

招商信诺资产管理有限公司股票投资管理能力建设及自评估情况（年度披露-20220118）

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：	黄旭锋	职务：	总经理、首席执行官兼审计责任人
行政责任人类别：	授权总经理	是否履行完备的授权程序：	是
行政责任人性别	男	行政责任人出生年月	1979-10
行政责任人学历	研究生	行政责任人学位	博士
行政责任人所在部门	经营管理层	行政责任人入司时间	2021-01-01
行政责任人专业资质	具备相关投资领域10年以上从业经历	行政责任人专业技术职务	无
专业责任人：	翟琳琳	职务：	公司首席权益投资官兼权益投资部总经理
专业责任人类别：	授权的相关资产管理部门负责人	是否履行完备的授权程序：	是
专业责任人性别	女	专业责任人出生年月	1980-04
专业责任人学历	研究生	专业责任人学位	硕士
专业责任人入司时间	2021-05-24	专业责任人所在部门	权益投资部
专业责任人专业资质	拥有10年以上在金融机构内从事金融投资和相关管理经验	专业责任人专业技术职务	无

二、组织架构

整体评估情况：

公司下发《招商信诺资产管理有限公司关于调整部门职责的通知》《招商信诺资产管理有限公司关于进一步明确公司股票投资管理能力和衍生品运用管理能力相关部门岗位职责的通知》《招商信诺资产管理有限公司关于调整风险管理部、信用评估部部门职责的通知》《招商信诺资产管理有限公司股票投资管理办法》，设立权益投资部、集中交易部、风险管理部、财务运营部、信息科技部等部门，设置股票投资的研究、投资、交易、风险管理、绩效评估、清算、核算以及系统支持等岗位，在发文中明确各部门职责、岗位职责、部门负责人及人员配置情况等。

权益投资部作为独立的股票投资部门，设股票投资岗和研究岗，根据账户/组合性质、管理资金规模配备独立的股票投资经理；集中交易部设股票交易岗；股票投资的研究、投资、交易均为专人专岗，与其他投资业务严格分离。风险管理部设风险管理岗和绩效评估岗；财务运营部设投资清算岗和估值核算岗；信息科技部设系统支持岗。

公司建立了完善的防火墙机制，包括但不限于：股票投资经理与基金投资经理之间；股票投资经理与债券投资经理之间；投资经理与交易人员之间；投资管理人员与风险控制、绩效评估人员之间；清算人员与核算人员之间。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。

经评估，上述组织架构符合《保险机构股票投资管理能力标准》的相关要求。

股票投资部门：

1

部门名称	信息科技部		
发文时间	2021-10-15	文件名称（含文号）	《招商信诺资产管理有限公司关于调整部门职责的通知》（招商信诺资管发〔2021〕232号）
岗位设置：	系统支持岗，部门负责人		

