(英大资产权益[2016]30号)、《投资权限管理办法(2017年6月修订)》(英大资产风险[2017]22号)包括投资决策体系、授权管理、实施与控制等内容。		
(三) 研究管理制度 公司《股票投资研究管理办法》(英大资产权益[2015]30号)涵盖了投资策略、行业和个股研究、投资报告制度、调研管理制度等内容;公司《资产池管理办法(2018年3月修订)》(英大资产组合(2018)2号)、《股票投资管理办法(2016年5月修订)》(英大资产权益[2016]30号)涵盖了股票池产生、调整与维护、对投资决策的实质影响以及对投资操作的制约作用等内容;《交易单元管理办法(2018年11月修订)》(英大资产运营[2018]21号)涵盖了交易单元的选择标准、研究服务质量评价等内容。		
(四) 交易管理制度 公司《投资交易管理办法(2016年9月修订)》(英大资产交易[2016]44号)、《集中交易室管理细则》(英大资产交易(2016)45号)规定了集中交易;《公平交易细则》(英大资产风险[2015]34号)规定了公平交易;《投资权限管理办法(2017年6月修订)》(英大资产风险[2017]22号)明确了投资交易权限;《投资行为规范管理办法(2016年7月修订)》(英大资产风险(2016)35号)明确了交易监控。		
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:《关于权益投资部组织架构相关情况的通知》,发文号:英大资产组织[2021]25号,发文时间:2021-01-14;
绩效考核	符合规定	文件名称:《绩效考核管理实施细则》,发文号:英大资产组织(2019)59号,发文时间:2019-12-17; 文件名称:《绩效考核管理办法(2019年)》,发文号:英大资产组织(2019)58号,发文时间:2019-12-17;
清算与核算	符合规定	文件名称:《金融资产会计核算细则》,发文号:英大资产财务(2015)54号,发文时间:2015-09-10; 文件名称:《投资清算管理办法(2020年12月修订)》,发文号:英大资产运营[2020]41号,发文时间:2020-12-31;
文档管理	符合规定	文件名称:《股票投资管理办法(2016年5月修订)》,发文号:英大资产权益[2016]30号,发文时间:2016-06-24;

