

中信保诚资产管理有限责任公司股票投资管理能力建设及自评估情况（年度披露-20220129）

文件类型：协会备案版本

一、基本情况

1. 公司基本信息

公司名称：	中信保诚资产管理有限责任公司	机构性质：	资管公司
成立日期：	2020-03-31	法人代表：	赵小凡
注册地址：	北京市朝阳区东三环中路1号1幢1单元5层501内01-02、15-16单元	注册资本（万）：	50000.0000
控股股东：	中信保诚人寿保险有限公司		
信息披露联系人（公司整体信息披露联系人）			
	联系人	负责人	
姓名	李然	辛强	
部门	董事会办公室	公司层	
岗位	公司治理岗	合规负责人、首席风险管理执行官、董事会秘书	
邮箱	Ran.R.Li@citicpru.com.cn	Qiang.Q.Xin@citicpru.com.cn	
电话	17343154945	010-85878000-6800	

2. 能力建设及评估基本信息

能力名称：	保险资管公司股票投资管理 能力	披露类型：	年度披露
能力评估情况：	对照监管要求，公司从组织架构、专业队伍、投资制度、系统建设和风险控制等方面对股票投资管理开展自评估工作。经过评估，公司在股票投资管理方面均符合该能力标准规定的基本条件。 评估程序：在公司管理层的统一部署下，前中后台部门负责人组成自评估工作小组，通过政策学习深刻理解监管要求，制定自评估工作方案，先后开展预评估和自评估工作。在股票投资管理预评估工作的基础上，公司进一步逐项对照监管要求并请示监管机构，不断完善提升股票投资管理正式开展自评估工作，并按照监管要求完成披露工作。 评估决策机制：按照公司内部制度规定，股票投资管理自评估工作小组将经管理层审核的公司投资管理建设及自评估情况材料上报董事会战略与投资委员会、董事会审计与风险管理委员会审批，形成公司最终意见，正式完成披露工作。 评估管理：公司借鉴SARMRA自评估方法，采用查阅资料、访谈、穿行测试等方式，由股票投资部逐项对标监管要求开展专项自评估工作，法律合规部对自评估结果进行合规评估，审计部门作为第三道防线对自评估材料和合规评估结果进行复核，最终形成股票投资管理自评估结果，上报管理层审核，经董事会战略与投资委员会、董事会审计与风险管理委员会审批后，形成自评估情况最终意见。经过公司自评估，公司达到监管对股票投资管理建设情况规定的各项基本条件，符合能力标准要求。		
本次能力评估结果：	符合能力标准要求		
行政责任人姓名：	赵小凡	职务：	副董事长、总经理
行政责任人类型：	授权总经理	是否履行完备的授权程序：	是
行政责任人电话	18519899015	行政责任人邮箱	Xiaofan.Zhao@citicpru.com.cn
行政责任人性别	男	行政责任人出生年月	1964-03
行政责任人学历	博士研究生	行政责任人学位	博士

行政责任人所在部门	中信保诚资产管理有限责任公司	行政责任人入司时间	2020-04-15
行政责任人专业资质	相关投资领域10年以上从业经验	行政责任人专业技术职务	高级会计师
专业责任人姓名:	原瑞政	职务:	副总经理
专业责任人类型:	高级管理人员	是否履行完备的授权程序:	
专业责任人电话	13911136566	专业责任人邮箱	Ruizheng.Yuan@citicpru.com.cn
专业责任人性别	男	专业责任人出生年月	1980-08
专业责任人学历	硕士研究生	专业责任人学位	硕士
专业责任人入司时间	2020-12-07	专业责任人所在部门	中信保诚资产管理有限责任公司
专业责任人专业资质	10年以上证券从业及相关投资经验	专业责任人专业技术职务	无
股票投资管理信息披露联系人及负责人:			
	联系人	负责人	
姓名	韩宇	杜中明	
部门	股票投资部	股票投资部	
岗位	投资研究	部门总经理	
邮箱	Yu.Y.Han@citicpru.com.cn	ZhongMing.Du@citicpru.com.cn	
电话	18810063819	13811461834	
备注			