2

部门名称	权益投资部		
------	-------	--	--

发文时间	2021-10-15	文件名称（含文号）	《招商信诺资产管理有限公司关于调整部门职责的通知》（招商信诺资管发〔2021〕232号）
岗位设置：	研究岗，股票投资岗，部门负责人		
3			
部门名称	财务运营部		
发文时间	2021-10-15	文件名称（含文号）	《招商信诺资产管理有限公司关于调整部门职责的通知》（招商信诺资管发〔2021〕232号）
岗位设置：	估值核算岗，投资清算岗，部门负责人		
4			
部门名称	集中交易部		
发文时间	2021-10-15	文件名称（含文号）	《招商信诺资产管理有限公司关于调整部门职责的通知》（招商信诺资管发〔2021〕232号）
岗位设置：	股票交易岗，部门负责人		
5			
部门名称	风险管理部		
发文时间	2021-12-17	文件名称（含文号）	《招商信诺资产管理有限公司关于调整风险管理部、信用评估部部门职责的通知》（招商信诺资管发〔2021〕353号）
岗位设置：	绩效评估岗，部门负责人，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：	符合《保险机构股票投资管理能力标准》的规定要求。为确保股票投资业务不同岗位之间相互分离、制约和监督，公司下发正式文件《招商信诺资产管理有限公司关于进一步明确公司股票投资管理能力及衍生品运用管理能力相关部门岗位职责的通知》《招商信诺资产管理有限公司股票投资决策管理办法》《招商信诺资产管理有限公司交易权限管理办法》《招商信诺资产管理有限公司股票投资风险管理办法》《招商信诺资产管理有限公司投资结算业务管理办法》《招商信诺资产管理有限公司资产管理业务估值与会计核算管理办法》等制度以建立防火墙机制，包括但不限于：股票投资经理与基金投资经理之间；投资经理与交易人员之间；投资管理人员与风险控制、绩效评估人员之间；清算人员与核算人员之间。防火墙机制，具体内容包括：1) 根据公司投资决策相关制度，股票投资经理根据投决会任命，负责分配账户/组合内的股票投资运作，通过投资交易系统权限设置，实现不同账户/组合投资经理之间、股票投资经理与基金投资经理之间的隔离；2) 投资经理与交易人员隶属于不同部门，在岗位职责、系统权限、办公场所等方面实现全面隔离；3) 投资管理人员与风险控制、绩效评估人员隶属于不同部门，在岗位职责、系统权限、审批流程等方面实行全面隔离；4) 财务运营部设置独立的投资清算岗和估值核算岗，实现清算人员与核算人员的隔离。		
评估结果：	符合规定		
投资场所：	符合《保险机构股票投资管理能力标准》的规定要求。在投资场所上，权益投资部拥有足够的股票投资办公区域；交易室设置于独立的集中交易场所，与其他办公场所实行物理隔离，实行门禁管理。所有投资交易均由交易员在集中交易办公区域完成，相应的交易电脑、交易电话、行情电脑和交易网络等设施为交易人员专用。		
评估结果：	符合规定		

三、专业队伍

整体评估情况：	公司专业队伍人员数量符合《保险机构股票投资管理能力标准》股票投资规模超过10亿元的相关要求。股票投资专业队伍人员共计18人。其中专职人员共计15人，投资经理4人，研究人员7人（主要研究人员2人），交易人员2人，风控人员1人，清算人员1人。另有绩效评估人员1人，核算人员1人，系统支持人员1人。 股票投资负责人具有10年以上股票投资管理经验或者10年以上金融证券从业经历及相关专业资质；股票投资经理均具有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；主要研究人员从事行业研究3年以上。公司股票投资团队具有良好的人才基础，具备熟悉股票投资业务、具有股票投资能力的专业队伍。 以上专业队伍建设符合《保险机构股票投资管理能力标准》的相关要求
---------	--

专业队伍人员基本信息:

序号	姓名	岗位	是否为能力标准要求 的专职人员	相关经验类型	相关经验年限
1	毛 鸽	系统支持岗	否	金融证券投资从业经验	6.52
2	吴璐芸	研究岗	是	行业研究经验	0.40
3	钱旖昕	研究岗	是	行业研究经验	2.52
4	林威宇	研究岗	是	行业研究经验	0.17
5	詹孝颖	研究岗	是	行业研究经验	2.55
6	马 元	研究岗	是	行业研究经验	0.38
7	王晓博	研究岗	是	行业研究经验	4.45
8	周行远	研究岗	是	行业研究经验	4.87
9	翟琳琳	股票投资岗	是	股票投资管理经验	16.37
10	余 懿	股票投资岗	是	股票投资管理经验	4.63
11	柴若琪	股票投资岗	是	股票投资管理经验	4.55
12	柯 政	股票投资岗	是	股票投资管理经验	6.89
13	吕 湘	估值核算岗	否	金融证券投资从业经验	7.79
14	霍胜强	投资清算岗	是	金融证券投资从业经验	9.79
15	张天翼	股票交易岗	是	金融证券投资从业经验	0.06
16	姜 帆	股票交易岗	是	金融证券投资从业经验	11.02
17	孙文昭	绩效评估岗	否	金融证券投资从业经验	2.55
18	李 丹	风险管理岗	是	金融证券投资从业经验	6.97