操作规程	符合规定	文件名称：《股票投资管理办法（2016年5月修订）》 ， 发文文号：英大资产权益[2016]30号， 发文时间：2016-06-24；
信息系统管理	符合规定	文件名称：《信息系统用户权限管理细则（2019年4月修订）》， 发文文号：英大资产运营（2019）13号， 发文时间：2019-04-25； 文件名称：《信息系统数据管理细则（2017年5月修订）》， 发文文号：英大资产运营[2017]18号， 发文时间：2017-05-25； 文件名称：《信息系统运行维护管理办法》， 发文文号：英大资产运营（2015）37号， 发文时间：2015-09-09；
保密及危机处理	符合规定	文件名称：《保密工作管理办法（2018年12月修订）》， 发文文号：英大资产行政[2018]22号， 发文时间：2018-12-14； 文件名称：《市场风险应急预案（2020年12月修订）》， 发文文号：英大资产风险[2021]2号， 发文时间：2021-01-04； 文件名称：《资金运用重大突发事件应急处理规则》， 发文文号：英大资产风险（2015）40号， 发文时间：2015-08-27； 文件名称：《投资止损管理细则（2020年7月修订）》， ， 发文文号：英大资产风险（2020）20号， 发文时间：2020-08-04；
会议制度	符合规定	文件名称：《股票投资管理办法（2016年5月修订）》 ， 发文文号：英大资产权益[2016]30号， 发文时间：2016-06-24； 文件名称：《投资决策委员会工作规则（2016年9月修订）》， 发文文号：英大资产组合（2016）51号， 发文时间：2016-10-13；
业务流程	符合规定	文件名称：《股票投资管理办法（2016年5月修订）》 ， 发文文号：英大资产权益[2016]30号， 发文时间：2016-06-24；
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：《投资权限管理办法（2017年6月修订）》 ， 发文文号：英大资产风险[2017]22号， 发文时间：2017-06-21；
投资决策体系	符合规定	文件名称：《投资权限管理办法（2017年6月修订）》 ， 发文文号：英大资产风险[2017]22号， 发文时间：2017-06-21； 文件名称：《股票投资管理办法（2016年5月修订）》 ， 发文文号：英大资产权益[2016]30号， 发文时间：2016-06-24； 文件名称：《投资决策委员会工作规则（2016年9月修订）》， 发文文号：英大资产组合（2016）51号， 发文时间：2016-10-13；
实施与控制	符合规定	文件名称：《投资权限管理办法（2017年6月修订）》 ， 发文文号：英大资产风险[2017]22号， 发文时间：2017-06-21； 文件名称：《股票投资管理办法（2016年5月修订）》 ， 发文文号：英大资产权益[2016]30号， 发文时间：2016-06-24；
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：《股票投资管理办法（2016年5月修订）》， 发文文号：英大资产权益[2016]30号， 发文时间：2016-06-24； 文件名称：《资产池管理办法（2018年3月修订）》， 发文文号：英大资产组合（2018）2号， 发文时间：2018-03-20；
研究管理办法	符合规定	文件名称：《股票投资研究管理办法》， 发文文号：英大资产权益[2015]30号， 发文时间：2015-09-15；
交易单元管理办法	符合规定	文件名称：《交易单元管理办法（2018年11月修订）》， 发文文号：英大资产运营[2018]21号， 发文时间：2018-11-28；
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：《投资交易管理办法（2016年9月修订）》， 发文文号：英大资产交易[2016]44号， 发文时间：2016-10-12； 文件名称：《集中交易室管理细则》， 发文文号：英大资产交易（2016）45号， 发文时间：2016-10-12；
公平交易	符合规定	文件名称：《公平交易细则》， 发文文号：英大资产风险[2015]34号， 发文时间：2015-08-26；
交易监控	符合规定	文件名称：《投资行为规范管理办法（2016年7月修订）》， 发文文号：英大资产风险（2016）35号， 发文时间：2016-07-19； 文件名称：《投资交易管理办法（2016年9月修订）》， 发文文号：英大资产交易[2016]44号， 发文时间：2016-10-12；
交易权限管理	符合规定	文件名称：《投资权限管理办法（2017年6月修订）》， 发文文号：英大资产风险[2017]22号， 发文时间：2017-06-21； 文件名称：《投资交易管理办法（2016年9月修订）》， 发文文号：英大资产交易[2016]44号， 发文时间：2016-10-12；

五. 系统建设

整体评估情况：				
系统建设符合《保险机构股票投资管理标准》的相关要求。研究分析系统方面，公司配备了聚源投资研究管理系统，具备资产配置、行业配置、个股模型、内部报告等多个可以给具体投资提供实质影响的功能；信息资讯系统方面，公司配备了万得信息技术股份有限公司的Wind金融终端、朝阳永续资讯系统、启明星证券研究终端。				
交易管理系统方面，公司采用恒生电子股份有限公司开发的032交易管理系统，该系统功能包括授权管理、合规控制和交易控制，可以对投资管理产生实质性影响。此外该系统集合了下单、交易、风控等一系列功能。				
资产估值和核算系统方面，公司使用032系统进行日常的清算业务，核算采用的系统是恒生电子股份有限公司开发的资产估值与会计核算系统，该系统能够每日进行清算和估值，满足监管部门和公司的资产估值管理要求，该系统与恒生投资交易系统无缝对接，实现自动导入交易记录和自动生成各类型的财务凭证。				
交易管理系统：				
系统名称		032投资交易系统		
上线时间		2015-05-04	评估结果	符合规定
主要功能		032投资交易系统主要是进行股票、基金和债券的投资、交易及管理，包括指令管理、委托交易、信息查询、权限管理、风险控制、日终清算、交易管理、公平交易等。符合要求。		
信息资讯系统：				
系统名称		朝阳永续研究终端		
上线时间		2020-08-03	评估结果	符合规定

