

亚太财产保险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	臧炜	亚太财产保险有 限公司董事长	亚太财产保险有限公司关于直接股票投资业务行政责任人的基本信息披露公告.PDF
专业责任人	朱军宁	亚太财产保险有 限公司资产管理 中心副总经理	亚太财产保险有限公司关于直接股票投资业务风险责任人的基本信息披露公告.PDF

二、组织架构

整体评估情况
公司由资产管理中心负责开展资金运用管理的主要工作，下设九个部门，包括固定收益投资部、权益投资部、不动产投资部、金融资产投资投资部、投资研究部、信用评估部、风险控制部、集中交易部、运行保障部,其中:权益投资部股票投资团队负责股票投资工作，投资研究部股票研究团队负责股票投资研究工作，风险控制部负责监控股票相关风险，集中交易部负责股票交易工作，运行保障部负责清算等运营管理工作，相关岗位专人专岗，且公司股票投资负责人具有10年以上金融证券从业经历。另外，公司财务管理部负责股票投资的核算与估值工作。公司以自有资金及传统产品分立账户，并配备独立的股票投资经理，股票账户管理资金规模不超过10亿元。综上所述，公司已建立了严格的股票投资防火墙机制，组织架构设置符合相关规定。 公司为股票投资建立了规范的办公环境，交易指令皆在独立的交易室内执行，投资场所符合相关规定。

资产管理部门设置		
部门名称		资产管理中心
股票投资部门 (团队)	发文时间	2020-12-31
	发文文号	亚太财险人[2016]160号、亚太财险发[2020]867号
	文件名称	《关于设立资产管理中心的通知》、《关于进一步明确资产管理中心内部组织架构的通知》
	岗位设置	资管中心设有股票投资负责人、股票投资经理、行业研究员、交易员、风险管理经理、运行保障经理（负责清算）、资产配置经理（负责资产配置和绩效评估），信息技术部设有投资系统运维岗，财务管理部设有投资核算岗。
	投资经理	公司在股票投资团队中配置了3名负责股票投资业务的投资管理人员，3名投资经理均具有3年以上股票投资管理经验。上述人员在授权范围内自主决策。

	投资场所	公司为股票投资建立了规范的办公环境，其中：股票交易方面采用集中交易模式，并设置独立的集中交易室，与其他办公场所实行的物理隔离及门禁管理，交易指令皆在独立的交易室内执行。
	防火墙机制	公司建立了严格的防火墙机制，包括但不限于： 1.股票投资经理与基金投资经理之间； 2.投资经理与交易人员之间； 3.投资管理人员与风险控制、绩效评估人员之间； 4.清算人员与核算人员之间。 具体而言，股票投资经理与基金投资经理分别由不同的投资人员担任；股票投资和交易分设不同的岗位，投资交易指令通过交易系统或者电话、传真等发送给交易人员并由其执行；对于投资经理、研究员、交易员、风险控制人员、运行保障人员等，实现人员及岗位分离；投资核算岗位设置于财务管理部，在业务上有效对接。

三、专业队伍

整体评估情况

我公司股票投资部门，共配备了12名熟悉股票投资业务专职人员，其中投资经理3人，研究人员5人（其中主要研究人员2人），交易人员2人，风控人员1人，清算人员1人；相关专业人员数量、从业经历、资质能力均符合相关规定。

股票投资规模	不超过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5名（主要研究人员3名）

序号	姓名	岗位	相关经验类型	经验年限(年)	是否兼职
1	董丽蒙	投资经理	金融证券投资从业经验	8	否
2	陈光	投资经理	股票投资管理经验	5	否
3	胡静	行业研究员	行业研究	3	否
4	王婷	行业研究员	行业研究	2	否
5	程永宾	行业研究员	行业研究	5	否
6	朱军宁	总经理	股票投资管理经验	13	是
7	邢晓迪	投资经理	金融证券投资从业经验	6	否
8	韩慧	行业研究员	行业研究	4	否
9	田春燕	行业研究员	行业研究	7	否

3-2、交易人员2名，风控人员1名，清算人员1名

序号	姓名	岗位	是否兼职
1	卜硕	交易员	否

2	陈轩	风险管理经理	否
3	卫纪伟	运行保障经理	否
4	张微	交易员	否

四、投资制度

整体评估情况
公司按规定建立了完善、有效的股票投资相关制度，内容涵盖投资决策体系、授权管理、职责与分工、业务流程、操作规程、会议管理、文档管理、业绩考核、清算与核算、信息系统管理、保密与危机处理、股票投资风险管理、投资人员股票投资行为管理、研究管理、股票池管理、交易单元管理、交易管理等，有效规范了公司股票投资业务流程，控制股票投资风险，相关制度文件已正式发文执行，制度建设符合银保监会相关规定及要求。