四. 投资制度

整体评估情况:		
公司建立了完善、有效的股票投资基本制度、决策管理制度、研究管理制度、交易管理制度，以防范投资风险，保护投资人的利益。相关制度均经董事会、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。 股票投资基本制度包括《招商信诺资产管理有限公司股票投资管理办法》《招商信诺资产管理有限公司投资估值与会计核算管理办法》《招商信诺资产管理有限公司信息化基础架构及运维管理制度》《招商信诺资产管理有限公司信息安全管理办法》《招商信诺资产管理有限公司重大突发事件应急预案》《招商信诺资产管理有限公司重大突发事件应急响应管理制度》，明确了股票投资岗位职责、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、保密及危机处理等内容。决策管理制度为《招商信诺资产管理有限公司股票投资决策管理办法》，明确了投资决策体系、授权管理、实施与控制等内容。研究管理制度包括《招商信诺资产管理有限公司股票研究管理办法》《招商信诺资产管理有限公司股票池管理办法》《招商信诺资产管理有限公司交易券商选择和评价管理办法》，明确了研究管理、股票池管理和交易单元管理等内容。交易管理制度包括《招商信诺资产管理有限公司交易权限管理办法》《招商信诺资产管理有限公司公平交易管理办法》，明确了集中交易、公平交易、交易权限管理和交易监控等内容。 经评估，上述股票投资制度建设符合《保险机构股票投资管理标准》的相关要求。		
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：《招商信诺资产管理有限公司股票投资管理办法》， 发文文号：招商信诺资管发〔2021〕254号， 发文时间：2021-09-30；
业务流程	符合规定	文件名称：《招商信诺资产管理有限公司股票投资管理办法》， 发文文号：招商信诺资管发〔2021〕254号， 发文时间：2021-09-30；
操作规程	符合规定	文件名称：《招商信诺资产管理有限公司股票投资管理办法》， 发文文号：招商信诺资管发〔2021〕254号， 发文时间：2021-09-30；
会议制度	符合规定	文件名称：《招商信诺资产管理有限公司股票投资管理办法》， 发文文号：招商信诺资管发〔2021〕254号， 发文时间：2021-09-30；

文档管理	符合规定	文件名称：《招商信诺资产管理有限公司股票投资管理办法》， 发文文号：招商信诺资管发〔2021〕254号， 发文时间：2021-09-30；
绩效考核	符合规定	文件名称：《招商信诺资产管理有限公司股票投资管理办法》， 发文文号：招商信诺资管发〔2021〕254号， 发文时间：2021-09-30；
清算与核算	符合规定	文件名称：《招商信诺资产管理有限公司投资结算业务管理办法》， 发文文号：招商信诺资管发〔2021〕184号， 发文时间：2021-08-30； 文件名称：《招商信诺资产管理有限公司资产管理业务估值与会计核算管理办法》， 发文文号：招商信诺资管发〔2021〕186号， 发文时间：2021-08-23； 文件名称：《招商信诺资产管理有限公司股票投资管理办法》， 发文文号：招商信诺资管发〔2021〕254号， 发文时间：2021-09-30；
信息系统管理	符合规定	文件名称：《招商信诺资产管理有限公司信息化基础架构及运维管理制度》， 发文文号：招商信诺资管（筹）发〔2020〕9号， 发文时间：2020-07-28； 文件名称：《招商信诺资产管理有限公司信息系统安全管理办法》， 发文文号：招商信诺资管（筹）发〔2020〕9号， 发文时间：2020-07-28； 文件名称：《招商信诺资产管理有限公司计算机系统重大突发事件应急预案》， 发文文号：招商信诺资管（筹）发〔2020〕9号， 发文时间：2020-07-28； 文件名称：《招商信诺资产管理有限公司股票投资管理办法》， 发文文号：招商信诺资管发〔2021〕254号， 发文时间：2021-09-30；
保密及危机处理	符合规定	文件名称：《招商信诺资产管理有限公司股票投资管理办法》， 发文文号：招商信诺资管发〔2021〕254号， 发文时间：2021-09-30； 文件名称：《招商信诺资产管理有限公司重大突发事件应急管理制度》， 发文文号：招商信诺资管发〔2021〕269号， 发文时间：2021-10-16；
决策管理制度：		
制度内容	评估结果	制度明细
投资决策体系	符合规定	文件名称：《招商信诺资产管理有限公司股票投资决策管理办法》， 发文文号：招商信诺资管发〔2021〕255号， 发文时间：2021-09-30；
授权管理	符合规定	文件名称：《招商信诺资产管理有限公司股票投资决策管理办法》， 发文文号：招商信诺资管发〔2021〕255号， 发文时间：2021-09-30；
实施与控制	符合规定	文件名称：《招商信诺资产管理有限公司股票投资决策管理办法》， 发文文号：招商信诺资管发〔2021〕255号， 发文时间：2021-09-30；
研究管理制度：		
制度内容	评估结果	制度明细
研究管理办法	符合规定	文件名称：《招商信诺资产管理有限公司股票研究管理办法》， 发文文号：招商信诺资管发〔2021〕198号， 发文时间：2021-08-27；
股票池管理办法	符合规定	文件名称：《招商信诺资产管理有限公司股票池管理办法》， 发文文号：招商信诺资管发〔2021〕402号， 发文时间：2021-12-28；