二、组织架构

整体评估情况:

中信保诚资产管理有限责任公司开展股票投资业务,建立了由董事会负最终责任、管理层直接领导,以及相关业务部门、专业委员会、专业工作小组共同参与组成的投资管理体系,具体涉及的机构和部门包括董事会及董事会战略与投资委员会、高级管理层及其下设专业委员会、资产配置小组、权益专业小组、股票投资部、交易室、风险控制部、法律合规部、财务部、信息技术部等相关部门,覆盖投资研究、投资决策、交易执行、清算核算、风险管理、绩效评估、系统支持等全流程中的各个环节,并通过《股票投资管理制度》等基本制度明确了各层级机构、相关部门、专业委员会及专业工作小组在股票投资业务各环节中的职责与权限。公司设置了独立的股票投资部门,股票投资业务岗位及人员配备完善,包括股票投资的研究、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,其中研究、投资、交易岗位实行专人专岗,并与其他投资业务严格分离。目前股票投资业务专业团队共有19人,其中投资经理4人、研究人员7人(主要研究人员4人),交易人员3人,风控人员、清算人员、核算人员、绩效评估人员、系统支持人员各1人。工作经验方面,投资经理、主要研究员均有丰富的相关工作经验;其中,投资经理均拥有10年以上的金融证券从业经验,主要研究员的行业研究经验均在4年以上。

公司在组织架构设置及部门职责的通知文件中明确了股票投资部职责,并在该部门下设总经理、投资经理、投资经理助理、投资研究等4个岗位,在岗位职责说明书中明确了岗位职责。

公司股票投资业务实行严格的防火墙机制和集中交易制度,严格分离投资前、中、后台岗位责任,隔离股票投资和基金投资岗位职责,并严格隔离投资决策与交易执行,以确保股票投资业务不相容岗位相互分离、制约和监督。公司设立集中交易室,实行门禁管理,确保集中交易办公区域完全隔离。

经评估,公司股票投资管理组织架构符合《保险机构股票投资管理能力标准》的相关要求。

评估结果: 符合规定

股票投资部门:

1

部门名称: 交易室

发文时间: 2020-12-07

文件名称(含文号): 关于中信保诚资产管理有限责任公司组织架构设置及部门职责的通知(中信保诚资办〔2020〕12号)

评估结果:	符合规定
投资场所:	我公司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, 我公司投资场所符合《保险机构股票投资管理标准》的相关要求。
评估结果:	符合规定

三、专业队伍

整体评估情况:					
我公司股票投资规模超过10亿元, 专业队伍人员19人, 其中股票投资经理4人, 研究人员7人(主要研究人员4人), 交易人员3人, 风控人员1人, 清算人员1人, 估值核算人员1人, 绩效评估人员1人, 系统管理人员1人。其中股票投资负责人具有10年以上金融证券从业经历及相关专业资质, 投资经理具有10年以上金融证券从业经历, 有良好的过往业绩表现, 主要研究人员从事行业研究4年以上。经评估, 股票投资管理专业队伍建设情况符合《保险机构股票投资管理标准》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	许晓光	交易	是	金融证券投资从业经验	9.43
2	李天宇	交易	是	金融证券投资从业经验	3.36
3	钟志兴	交易	是	金融证券投资从业经验	10.54
4	胡春雨	系统管理	否	金融证券投资从业经验	6.34
5	姚世泽	投资研究	是	行业研究经验	4.24
6	李凯欣	组合管理	是	金融证券投资从业经验	2.45
7	韩宇	投资研究	是	行业研究经验	2.49
8	夏毕畅	投资研究	是	行业研究经验	4.67
9	刘一瑾	投资研究	是	行业研究经验	2.16
10	谢泓仪	投资研究	是	行业研究经验	0.52
11	金炜	投资经理	是	金融证券投资从业经验	11.58
12	杜中明	投资经理	是	金融证券从业经历	10.50
13	万力	投资经理助理	是	行业研究经验	10.37
14	袁梦	核算估值	否	金融证券投资从业经验	5.17
15	刘啸尘	资金清算	是	金融证券投资从业经验	5.80
16	章小韩	投资经理	是	金融证券投资从业经验	13.75
17	徐荃子	投资经理	是	金融证券投资从业经验	11.47
18	阎姝君	投资经理助理	是	行业研究经验	5.38
19	吴彪	市场风险管理	是	金融证券投资从业经验	13.23

