

利安人寿保险股份有限公司股票投资管理能力建设及 自评估情况 (年度披露-【20240129】)

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	傅杰	总裁	行政责任人信息披露.pdf
专业责任人	季蕾	投资管理部总经理	专业责任人信息披露.pdf

二、组织架构

整体评估情况
<p>公司已建立由董事会负最终责任和首要责任，总裁室直接领导，投资管理部、风险管理部、法律合规部、运营管理部、资产管理部、风险控制部、稽核部、内部审计部、监察部、人力资源部、信息技术部等部门，各司其职，相互制衡。投资管理部是公司的核心部门，负责制定和执行投资策略，进行资产管理和风险控制。风险管理部负责识别、评估和监控公司的投资风险，确保公司资产的安全。法律合规部负责确保公司的经营活动符合相关法律法规的要求。运营管理部负责公司的日常运营和流程优化。资产管理部负责公司的资产管理和投资组合的构建。风险控制部负责公司的风险控制体系的建设和实施。稽核部负责公司的内部稽核和风险控制。内部审计部负责公司的内部审计和风险控制。监察部负责公司的廉洁从业和风险控制。人力资源部负责公司的人力资源管理和风险控制。信息技术部负责公司的信息技术支持和风险控制。各部门之间分工明确，协同合作，共同推进公司各项业务的发展。目前我公司在股票投资业务方面已经建立了较为完善的组织架构和岗位设置，能够满足业务发展的需要。2023年8月3日，根据《关于设立利安人寿股票投资团队的通知》和《关于利安人寿股票投资团队新增岗位的通知》，设立了股票投资团队，包括股票投资部（团队）和股票交易部。股票投资部（团队）主要负责股票投资的研究、决策和执行。股票交易部主要负责股票交易的执行和风险控制。两个部门的人员配置如下：股票投资部（团队）共配备6名股票投资人员，其中1名为投资经理，5名为股票研究员；股票交易部共配备6名股票交易人员，其中1名为清算人员，1名为风控人员，4名为股票交易人员。两个部门均配备了独立的办公场所，并严格执行门禁和监控系统，确保业务的安全和保密。此外，公司还建立了完善的风险管理制度，包括风险识别、评估、监控和报告等各个环节，确保公司整体风险处于可控范围内。通过不断优化组织架构和岗位设置，提升团队的专业能力和执行力，为公司实现可持续发展提供有力保障。</p>

资产管理部门设置

部门名称	投资管理部
发文时间	2023-08-03
发文文号	利保发〔2023〕485号、利保发〔2023〕497号
文件名称	《关于设立利安人寿股票投资团队的通知》、《关于利安人寿股票投资团队新增岗位的通知》
股票投资部门（团队）	岗位设置包括权益投资处负责人、股票投资岗、宏观策略研究岗、行业及个股研究员、股票交易岗、清算交割岗、投资风控岗、投资核算岗、投资系统运维岗等
投资经理	共配备股票投资人员6名，并根据账户、组合性质、管理资金规模等，配备了独立的股票投资经理

	投资场所	公司具备独立的办公场所，拥有足够的股票投资场所，设立符合要求的集中交易室，设置门禁与监控，与其他办公区域完全隔离
	防火墙机制	公司组织架构和岗位职责明确，各项综合管理过程中均明确体现了各类投资相关人员的防火墙安排，涉及股票投资经理与基金经理、投资经理与交易人员、投资管理人员与风控、绩效评估人员、清算人员之间等。

三、专业队伍

整体评估情况

公司已建立专业的股票投资团队，现有15名专业人员，包括6名股票投资经理，5名股票研究人员（其中主要研究人员2名）。2名交易人员，1名清算人员，1名风控人员。人员资质满足监管及日常业务要求。公司建立了有效隔离机制，对股票投资经理与基金投资经理，投资经理与交易人员，投资管理人员与风控、绩效评估人员、清算人员与核算人员严格隔离。

股票投资规模	超过10亿元
--------	--------

专业队伍人员基本信息

3-1、投资经理5名，研究人员6名（主要研究人员2名）

序号	姓名	岗位	相关经验类型	经验年限(年)	是否兼职
1	季蕾	股票投资岗	金融证券从业经历	18	是
2	胡瑜辉	股票投资岗	金融证券投资从业经验	8	否
3	张延民	股票投资岗	金融证券投资从业经验	9	否
4	田成凯	股票投资岗	股票投资管理经验	4	否
5	倪维材	行业及个股研究员	行业研究	6	否
6	朱思琪	行业及个股研究员	行业研究	6	否
7	魏丰泽	行业及个股研究员	行业研究	3	否
8	夏后光	行业及个股研究员	行业研究	0	否
9	汪凌霄	行业及个股研究员	行业研究	0	否
10	孙周	股票投资岗	金融证券投资从业经验	8	否
11	张亮	股票投资岗	金融证券投资从业经验	10	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	周健菁	股票交易岗	否