基本制度	
股票投资岗位职责	
制度明细	
文件名称	《亚太财产保险有限公司股票投资管理办法》
发文文号	亚太财险发〔2018〕537号
发文时间	2018-08-08
评估结果	符合规定
业务流程	
制度明细	
文件名称	《亚太财产保险有限公司股票投资管理办法》
发文文号	亚太财险发〔2018〕537号
发文时间	2018-08-08
评估结果	符合规定
操作规程	
制度明细一	
文件名称	《亚太财产保险有限公司股票投资管理办法》
发文文号	亚太财险发〔2018〕537号
发文时间	2018-08-08
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	《亚太财产保险有限公司股票投资交易实施细则》
发文文号	亚太财险发〔2018〕543号
发文时间	2018-08-13
评估结果	符合规定
会议制度	
制度明细	
文件名称	《亚太财产保险有限公司股票投资管理办法》
发文文号	亚太财险发〔2018〕537号
发文时间	2018-08-08
评估结果	符合规定
文档管理	
制度明细	

文件名称	《亚太财产保险有限公司股票投资管理办法》
发文文号	亚太财险发〔2018〕537号
发文时间	2018-08-08
评估结果	符合规定
绩效考核	
制度明细	
文件名称	《亚太财产保险有限公司股票投资业绩考评管理办法》
发文文号	亚太财险发〔2016〕429号
发文时间	2016-06-01
评估结果	符合规定
清算与核算	
制度明细	
文件名称	《亚太财产保险有限公司股票投资管理办法》
发文文号	亚太财险发〔2018〕537号
发文时间	2018-08-08
评估结果	符合规定
信息系统管理	
制度明细一	
文件名称	《亚太财产保险有限公司股票投资管理办法》
发文文号	亚太财险发〔2018〕537号
发文时间	2018-08-08
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	《亚太财产保险有限公司资金运用信息技术管理办法》
发文文号	亚太财险发〔2018〕251号
发文时间	2018-05-11
评估结果	符合规定
保密及危机处理	
制度明细	
文件名称	《亚太财产保险有限公司股票投资管理办法》
发文文号	亚太财险发〔2018〕537号
发文时间	2018-08-08
评估结果	符合规定
其他（非必填）	
制度明细	
文件名称	《亚太财产保险有限公司投资人员股票投资行为管理办法》
发文文号	亚太财险发〔2017〕350号
发文时间	2017-07-24
评估结果	符合规定

决策管理制度
投资决策体系
制度明细

文件名称	《亚太财产保险有限公司投资决策和授权管理办法》
发文文号	亚太财险发〔2017〕346号
发文时间	2017-03-28
评估结果	符合规定
授权管理	
制度明细一	
文件名称	《亚太财产保险有限公司投资决策和授权管理办法》
发文文号	亚太财险发〔2017〕346号
发文时间	2017-03-28
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	《亚太财产保险有限公司股票投资管理办法》
发文文号	亚太财险发〔2018〕537号
发文时间	2018-08-08
评估结果	符合规定
实施与控制	
制度明细一	
文件名称	《亚太财产保险有限公司投资决策和授权管理办法》
发文文号	亚太财险发〔2017〕346号
发文时间	2017-03-28
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	《亚太财产保险有限公司股票投资管理办法》
发文文号	亚太财险发〔2018〕537号
发文时间	2018-08-08
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	《亚太财产保险有限公司股票研究管理办法》
发文文号	亚太财险发〔2018〕532号
发文时间	2018-08-08
评估结果	符合规定
股票池管理办法	
制度明细	
文件名称	《亚太财产保险有限公司股票池管理办法》
发文文号	亚太财险发〔2018〕532号
发文时间	2018-08-08
评估结果	符合规定
交易单元管理办法	
制度明细	
文件名称	《亚太财产保险有限公司交易单元管理办法》
发文文号	亚太财险发〔2018〕535号
发文时间	2018-08-08

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	《亚太财产保险有限公司投资交易管理办法》
发文文号	亚太财险发〔2018〕654号
发文时间	2018-09-26
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	《亚太财产保险有限公司股票投资交易实施细则》
发文文号	亚太财险发〔2018〕543号
发文时间	2018-08-13
评估结果	符合规定
公平交易	
制度明细一	
文件名称	《亚太财产保险有限公司投资交易管理办法》
发文文号	亚太财险发〔2018〕654号
发文时间	2018-09-26
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	《亚太财产保险有限公司股票投资交易实施细则》
发文文号	亚太财险发〔2018〕543号
发文时间	2018-08-13
评估结果	符合规定
交易权限管理	
制度明细一	
文件名称	《亚太财产保险有限公司投资交易管理办法》
发文文号	亚太财险发〔2018〕654号
发文时间	2018-09-26
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	《亚太财产保险有限公司股票投资交易实施细则》
发文文号	亚太财险发〔2018〕543号
发文时间	2018-08-13
评估结果	符合规定
交易监控	
制度明细一	
文件名称	《亚太财产保险有限公司投资交易管理办法》
发文文号	亚太财险发〔2018〕654号
发文时间	2018-09-26
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	《亚太财产保险有限公司股票投资交易实施细则》
发文文号	亚太财险发〔2018〕543号