四. 投资制度

整体评估情况:		
公司构建、实施了专业、分层的投资制度体系, 并按照分层管理原则划分为政策、制度、细则和工作规范四个层级。公司已按规定建立了完善、有效的股票投资基本制度、决策管理制度、研究管理制度、交易管理制度等, 各层级相关文件均经有权审批部门审批, 以公司正式文件形式下发执行, 具体包括《股票投资管理制度》、《投资与授信审批授权管理制度》、《市场风险管理制度》、《股票投资操作流程与合规索引》、《股票池管理细则》、《股票投资止损管理细则》、《股票中长期战略投资操作细则》、《新股投资决策细则》、《股票投资合规与风控管理细则》等, 对股票投资业务中投资研究、投资决策、交易执行、清算核算、风险管理、绩效评估、系统支持各个环节进行规范化管理。经评估, 公司股票投资制度体系建设情况符合《保险机构股票投资管理标准》要求。		
股票投资基本制度:		
制度内容	评估结果	制度明细
会议制度	符合规定	文件名称: 中信保诚资产管理有限责任公司股票投资管理制度, 发文文号: 中信保诚资发(2020)6号, 发文时间: 2020-11-12;

信息系统管理	符合规定	文件名称：中信保诚资产管理有限责任公司股票投资管理制度， 发文文号：中信保诚资发〔2020〕6号， 发文时间：2020-11-12；
绩效考核	符合规定	文件名称：中信保诚资产管理有限责任公司股票投资管理制度， 发文文号：中信保诚资发〔2020〕6号， 发文时间：2020-11-12；
操作规程	符合规定	文件名称：中信保诚资产管理有限责任公司股票投资操作流程与合规索引， 发文文号：中信保诚资发〔2020〕6号， 发文时间：2020-11-12；
保密及危机处理	符合规定	文件名称：中信保诚资产管理有限责任公司股票投资管理制度， 发文文号：中信保诚资发〔2020〕6号， 发文时间：2020-11-12；
业务流程	符合规定	文件名称：中信保诚资产管理有限责任公司股票投资管理制度， 发文文号：中信保诚资发〔2020〕6号， 发文时间：2020-11-12；
股票投资岗位职责	符合规定	文件名称：中信保诚资产管理有限责任公司股票投资管理制度， 发文文号：中信保诚资发〔2020〕6号， 发文时间：2020-11-12；
清算与核算	符合规定	文件名称：中信保诚资产管理有限责任公司股票投资管理制度， 发文文号：中信保诚资发〔2020〕6号， 发文时间：2020-11-12；
文档管理	符合规定	文件名称：中信保诚资产管理有限责任公司股票投资管理制度， 发文文号：中信保诚资发〔2020〕6号， 发文时间：2020-11-12；
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：中信保诚资产管理有限责任公司股票投资管理制度， 发文文号：中信保诚资发〔2020〕6号， 发文时间：2020-11-12；
实施与控制	符合规定	文件名称：中信保诚资产管理有限责任公司股票池管理细则， 发文文号：中信保诚资发〔2020〕6号， 发文时间：2020-11-12； 文件名称：中信保诚资产管理有限责任公司股票投资止损管理细则， 发文文号：中信保诚资发〔2020〕6号， 发文时间：2020-11-12；
投资决策体系	符合规定	文件名称：中信保诚资产管理有限责任公司股票投资管理制度， 发文文号：中信保诚资发〔2020〕6号， 发文时间：2020-11-12；
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：中信保诚资产管理有限责任公司股票投资管理制度， 发文文号：中信保诚资发〔2020〕6号， 发文时间：2020-11-12；
交易单元管理办法	符合规定	文件名称：中信保诚资产管理有限责任公司服务券商管理制度， 发文文号：中信保诚资发〔2020〕10号， 发文时间：2020-11-17；
股票池管理办法	符合规定	文件名称：中信保诚资产管理有限责任公司股票池管理细则， 发文文号：中信保诚资发〔2020〕6号， 发文时间：2020-11-12；
交易管理制度：		
制度内容	评估结果	制度明细

