

# 中意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-20230130）

## 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：	贡磊	职务：	公司总经理
行政责任人类型：	授权总经理	是否履行完备的授权程序：	是
行政责任人性别	男	行政责任人出生年月	1973-03
行政责任人学历	研究生	行政责任人学位	硕士
行政责任人所在部门	管理层	行政责任人入司时间	2013-12-02
行政责任人专业资质	具备相关领域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：	周陆	职务：	权益投资部总经理
专业责任人类型：	授权的相关资产管理部門负责人	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	1980-06
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	2013-08-01	专业责任人所在部门	权益投资部
专业责任人专业资质	具备相关领域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>公司建立了职责明确、分工合理的股票投资组织架构，由董事会授权经营管理层开展股票投资业务，由经营管理层下设的投资管理委员会负责股票投资业务的具体开展，并按照分级管理、明确授权、规范操作、严格监管的原则形成了规范的投资决策体系。公司下发制度明确了股票投资相关部门（包括投资管理部、委员会、权益投资部、交易部、运营管理部、风险管理部和组合管理部）的职责分工，设立了权益投资部作为独立的股票投资部门，设立了交易部作为独立的集中交易部门。公司下发了《关于中意资产管理有限责任公司设立股票投资部门的通知》《关于中意资产管理有限责任公司组织架构调整的通知》设立股票投资部门，并在发文中明确了股票投资部门职责、岗位职责、部门负责人及人员配置情况等。公司设置了股票投资的研究、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，并在研究、投资、交易岗位实行专人专岗，与其他投资业务严格分离。公司根据账户/组合性质和管理资金规模，配备独立的股票投资经理。股票投资经理与基金投资经理、投资经理与交易人员、投资管理人员与风险控制和绩效评估人员、清算人员与核算人员均无同一人员兼职情况并建立了防火墙机制，确保岗位、账户及股票投资各项工作的独立性和客观性。公司拥有足够的股票投资场所并与集中交易办公区域完全隔离。</p>			
股票投资部门：			
1			
部门名称	交易部		
发文时间	2021-01-20	文件名称（含文号）	《关于中意资产管理有限责任公司设立股票投资部门的通知》（中意资管[2021]人力11号）
岗位设置：	交易,交易负责人		
2			
部门名称	信息科技部		
发文时间	2021-01-20	文件名称（含文号）	《关于中意资产管理有限责任公司设立股票投资部门的通知》（中意资管[2021]人力11号）
岗位设置：	系统支持		
3			

部门名称	权益投资部		
发文时间	2021-01-20	文件名称 (含文号)	《关于中意资产管理有限责任公司设立股票投资部门的通知》(中意资管[2021]人力11号)
岗位设置:	基金投资经理, 研究, 股票投资经理, 股票投资负责人		
4			
部门名称	组合管理部		
发文时间	2021-01-20	文件名称 (含文号)	《关于中意资产管理有限责任公司设立股票投资部门的通知》(中意资管[2021]人力11号)
岗位设置:	绩效评估		
5			
部门名称	运营管理部		
发文时间	2021-01-20	文件名称 (含文号)	《关于中意资产管理有限责任公司设立股票投资部门的通知》(中意资管[2021]人力11号)
岗位设置:	核算, 清算		
6			
部门名称	风险管理部		
发文时间	2022-05-27	文件名称 (含文号)	《关于中意资产管理有限责任公司组织架构调整的通知》(中意资管[2022]人力60号)
岗位设置:	风险控制		
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:	公司设置了股票投资的研究、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, 并在研究、投资、交易岗位实行专人专岗, 与其他投资业务严格分离。公司根据账户/组合性质和管理资金规模, 配备独立的股票投资经理。股票投资经理与基金投资经理、投资经理与交易人员、投资管理人员与风险控制和绩效评估人员、清算人员与核算人员均无同一人员兼职情况并建立了防火墙机制, 确保岗位、账户及股票投资各项工作的独立性和客观性。		
评估结果:	符合规定		
投资场所:	公司拥有足够的股票投资场所并与集中交易办公区域完全隔离。		
评估结果:	符合规定		

### 三、专业队伍

整体评估情况:  
 公司股票投资管理专业队伍建设符合《保险机构股票投资管理标准》规定。公司股票投资规模超过10亿元, 拥有专职人员14人, 其中投资经理3人, 研究人员6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。另外公司拥有股票投资核算人员1人, 绩效评估人员1人, 系统支持人员1人。公司股票投资负责人具有5年以上股票投资管理经验, 投资经理具有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, 达到监管要求。

#### 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	周陆	股票投资负责人	是	股票投资管理经验	14.47
2	陈愉	交易	是	金融证券投资从业经验	8.00
3	陈清爽	交易	是	金融证券投资从业经验	9.42
4	李政	交易负责人	是	金融证券投资从业经验	8.86
5	李雪青	系统支持	否	其他	8.39
6	范启航	研究	是	行业研究经验	0.51
7	胡祖嘉	研究	是	行业研究经验	1.46

