

# 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（20230119））



## 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:	王欣	职务:	权益投资部副总经理（主持工作）
专业责任人类别:	授权的相关资产管理部负责人	是否履行完备的授权程序:	是
专业责任人性别	男	专业责任人出生年月	1981-07
专业责任人学历	研究生	专业责任人学位	博士
专业责任人入司时间	2021-06-01	专业责任人所在部门	权益投资部
专业责任人专业资质	特许金融分析师（CFA），通过基金从业资格考试和期货从业资格考试，具备相关投资领域10年以上从业经历	专业责任人专业技术职务	无

## 二、组织架构

整体评估情况:			
<p>公司正式下发《招商信诺资产管理有限公司关于调整投资银行事业部等部门职责的通知》《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股票投资管理办法》等相关文件，建立了职责明确、分工合理的股票投资组织架构，设立权益投资部、集中交易部、风险管理部、财务部、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、核算以及系统管理等岗位，并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。</p> <p>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；信息科技部设系统管理岗。</p> <p>公司已建立完善的防火墙机制，严格分离前、中、后台岗位职责，实现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及绩效评估人员之间、清算人员与核算人员之间等不相容岗位的相互分离及制约监督。公司拥有足够的股票投资场所，已设立独立的集中交易室并实行门禁管理，确保集中交易办公区域完全隔离。</p> <p>经评估，公司的组织架构符合《保险机构股票投资管理标准》的相关要求。</p>			
股票投资部门:			
1			
部门名称	信息科技部		
发文时间	2022-11-22	文件名称（含文号）	《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》（招商信诺资管发〔2022〕496号）
岗位设置:	系统管理岗,部门负责人		







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〔2022〕482号， 发文时间：2022-11-04；
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〔2022〕482号， 发文时间：2022-11-04；
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〔2022〕482号， 发文时间：2022-11-04；
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〔2022〕482号， 发文时间：2022-11-04；
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〔2022〕482号， 发文时间：2022-11-04；
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〔2022〕574号， 发文时间：2022-12-29； 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〔2022〕482号， 发文时间：2022-11-04； 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；
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股票投资管理 办法》， 发文文号：招商信诺资管发〔2022〕482号， 发文时间：2022-11-04； 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信息技术运 维服务管理办法》， 发文文号：招商信诺资管发〔2021〕397号， 发文时间：2021-12-24； 文件名称：《招商信诺资产管理有限公司信息安全管 理办法》， 发文文号：招商信诺资管发〔2022〕526号， 发文时间：2022-12-12；
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； 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〔2022〕482号， 发文时间：2022-11-04；
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〔2022〕483号， 发文时间：2022-11-04；
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〔2022〕483号， 发文时间：2022-11-04；
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〔2022〕483号， 发文时间：2022-11-04；

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（2022）484号， 发文时间：2022-11-04；
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（2022）481号， 发文时间：2022-11-04；
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：2021-07-01；
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（2022）125号， 发文时间：2022-04-06；
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； 文件名称：《招商信诺资产管理有限公司异常交易行为管理办法》， 发文文号：招商信诺资管发（2022）396号， 发文时间：2022-09-07；

## 五. 系统建设

整体评估情况：			
<p>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。公司股票投资信息核心技术系统主要由研究分析系统、信息资讯系统、投资交易系统、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、后台业务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和标准》的相关要求。</p>			
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。		