2	陈兆奇	股票交易岗	否
3	王忆江	投资风控岗	否
4	刘阳	清算交割岗	否

四、投资制度

整体评估情况

利安人寿保险股份有限公司投资制度体系建设符合股票投资管理能力的各项要求。制度体系涵盖了股票投资的各项内容。建立了清晰明确的股票投资岗位职责、权责明确、具备较强的可操作性。建立了系统化的研究管理支撑股票投资工作开展。交易管理和交易监控进行了明确规定，可确保交易的公平、合规、有序开展。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并正式实施。

基本制度

股票投资岗位职责

制度明细一

文件名称	《利安人寿资金运用管理办法》
发文文号	利保发〔2018〕338号
发文时间	2018-08-01
评估结果	符合规定

制度明细二

文件名称	《关于调整投资管理部组织架构与职责的通知》
发文文号	利保发〔2023〕476号
发文时间	2023-07-26
评估结果	符合规定

制度明细三

文件名称	《利安人寿股票投资管理办法（试行）》
发文文号	利保发〔2023〕465号
发文时间	2023-07-25
评估结果	符合规定

业务流程

制度明细一

文件名称	《利安人寿投资决策授权管理办法（2023年修订）》
发文文号	利保发〔2023〕692号
发文时间	2023-12-07
评估结果	符合规定

制度明细二

文件名称	《利安人寿上市权益类资产投资业务流程》
发文文号	利保发〔2019〕341号
发文时间	2019-07-02
评估结果	符合规定

制度明细三

文件名称	《利安人寿股票投资管理办法（试行）》
发文文号	保发〔2023〕465号
发文时间	2023-07-25
评估结果	符合规定
操作规程	
制度明细一	
文件名称	《利安人寿股票投资管理办法（试行）》
发文文号	利保发〔2023〕465号
发文时间	2023-07-25
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	《利安人寿交易管理暂行办法》
发文文号	利保发〔2014〕81号
发文时间	2014-04-03
评估结果	符合规定
制度明细三	
文件名称	《利安人寿公平交易管理细则》
发文文号	利保发〔2023〕464号
发文时间	2023-07-25
评估结果	符合规定
制度明细四	
文件名称	《投资管理部交易室管理规定（试行）》
发文文号	利保发〔2019〕623号
发文时间	2019-12-06
评估结果	符合规定
会议制度	
制度明细一	
文件名称	《利安人寿投资管理委员会工作规则》
发文文号	利保发〔2018〕263号
发文时间	2018-07-06
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	《利安人寿股票投资管理办法（试行）》
发文文号	利保发〔2023〕465号
发文时间	2023-07-25
评估结果	符合规定
文档管理	
制度明细一	
文件名称	《利安人寿保险股份有限公司档案管理办法》
发文文号	利保发〔2012〕39号
发文时间	2012-03-02
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	《利安人寿交易管理暂行办法》
发文文号	利保发〔2014〕81号

发文时间	2014-04-03
评估结果	符合规定
制度明细三	
文件名称	《利安人寿股票投资管理办法（试行）》
发文文号	利保发〔2023〕465号
发文时间	2023-07-25
评估结果	符合规定
绩效考核	
制度明细	
文件名称	《利安人寿投资考核管理办法（2023版）》
发文文号	利保发〔2023〕488号
发文时间	2023-07-28
评估结果	符合规定
清算与核算	
制度明细一	
文件名称	《利安人寿保险股份有限公司会计核算制度（2020年修订版）》
发文文号	利保发〔2021〕122号
发文时间	2021-01-29
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	《利安人寿保险股份有限公司投资交易资金结算管理办法》
发文文号	利保发〔2018〕340号
发文时间	2018-07-27
评估结果	符合规定
信息系统管理	
制度明细	
文件名称	《利安人寿投资交易系统安全管理及危机处理细则》
发文文号	利保发〔2023〕462号
发文时间	2023-07-26
评估结果	符合规定
保密及危机处理	
制度明细一	
文件名称	《利安人寿保险股份有限公司保密管理办法（试行）》
发文文号	利保发〔2023〕161号
发文时间	2023-03-10
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	《利安人寿权益价格风险突发事件应急预案》
发文文号	利保发〔2021〕114号
发文时间	2021-02-04
评估结果	符合规定
制度明细三	
文件名称	《利安人寿股票投资管理办法（试行）》