交易权限管理	符合规定	文件名称：中信保诚资产管理有限责任公司集中交易管理制度， 发文文号：中信保诚资发〔2021〕190号， 发文时间：2021-12-31；
集中交易	符合规定	文件名称：中信保诚资产管理有限责任公司集中交易管理制度， 发文文号：中信保诚资发〔2021〕190号， 发文时间：2021-12-31；
公平交易	符合规定	文件名称：中信保诚资产管理有限责任公司集中交易管理制度， 发文文号：中信保诚资发〔2021〕190号， 发文时间：2021-12-31；
交易监控	符合规定	文件名称：中信保诚资产管理有限责任公司交易监控规范， 发文文号：中信保诚资发〔2021〕182号， 发文时间：2021-12-30；

五. 系统建设

整体评估情况：			
公司建立了有效的信息化治理机制，成立了信息化工作委员会，并由信息技术部具体负责信息化工作相关的规划、建设、管理和运维等工作，已上线投产投资交易系统、资产估值与会计核算系统、投资研究管理系统、万得金融终端、彭博金融终端、EMIS数据库等系统和资讯，各系统上线后运行稳定，有效支持了股票投资业务的开展。 在IT基础设施建设、日常运维保障、信息安全管理方面，以保障核心业务的连续性为目标，以相关监管要求为指导，从管理和技术两个层面开展工作，通过建立完善的信息化政策、制度、细则、规范和应急预案体系，有序开展生产运维工作，设计高可用和扩展性强的信息系统架构，制定并实时监控IT风险指标等管理和技术多种手段，保障信息系统可靠、稳定、高效地运行，确保系统的机密性、完整性和可用性。 经评估，公司系统建设情况符合《保险机构股票投资管理标准》要求。			
交易管理系统：			
系统名称	恒生投资交易系统032		
上线时间	2013-12-31	评估结果	符合规定
主要功能	交易管理系统具备授权管理、合规控制、交易功能、指令管理、资金管理、清算交收等功能。 具体包括： (1) 根据不同角色授予用户系统菜单、投资账户和指令审批权限； (2) 投资账户及组合持仓资产查询、管理； (3) 投资指令下达与审批，记录投资决策流程； (4) 对投资指令的合规审核控制及风险控制功能； (5) 交易分发、执行及成交数据接收； (6) 交易所业务数据清算功能； (7) 外接第三方投资管理、算法交易、资讯服务等业务平台的扩展功能； (8) 具备按照最新法律法规及业务制度迭代更新的功能拓展空间。		
信息资讯系统：			
系统名称	EMIS数据库		
上线时间	2019-06-30	评估结果	符合规定
主要功能	EMIS数据库可获得多家券商研究服务支持，是能够提供多信息来源的行业报告+公司信息（上市公司+非上市公司财务数据）的一站式集成平台，数据涵盖绝大部分新兴市场区域范围。平台中非券商来源的公司、行业研究报告具有明显的参考价值，尤其是平台中的非上市公司财务数据为其独家所有，对于项目投资、公司研究具有非常重要的参考作用。		
系统名称	彭博金融终端Bloomberg		
上线时间	2019-08-31	评估结果	符合规定
主要功能	彭博终端可将金融市场的实时数据、驱动市场的新闻、深度研究、分析功能、沟通工具和世界级的交易执行系统整合为一体，提供全面解决方案。		
研究分析系统：			
系统名称	Wind金融终端WFT		
上线时间	2012-12-31	评估结果	符合规定