发文时间	2018-08-13
评估结果	符合规定

五、系统建设

整体评估情况

公司采购多家信息系统以支持股票投资业务的正常运作，配置了研究分析系统及两种信息资讯系统，另配有恒生一体化投资管理系统，其中包括估值核算、风险控制及交易管理三个子系统，信息系统建设、功能、使用及运行情况符合相关法规要求，目前系统运行良好，能够保证包括股票投资业务顺利开展。

研究分析系统

系统名称	上线时间	评估结果
Wind资讯系统	2016-12-14	符合规定
同花顺iFinD智能研报管理系统V1.0	2020-12-27	符合规定
主要功能		
公司配置Wind资讯终端，包含资产模型、行业配置模型、个股估值模型等模块，满足股票投资研究需求。公司通过同花顺智能研报管理系统进行内部研究报告管理、股票池维护等，按照不同行业研究进行分类，以行业研究、公司研究、调研纪要、数据库等分类编写和上传研报，对研报进行存档、研究池调整等管理，为投资经理及研究员提供内部研究信息，满足日常研究分析工作需要。		

信息资讯系统

系统名称	上线时间	评估结果
Wind资讯系统	2016-12-14	符合规定
同花顺资讯系统	2020-12-27	符合规定
主要功能		
公司目前配备了wind资讯系统和同花顺资讯系统，其均为国内大型金融工程和财经数据仓库，为投资提供完备的金融服务解决方案及研究支持。公司已签约兴业证券、天风证券、中金财富证券、国盛证券、浙商证券、广发证券、招商证券、民生证券等国内知名券商研究所，每日为公司提供研究报告，定期上门路演和推介，可及时获取多家券商的研究支持。		

交易管理系统

系统名称	上线时间	评估结果
恒生交易管理系统O3.2版	2016-12-02	符合规定
主要功能		
公司目前配置了恒生交易管理系统O3.2版，系统包括授权管理、合规控制、组合管理、指令管理、交易执行、清算、阈值警示、禁投监控、信息查询等模块，支持交易所、银行间交易等各种交易。系统功能完善，运行稳定，满足交易需求。		

资产估值和核算系统

系统名称	上线时间	评估结果
恒生估值系统	2014-11-26	符合规定
主要功能		

恒生估值系统可实现资产估值、财务核算与报表管理等功能，具备安全高效的清算交割及财务核算功能。该系统能够每日自动对各种投资组合提供完整、准确的资产估值，并对所有证券交易业务进行清算交割、财务核算及会计账务处理，并建立有会计账务处理数据与总账系统的接口；系统还可提供自定义报表平台，满足公司各种报表需求。

六、风险控制体系

整体评估情况	
公司根据银保监会规定、投资资产规模、业务性质和复杂程度，在明确风险偏好的基础上，建立了风险监控与评估体系，实行独立于投资管理的报告制度。依照全面性、审慎性、有效性、适时性、定性和定量分析相结合的原则，在满足防火墙要求的前提下，公司建立了一系列股票投资风险控制制度，风险控制体系建设符合相关法规要求。	
风险管理制度	公司制定了《亚太财产保险有限公司股票投资风险管理细则》、《亚太财产保险有限公司偿付能力压力测试管理办法》、《亚太财产保险有限公司市场风险管理办法》、《亚太财产保险有限公司合规管理制度》、《亚太财产保险有限公司股票投资业绩考评管理办法》、《亚太财产保险有限公司集中度风险管理办法》等制度，明确规定了风险管理的原则和具体措施，明确风险计量、风险点与股票研究、投资决策、交易及事后风险控制手段，针对股票投资特征及相关监管要求，设定了相应的风险指标及阈值监测体系，定了定期计量相关风险并进行有针对性的业务调整，建立了责任追究机制和绩效评估办法，风险管理制度建设符合相关规定。
风险管理系统	公司利用恒生交易系统 and 风险管理系统开展股票投资风险管理，其中：通过交易系统的风险控制阈值管理模块，实现操作层面的合规管理；通过风险管理系统，公司可以按照资产类别、行业、个股等维度进行风险分析和预警，能够对分帐户、分组合、分产品等各维度资产进行金融模型分析和绩效评估，风险管理系统符合相关法规要求。
压力测试系统	公司的风险与绩效管理系统配置了股票投资压力测试模块，该系统可设置相关风险指标，从公司股票仓位、行业集中度、个股集中度等维度，分别进行压力测试，评估对现有投资组合产生的影响，预测在极端假设条件下的股票资产波动情况。通过股票投资压力测试模块，公司可以多维度评估股票投资风险，并以此制定相应的应急预案，压力测试系统符合相关规定。

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。