发文文号	利保发〔2023〕465号
发文时间	2023-07-25
评估结果	符合规定
制度明细四	
文件名称	《利安人寿投资交易系统安全管理及危机处理细则》
发文文号	利保发〔2023〕462号
发文时间	2023-07-26
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	《利安人寿资金运用管理办法》
发文文号	利保发〔2018〕338号
发文时间	2018-08-01
评估结果	符合规定
授权管理	
制度明细	
文件名称	《利安人寿投资决策授权管理办法（2023年修订）》
发文文号	利保发〔2023〕692号
发文时间	2023-12-07
评估结果	符合规定
实施与控制	
制度明细	
文件名称	《利安人寿股票投资管理办法（试行）》
发文文号	利保发〔2023〕465号
发文时间	2023-07-25
评估结果	符合规定

研究管理制度	
研究管理办法	
制度明细一	
文件名称	《利安人寿投资研究管理办法》
发文文号	利保发〔2014〕54号
发文时间	2014-04-03
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	《利安人寿股票投资管理办法（试行）》
发文文号	利保发〔2023〕465号
发文时间	2023-07-25
评估结果	符合规定
股票池管理办法	
制度明细	
文件名称	《利安人寿股票投资管理办法（试行）》
发文文号	利保发〔2023〕465号

发文时间	2023-07-25
评估结果	符合规定
交易单元管理办法	
制度明细	
文件名称	《利安人寿交易单元管理细则》
发文文号	利保发〔2023〕466号
发文时间	2023-07-25
评估结果	符合规定

交易管理制度	
集中交易	
制度明细	
文件名称	《利安人寿交易管理暂行办法》
发文文号	利保发〔2014〕81号
发文时间	2014-04-03
评估结果	符合规定
公平交易	
制度明细	
文件名称	《利安人寿公平交易管理细则》
发文文号	利保发〔2023〕464号
发文时间	2023-07-25
评估结果	符合规定
交易权限管理	
制度明细一	
文件名称	《利安人寿股票投资管理办法（试行）》
发文文号	利保发〔2023〕465号
发文时间	2023-07-25
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	《利安人寿交易管理暂行办法》
发文文号	利保发〔2014〕81号
发文时间	2014-04-03
评估结果	符合规定
交易监控	
制度明细	
文件名称	《投资管理部交易室管理规定（试行）》
发文文号	利保发〔2019〕623号
发文时间	2019-12-06
评估结果	符合规定

五、系统建设

整体评估情况

我公司股票投资管理相关信息系统建设、功能和使用及运行情况符合标准规定，研究报告系统强化了投资的合理性；我公司配备了万得Wind金融数据终端和同花顺iFinD金融数据系统终端两种信息资讯系统，且能够获得东吴证券、海通证券、民生证券、中泰证券等券商的服务支持。信息资讯系统完备，研究服务支持较为充分，可保证广泛的投资信息来源；交易管理系统及资产估值和核算系统功能完备，可有效保证投资的执行和监控；相关系统运行正常，为投资业务的正常运行提供了有力支持，符合《保险机构股票投资管理能力标准》的相关要求。

研究分析系统		
系统名称	上线时间	评估结果
万得Wind金融数据分析终端	2011-11-29	符合规定
同花顺iFinD金融数据系统终端	2020-09-29	符合规定
基煜资产配置模型	2023-06-25	符合规定
基煜行业轮动模型	2023-06-26	符合规定
主要功能		
<p>万得Wind金融数据分析终端可提供行业配置模型、个股估值模型、内部研究报告系统和报告平台等，从宏观研究、行业研究、公司研究等各维度出发，为研究员和投资经理提供研究管理工具和内外部研报信息，满足日常研究分析需要。公司自建相关模型亦可通过接口调用相关数据。同花顺iFinD金融数据系统终端可提供全方位研究资讯，包括实时level-2行情、港股与期货行情、公司资料与财务数据、研究报告平台、新闻舆情等。建立覆盖数据管理、资产观点、组合方法、策略回测及绩效验证五大模块的大类资产配置工具，在均值-方差、B-L模型等理论上，实现满足目标收益、目标波动、回撤控制等各种投资目标的资产配置方案。建立行业轮动模型策略，以微观视角的预期面、资金面、基本面、技术面四个维度来刻画行业轮动。同时，兼顾宏观与中观视角，形成自下而上行业评分模型作为行业配置的决策量化支持工具。</p>		