责任公司
 1030130

主要功能	投研人员通过获取数据及资讯进行分析并指导资产配置以及股票组合的行业配置，对个股进行财务预测并生成估值结果，分析结果可为股票投资决策提供参考依据。具体而言，Wind金融终端WFT包括资产配置模型、行业配置模型、个股估值模型等。其中资管系统（AMS）包含资产配置和行业配置相关功能，可为股票投资过程中涉及大类资产配置及行业配置等方面问题提供决策依据。Evaluator估值模板主要用于建立个股财务估值预测模型，模型预测结果可以为股票投资决策提供参考依据。		
系统名称	携宁投资研究管理系统SIRM		
上线时间	2017-12-31	评估结果	符合规定
主要功能	携宁投资研究管理系统SIRM是公司的内部研究报告管理系统。平台功能主要包括内部研究报告管理、行业/股票分管、行业研究、股票评级及盈利预测、股票池管理、绩效统计、数据中心、系统管理等功能模块。投研人员撰写发布研究报告，并对股票池进行管理，股票投资必须以对应标的入池及出池为依据。		
资产估值和核算系统：			
系统名称	恒生资产估值与会计核算系统		
上线时间	2013-12-31	评估结果	符合规定
主要功能	资产估值和核算系统具备安全、高效的清算交割、财务核算系统，能够每日进行清算和估值，实现报表自动生成等。 具体包括：根据财政部有关规定，对投资的运营情况进行会计核算。即对一个投资组合从成立到日常业务处理的全过程估值和账务处理。每日通过集成外部资讯、交易所、投资交易等接口文件，进行清算，由清算结果生成财务凭证，最后生成各种报表完成资产的估值，可及时反映投资业务相关的财务状况和经营成果。		

六. 风险控制

整体评估情况：			
公司建立了由董事会负最终责任、管理层直接领导，相关专业委员会、专业工作小组和业务部门共同参与的矩阵式风险管理体系，前中后台三道防线各司其职，各负其责；制定了《市场风险管理制度》、《重大突发事件应急管理制度》、《风险报告管理制度》、《股票投资合规与风控管理细则》、《权益价格风险管理实施细则》、《股票投资风险预警及止损操作规范》等风险管理制度，对股票投资过程中产生的风险进行识别、评估、监控和报告，覆盖事前控制、事中监督、事后评价全过程；公司运用定性、定量分析手段，分析股票投资的价值波动及风险暴露，定期开展压力测试与情景分析，并评估其对投资组合产生的影响；按照《风险报告管理制度》，风险控制部通过风险管理信息系统对各类风险指标进行自动测量、监控和报告，建立了独立于投资管理的报告制度和管理流程。			
经评估，公司股票投资风险控制方面符合《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	绩效评估与风险管理系统		
上线时间	2014-03-31	评估结果	符合规定
主要功能	绩效评估与风险管理系统，系统具有股票资产压力测试功能模块，可以满足对股票仓位、行业集中度、个股集中度进行压力测试，测试结果可以反映压力情景下投资组合市值变化，若市场出现大幅波动等情况，我司将根据相关制度规范，启动并制定相应的应急处置措施。整体评估情况符合监管规定。		
风险管理系统：			
系统名称	绩效评估与风险管理系统		
上线时间	2014-03-31	评估结果	符合规定
主要功能	绩效评估与风险管理系统具有组合风险、组合绩效功能模块，可以针对权益类资产进行风险分析，主要包括：盈亏分析、VaR分析、Beta分析、情景分析等，同时系统可以每日监控市场风险限额指标，针对超限指标进行风险预警和提示。组合绩效方面，系统可以进行资金运用收益、业绩归因、择机分析等，可以满足风险预警和绩效评估管理要求。整体评估情况符合监管规定。		
系统名称	恒生投资交易管理系统032		
上线时间	2013-12-31	评估结果	符合规定
主要功能	恒生投资交易管理系统032建设了股票禁投池，针对监管禁止、有违法违规行为的上市公司，系统将自动列入禁投池，具有风险预警与合规管理功能。整体评估情况符合监管规定。		

七、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。