交易单元管理办法	符合规定	文件名称：《招商信诺资产管理有限公司交易券商选择和评价管理办法》， 发文文号：招商信诺资管发〔2021〕144号， 发文时间：2021-07-02；
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：《招商信诺资产管理有限公司交易权限管理办法》， 发文文号：招商信诺资管发〔2021〕193号， 发文时间：2021-08-27；
交易权限管理	符合规定	文件名称：《招商信诺资产管理有限公司交易权限管理办法》， 发文文号：招商信诺资管发〔2021〕193号， 发文时间：2021-08-27；
公平交易	符合规定	文件名称：《招商信诺资产管理有限公司公平交易管理办法》， 发文文号：招商信诺资管发〔2021〕191号， 发文时间：2021-08-27；
交易监控	符合规定	文件名称：《招商信诺资产管理有限公司交易权限管理办法》， 发文文号：招商信诺资管发〔2021〕193号， 发文时间：2021-08-27；

五. 系统建设

整体评估情况：			
公司建立了股票投资信息技术系统，能够满足股票投资业务开展所需投资分析、实时交易、清算交收、估值核算、组合分析、限额监控等投资生命周期全流程管控，能够对投资管理产生实质影响。公司股票投资信息技术系统主要由研究分析系统、信息资讯系统、投资交易管理系统、资产估值和核算系统等系统构成。其中研究分析系统为携宁金融研究投资管理平台，涵盖资产配置模型、行业配置模型、个股估值模型、内部研究报告等功能；信息资讯系统包括2种研究资讯系统，为WIND金融终端、恒生聚源资讯终端及数据库，已获得多家券商研究服务支持；投资交易管理系统为恒生投资管理系统032，具备授权管理、合规控制和交易功能，提供覆盖前、中、后台的风险控制与管理功能，对投资组合进行实时监控与管控；资产估值和核算系统为赢时胜资产估值与核算系统，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，涵盖对公司股票投资管理业务的全过程估值与账务处理，实现报表的自动生成等。			
经评估，上述股票投资信息技术系统建设符合《保险机构股票投资管理能力标准》的相关要求。			
交易管理系统：			
系统名称	恒生投资管理系统032		
上线时间	2020-10-18	评估结果	符合规定
主要功能	公司股票交易管理系统采用恒生投资管理系统032，具备授权管理、合规控制，以及支持股票投资指令下达、审批、合规检查、交易执行、日终清算交收等交易功能。		
信息资讯系统：			
系统名称	WIND金融终端、恒生聚源资讯终端及数据库		
上线时间	2020-10-18	评估结果	符合规定
主要功能	公司信息资讯系统包括2种研究资讯系统，为WIND金融终端、恒生聚源资讯终端及数据库。WIND金融终端涵盖股票、港股、指数等众多金融品种。恒生聚源资讯终端及数据库涵盖基础资讯数据、实时与历史行情、行业动态、财务报表库等。同时获得了多家券商研究服务支持，包括但不限于3家已签约主结算商。		
研究分析系统：			
系统名称	携宁金融研究投资管理平台		
上线时间	2021-09-06	评估结果	符合规定
主要功能	公司研究分析系统采用携宁金融研究投资管理平台，该平台具备资产配置、行业配置模型、个股估值模型、内部研究报告系统等模块，可将市场资讯、舆情等非结构化数据与内部、外部数据进行整合。其中，资产配置模块可实现大类资产数据跟踪与生成；行业配置模型可实现中观行业数据跟踪与生成；个股估值模型可实现个股财务预测导入、修改、查阅等功能；研究报告系统可实现研究报告的撰写、查阅、审核、存储等功能。		
资产估值和核算系统：			
系统名称	赢时胜资产估值与核算系统		
上线时间	2020-10-18	评估结果	符合规定