8	胡冬青	研究	是	行业研究经验	9.42
9	谷风	研究	是	行业研究经验	11.49
10	臧怡	研究	是	行业研究经验	9.42
11	沈悦明	研究	是	行业研究经验	6.61
12	翟琳琳	股票投资经理	是	股票投资管理经验	17.39
13	陈东	股票投资经理	是	股票投资管理经验	9.42
14	李香蓉	绩效评估	否	其他	2.46
15	杨啸	核算	否	其他	5.50
16	赵爽	清算	是	其他	4.74
17	李少亨	风险控制	是	其他	5.36

#### 四. 投资制度

整体评估情况：		
<p>公司按照《保险机构股票投资管理能力标准》相关要求，建立了完善、有效的股票投资管理制度，相关制度均经董事会、经营管理层或其授权机构批准且均已正式发文。其中，股票投资基本制度包括但不限于股票投资岗位职责、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；决策管理制度包括但不限于投资决策体系、授权管理、实施与控制等内容；研究管理制度包括但不限于投资策略、行业和公司研究、投资报告制度、调研管理制度等内容；股票池管理办法包括但不限于股票池产生、调整与维护、对投资决策的实质影响以及对投资操作的制约作用等内容；交易单元管理办法包括但不限于选择标准、研究服务质量评价等内容；股票交易管理制度包括但不限于集中交易、公平交易、交易权限管理和交易监控等内容。</p>		
股票投资基本制度：		
制度内容	评估结果	制度明细
操作规程	符合规定	文件名称：中意资产管理有限责任公司股票投资总则， 发文文号：中意资管【2022】权益17号， 发文时间：2022-01-25；
信息系统管理	符合规定	文件名称：中意资产管理有限责任公司股票投资总则， 发文文号：中意资管【2022】权益17号， 发文时间：2022-01-25；
会议制度	符合规定	文件名称：中意资产管理有限责任公司股票投资总则， 发文文号：中意资管【2022】权益17号， 发文时间：2022-01-25； 文件名称：中意资产管理有限责任公司投研交流制度， 发文文号：中意资管【2013】10号， 发文时间：2013-02-27；
股票投资岗位职责	符合规定	文件名称：中意资产管理有限责任公司股票投资总则， 发文文号：中意资管【2022】权益17号， 发文时间：2022-01-25；
业务流程	符合规定	文件名称：中意资产管理有限责任公司股票投资总则， 发文文号：中意资管【2022】权益17号， 发文时间：2022-01-25；
清算与核算	符合规定	文件名称：中意资产管理有限责任公司股票投资总则， 发文文号：中意资管【2022】权益17号， 发文时间：2022-01-25；
文档管理	符合规定	文件名称：中意资产管理有限责任公司股票投资总则， 发文文号：中意资管【2022】权益17号， 发文时间：2022-01-25；
保密及危机处理	符合规定	文件名称：中意资产管理有限责任公司股票投资总则， 发文文号：中意资管【2022】权益17号， 发文时间：2022-01-25； 文件名称：中意资产管理有限责任公司股票投资重大突发事件专项应急预案， 发文文号：中意资管【2019】权益29号， 发文时间：2019-08-22；
绩效考核	符合规定	文件名称：中意资产管理有限责任公司股票投资总则， 发文文号：中意资管【2022】权益17号， 发文时间：2022-01-25； 文件名称：中意资产管理有限责任公司投资经理选聘及考核管理办法， 发文文号：中意资管【2015】人力6号， 发文时间：2015-03-19；

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: 中意资产管理有限责任公司投资管理办法, 发文文号: 中意资管【2018】权益35号, 发文时间: 2018-11-23; 文件名称: 中意资产管理有限责任公司投资管理委员会议事规则, 发文文号: 中意资管【2022】风险管理部84号, 发文时间: 2022-10-12;
实施与控制	符合规定	文件名称: 中意资产管理有限责任公司投资管理办法, 发文文号: 中意资管【2018】权益35号, 发文时间: 2018-11-23;
授权管理	符合规定	文件名称: 中意资产管理有限责任公司董事会授权管理办法, 发文文号: 中意资管【2021】综合6号, 发文时间: 2021-01-20; 文件名称: 中意资产管理有限责任公司投资管理办法, 发文文号: 中意资管【2018】权益35号, 发文时间: 2018-11-23; 文件名称: 中意资产管理有限责任公司投资管理委员会议事规则, 发文文号: 中意资管【2022】风险管理部84号, 发文时间: 2022-10-12;
研究管理制度:		
制度内容	评估结果	制度明细
股票池管理办法	符合规定	文件名称: 中意资产管理有限责任公司股票池管理办法, 发文文号: 中意资管【2022】权益16号, 发文时间: 2022-01-25;
交易单元管理办法	符合规定	文件名称: 中意资产管理有限责任公司服务券商选定管理办法, 发文文号: 中意资管【2020】交易20号, 发文时间: 2020-04-21;
研究管理办法	符合规定	文件名称: 中意资产管理有限责任公司股票研究管理制度, 发文文号: 中意资管【2021】权益15号, 发文时间: 2021-01-22;
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: 中意资产管理有限责任公司投资交易管理办法, 发文文号: 中意资产【2022】交易82号, 发文时间: 2022-09-20;
公平交易	符合规定	文件名称: 中意资产管理有限责任公司公平交易制度, 发文文号: 中意资产【2022】交易82号, 发文时间: 2022-09-20;
交易监控	符合规定	文件名称: 中意资产管理有限责任公司投资交易管理办法, 发文文号: 中意资产【2022】交易82号, 发文时间: 2022-09-20;
交易权限管理	符合规定	文件名称: 中意资产管理有限责任公司投资交易管理办法, 发文文号: 中意资产【2022】交易82号, 发文时间: 2022-09-20;