主要功能	朝阳永续资讯系统主要为公司股票分析提供业绩预告数据业务，是进行指数和行业估值比较、财务报表超预期判断、预期趋势判断等分析的重要工具。符合要求。		
系统名称	Wind金融终端		
上线时间	2015-05-04	评估结果	符合规定
主要功能	自公司成立起就配备了万得资讯，并使用至今。万得资讯金融终端包括股票、债券、基金、宏观数据等功能模块，提供的资讯数据准确详实、及时全面。符合要求。		
系统名称	启明星证券研究终端		
上线时间	2015-05-04	评估结果	符合规定
主要功能	自公司成立起就配备了启明星证券研究终端，并使用至今。启明星证券研究终端是以研究资料、数据挖掘为特色的在线实时证券研究分析平台，提供内容覆盖金融资讯、研究报告、金融数据和金融分析工具等。符合要求。		
研究分析系统：			
系统名称	恒生聚源投资投研管理系统		
上线时间	2015-05-04	评估结果	符合规定
主要功能	自公司成立起就配备了研究分析系统，并使用至今。该系统包括资产配置模型、行业配置模型、个股估值模型、内外部研究报告、券商评价等功能。符合要求。		
资产估值和核算系统：			
系统名称	资产估值与会计核算系统		
上线时间	2015-05-04	评估结果	符合规定
主要功能	该系统具备安全、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。符合要求。		

六. 风险控制

整体评估情况：			
风险控制整体符合《保险机构股票投资管理标准》的相关要求。公司制定了《市场风险管理规则》（英大资产风险〔2016〕52号）、《投资止损管理细则（2020年7月修订）》（英大资产风险〔2020〕20号）、《股票投资管理办法（2016年5月修订）》（英大资产权益〔2016〕30号）、《权益价格风险管理规则（2020年12月修订）》（英大资产风险〔2021〕1号）等风险管理制度，建立了覆盖事前控制、事中监督、事后评价的风险控制体系，风险报告独立于投资管理报告。公司建立了《全面风险管理办法》（英大资产风险〔2021〕40号）、《投资风险管理办法》（英大资产风险〔2015〕14号）、《市场风险管理规则》（英大资产风险〔2016〕52号）、《权益价格风险管理规则（2020年12月修订）》（英大资产风险〔2021〕1号）、《投资风险事件责任追究实施办法（试行）》（英大资产风险〔2019〕25号）、《绩效考核管理管理办法（2019）》（英大资产组织〔2019〕58号）、《绩效考核管理实施细则》（英大资产组织〔2019〕59号）等制度，规定了风险管理原则、风险计量、风险点与控制手段、责任追究机制及绩效评估等方面。公司建立了032投资交易管理系统、绩效评估与风险管理系统，系统具有风险预警与合规管理、绩效评估功能。公司制定了《权益价格风险管理规则（2020年12月修订）》（英大资产风险〔2021〕1号），明确对股票仓位、行业集中度、个股集中度进行压力测试，评估投资组合产生的影响，并制定《市场风险应急预案（2020年12月修订）》（英大资产风险〔2021〕2号）。			
压力测试系统：			
系统名称	绩效评估与风险管理		
上线时间	2015-05-04	评估结果	符合规定
主要功能	按《保险机构股票投资管理标准》相关要求，我司使用的绩效评估与风险管理包括了针对股票仓位、行业集中度、个股集中度的压力测试功能，可以对投资组合做出相关评估。		
风险管理系统：			
系统名称	032投资交易管理系统		
上线时间	2015-05-04	评估结果	符合规定
主要功能	按《保险机构股票投资管理标准》相关要求，我司使用的032投资交易系统包括了针对风险预警与合规管理功能		
系统名称	绩效评估与风险管理		
上线时间	2015-05-04	评估结果	符合规定
主要功能	按《保险机构股票投资管理标准》相关要求，该系统主要功能包括绩效评估、风险分析、风险监控、报表管理、保监会上报等，该系统与估值系统无缝对接		

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。

11