信息资讯系统		
系统名称	上线时间	评估结果
万得Wind金融数据分析终端	2011-11-29	符合规定
同花顺iFinD金融数据系统终端	2020-09-29	符合规定
主要功能		
<p>万得Wind金融数据分析终端可提供行业配置模型、个股估值模型、内部研究报告系统和报告平台等，从宏观研究、行业研究、公司研究等各维度出发，为研究员和投资经理提供研究管理工具和内外部研报信息，满足日常研究分析需要。公司自建相关模型亦可通过接口调用相关数据。同花顺iFinD金融数据系统终端可提供全方位研究资讯，包括实时level-2行情、港股与期货行情、公司资料与财务数据、研究报告平台、新闻舆情等。</p>		

交易管理系统		
系统名称	上线时间	评估结果
恒生O3.2投资交易系统	2014-03-01	符合规定
主要功能		

公司采用恒生投资管理系统O3.2进行投资交易管理，该系统能够提供交易指令下达、指令分发、指令审批、审批权限控制、合规风险控制、证券池管理、交易对手管理、日终清算、资金管理等功能，使投资交易高效、安全、合规开展，满足股票投资需求。该系统符合《保险机构股票投资管理标准》的相关要求。

资产估值和核算系统		
系统名称	上线时间	评估结果
恒生资产估值与会计核算系统	2014-03-01	符合规定
主要功能		
公司采用恒生资产估值与会计核算系统进行投资资产估值和核算，该系统能够每日进行清算，由清算结果自动生成财务凭证，最后生成各种报表完成最后资产的估值，系统功能包括生成凭证、估值表、手工填制凭证、凭证审核、凭证记账、财务结账、会计科目、余额表等，保证投资信息的及时更新和汇总，满足公司股票投资估值、核算等相关需求。该系统符合《保险机构股票投资管理标准》的相关要求。		

六、风险控制体系

整体评估情况	
公司设置顺序递进的三道监控防线，建立了覆盖事前控制、事中监督、事后评价的风险控制体系，实行独立于投资管理的报告制度，公司相关制度已涵盖风险管理原则、风险识别、评估与计量、风险的应对与控制、责任追究机制及绩效评估等方面内容。	
风险管理制度	公司制订了《利安人寿资金运用管理办法》（利保发〔2018〕338号）、《利安人寿资金运用反舞弊制度》（利保发〔2016〕503号）、《利安人寿员工违法违规违纪行为处罚暂行办法》（利保发〔2019〕306号）、《利安人寿市场风险管理制度（2023修订）》（利保发〔2023〕249号）、《利安人寿权益价格风险突发事件应急预案》（利保发〔2021〕114号）、《利安人寿股票投资管理办法（试行）》（利保发〔2023〕465号）、《利安人寿投资考核管理办法〔2023版〕》（利保发〔2023〕488号）、《利安人寿风险限额管理办法》（利保发〔2023〕135号）等相关制度，设置顺序递进的三道监控防线，建立了覆盖事前控制、事中监督、事后评价的风险控制体系。综上，公司已建立了股票投资风险管理制度，涵盖风险管理原则、风险识别、评估与计量、风险的应对与控制、责任追究机制及绩效评估等方面内容，符合《保险机构股票投资管理标准》中关于风险管理制度相关要求。
风险管理系统	公司已搭建并使用恒生O3.2投资交易系统、恒生绩效评估与风险管理3.0系统，符合《保险机构股票投资管理标准》中关于风险管理系统的相关要求。 1) 公司使用恒生O3.2投资交易系统，根据监管要求和公司内控需要，事前在系统中设置相关投资风控指标和阈值，事中通过系统监控逐笔监控投资指令，实现事前和事中的合规管理和风险管控；2) 公司使用恒生绩效评估与风险管理3.0系统，通过系统中的组合查询、组合绩效分析、风险指标测算等功能，实现事后风险预警和绩效评估等功能。

压力测试系统	<p> 我公司采购了恒生绩效评估与风险管理3.0系统，该系统情景分析功能可对组合的行业集中度、个股集中度、股票仓位进行压力测试，评估投资组合产生的影响。我公司可根据系统的压力测试结果制定相应的应急预案。我公司压力测试系统符合《保险机构股票投资管理标准》规定。 </p>
--------	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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。