## 五. 系统建设

整体评估情况:	
公司在研究分析、信息资讯、交易管理、资产估值和核算等方面都进行了系统化建设。投资交易系统方面, 采购了恒生公司研发的投资管理03.2系统; 研究分析系统采取内部开发模式, 形成了以资产配置、行业配置为模型的投资分析系统; 集成了包括万得、彭博、启明星、Qeubee终端、聚源等多套资讯系统, 并集成了多家主流券商的研究服务; 恒生公司的资产估值与会计核算V2.6系统配备了相应的投资估值与清算模块, 账务记账、清算逻辑遵循相应的会计准则。相关系统均通过了可靠性测试。投资管理交易系统建设情况符合监管要求。	
交易管理系统:	

系统名称	投资管理系统03.2		
上线时间	2013-05-31	评估结果	符合规定
主要功能	授权管理：投资管理系统03.2有严格的权限管理，不同角色的人员只具备各自角色下所拥有的权限，增删权限都需要经过系统审批。 合规管理：产品正式交易前，会有专业的风控人员进行相关合规设置。 交易功能：交易功能模块完整，能顺利进行场内交易，以及银行间等交易指令留痕。		
信息资讯系统：			
系统名称	万得、彭博、启明星、Qeubee终端、聚源等		
上线时间	2013-05-31	评估结果	符合规定
主要功能	集成了包括万得、彭博、启明星、Qeubee终端、聚源等多套资讯系统，同时集成了多家主流券商的研究服务。		
研究分析系统：			
系统名称	内部研报系统 + 投研团队自主开发配置和估值模型等		
上线时间	2013-06-30	评估结果	符合规定
主要功能	研究分析系统主要采取内部开发的形式，包括： 资产配置模型：模型能够结合投资目标、负债现金流状况、风险约束、市场预期等多方面因素，生成配置建议。 行业配置模型：能够从行业景气度和行业动量等多方面因素进行行业轮动。 个股估值模型：会根据行业和公司特点搭建对个股进行估值，包含常见的估值模型，如DCF、DDM，P/B、P/E和P/S等。 内部研究报告系统：研究员能够在系统中撰写相关研报并存档，推荐的股票能够计入模拟组合，其业绩能够被有效跟踪。		
资产估值和核算系统：			
系统名称	资产估值与会计核算系统		
上线时间	2013-05-31	评估结果	符合规定
主要功能	估值与清算的数据采用内网管理模式，保证数据安全。每日有专业的运营人员进行清算交割和财务核算，完成账套清算和估值并生成相应的估值表。		

## 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，实行独立于投资管理的报告制度。风险管理制度包括风险管理原则、风险计量、风险点与控制手段、责任追究机制及绩效评估等。风险管理系统包括风险预警与合规管理系统、绩效评估系统等。压力测试系统对股票仓位、行业集中度、个股集中度进行压力测试，评估投资组合产生的影响，并以此制定相应的应急预案。			
评估结果	符合规定		
风险管理制度：			
制度名称	《中意资产管理有限责任公司风险管理办法》《中意资产管理有限责任公司投资经理选聘及考核管理办法》《中意资产管理有限责任公司员工违规处罚及责任追究管理办法》		
评估情况	中意资产在《中意资产管理有限责任公司风险管理办法》中明确了风险管理的原则，即全面性原则、有效性原则、独立性原则、成本效益原则、审慎性原则、责任追究原则；风险点的分类和识别、各类风险的计量和管理方式、风险的控制手段等，在《中意资产管理有限责任公司投资经理选聘及考核管理办法》中明确了相关人员的绩效评估和考核情况，在《中意资产管理有限责任公司员工违规处罚及责任追究管理办法》中明确了责任追究机制，符合《保险机构股票投资管理能力的标准》的相关要求。		
评估结果	符合规定		
压力测试系统：			
系统名称	恒生风险管理3.0、FDA系统		
上线时间	2013-06-30	评估结果	符合规定
主要功能	中意资产采购了市场上较为成熟的恒生风险管理3.0，同时自主研发了FDA系统，可在系统内实现对股票仓位、行业集中度、个股集中度等的压力测试，评估投资组合产生的影响，并制定相应的应急预案，符合《保险机构股票投资管理能力的标准》相关要求。		
风险管理系统：			
系统名称	恒生投资管理系统03.2 FDA系统		
上线时间	2013-06-30	评估结果	符合规定

主要功能

中意资产采购市场上较为成熟的恒生投资管理系统03.2，同时自主研发了FDA系统，囊括了风险预警与合规管理系统、绩效评估系统等，符合《保险机构股票投资管理标准》相关要求。

## 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。