主要功能	公司资产估值和核算系统采用赢时胜资产估值与核算系统，该系统具备证券基础信息维护、会计核算、资产估值、清算交割、托管行对账、后台报表报送等功能，能够每日进行清算和估值，实现估值表、余额表等报表自动生成，保障公司股票资产清算交割与财务核算工作安全、有序、高效进行。
------	--

六. 风险控制

整体评估情况：			
公司建立了覆盖事前控制、事中监督、事后评价的风险控制体系。事前充分识别股票资产组合的敞口、敏感性、损失、集中度和风险价值等风险，通过建立限额指标体系确保资产组合风险可控；同时，为应对尾部市场风险，风险管理部对股票资产进行逐笔入股票投资池管理，依托各类市场风险量化指标，充分识别入池资产产生永久性亏损的可能性，将有退市、闪崩、财务造假、做庄等风险的标的从股票投资范围内剔除。事中风险管理部对每笔交易进行限额、集中度、价格偏离等指标的人工确认和股票池的动态管理。事后持续对限额指标和风险信息进行监控和预警，定期或不定期进行资产风险排查和绩效归因分析，形成相关风险报告。公司实行独立于投资管理的风险报告制度，包含以日、月、季、年为频次的定期风险报告和各类不定期风险报告。			
公司制定了《招商信诺资产管理有限公司市场风险管理办法》《招商信诺资产管理有限公司股票投资风险管理办法》，风险管理制度内容包括但不限于股票资产的风险管理原则、风险识别和管理、市场风险限额、风险计量、风险监测与预警、风险报告、绩效评估、风险点与控制手段、压力测试、应急管理和责任追究机制等。公司建立了完善的风险管理系统，包括风险预警与合规管理、绩效评估和压力测试等系统，其中压力测试系统对股票仓位、行业集中度、个股集中度实行压力测试，评估不同的压力情景对投资组合产生的影响，并以此为基础制定相应的应急预案。			
经评估，上述风险控制体系符合《保险机构股票投资管理标准》的相关要求。			
压力测试系统：			
系统名称	恒生绩效评估与风险管理系统		
上线时间	2020-10-18	评估结果	符合规定
主要功能	恒生绩效评估与风险管理系统，具有股票资产压力测试模块，实现了对股票仓位、行业集中度和个股集中度的压力测试分析，评估压力情景下对公司股票投资组合的影响，并根据公司压力测试管理办法相关要求制定相应的应急预案。		
风险管理系统：			
系统名称	恒生投资管理系统032		
上线时间	2020-10-18	评估结果	符合规定
主要功能	恒生投资管理系统032，具有风险控制和投资决策模块，包括审批权限维护、投资风险设置、风险预警查询和静态风险监控、证券池管理等功能，可实现风险和合规管理限额指标的设置、预警、监控和股票池的动态管理。		
系统名称	恒生绩效评估与风险管理系统		
上线时间	2020-10-18	评估结果	符合规定
主要功能	恒生绩效评估与风险管理系统，具有组合查询、组合风险、组合绩效、限额监控、风险预警、报告管理等功能模块，实现了风险预警、合规管理和绩效评估等功能。		

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。