

# 华夏久盈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-20220124）

## 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：    | 王晓辉             | 职务：          | 华夏人寿保险股份有限公司托管组副组长 |
| 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    | 1976-12            |
| 行政责任人学历   | 硕士研究生           | 行政责任人学位      | 硕士                 |
| 行政责任人所在部门 | 托管组             | 行政责任人入司时间    | 2022-01-10         |
| 行政责任人专业资质 | 无               | 行政责任人专业技术职务  | 无                  |
| 专业责任人：    | 陈淑翠             | 职务：          | 公司总经理助理            |
| 专业责任人类别：  | 高级管理人员          | 是否履行完备的授权程序： |                    |
| 专业责任人性别   | 女               | 专业责任人出生年月    | 1974-05            |
| 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 | 2017-06-21      | 专业责任人所在部门    | 总经理室               |
| 专业责任人专业资质 | 具备相关投资领域10年以上经验 | 专业责任人专业技术职务  | 无                  |

## 二、组织架构

整体评估情况：

权益投资中心是公司股票投资管理的主要职能部门。权益投资中心下设三个二级部门，分别为：权益投资一部、权益投资二部和研究部。权益投资一部、权益投资二部具体负责股票的投资工作，研究部负责相关研究工作。权益投资中心共有22人，其中投资序列11人，研究序列11人。除权益投资中心外，公司设有集中交易部、合规法律部、风险管理部、运营保障部、财务管理部、信息技术部等部门，分别负责集中交易、风险控制与管理、绩效评估、清算与核算、系统支持等工作。公司根据账户/组合性质、管理资金规模等，配备独立的股票投资经理；公司研究、投资、交易岗位实行专人专岗，与其他投资业务严格分离；公司股票投资人员与其他投资业务，交易、风控、绩效评估人员之间设有防火墙机制，职责和岗位相互独立，公司清算人员与核算人员之间职责和岗位相互独立；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。

股票投资部门：

1

|       |            |           |                          |
|-------|------------|-----------|--------------------------|
| 部门名称  | 信息技术部      |           |                          |
| 发文时间  | 2015-07-06 | 文件名称（含文号） | 关于部门设置的通知（华夏久盈发【2015】7号） |
| 岗位设置： | 应用系统运维岗    |           |                          |

2

|       |            |           |                                     |
|-------|------------|-----------|-------------------------------------|
| 部门名称  | 合规法律部      |           |                                     |
| 发文时间  | 2017-11-16 | 文件名称（含文号） | 关于公司组织架构调整及人事任免的通知（华夏久盈发【2017】207号） |
| 岗位设置： | 合规管理岗      |           |                                     |

3

|       |                               |           |                                           |
|-------|-------------------------------|-----------|-------------------------------------------|
| 部门名称  | 权益投资中心                        |           |                                           |
| 发文时间  | 2021-01-06                    | 文件名称（含文号） | 关于明确公司股票投资管理部门组织架构和负责人员的通知（华夏久盈发【2021】6号） |
| 岗位设置： | 投资支持岗,策略研究岗,股票投资岗,行业研究岗,部门负责人 |           |                                           |

|        |                                                                                                        |           |                                     |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------|-------------------------------------|
| 4      |                                                                                                        |           |                                     |
| 部门名称   | 财务管理部                                                                                                  |           |                                     |
| 发文时间   | 2015-07-06                                                                                             | 文件名称（含文号） | 关于部门设置的通知（华夏久盈发【2015】7号）            |
| 岗位设置：  | 估值核算岗                                                                                                  |           |                                     |
| 5      |                                                                                                        |           |                                     |
| 部门名称   | 运营保障部                                                                                                  |           |                                     |
| 发文时间   | 2016-09-30                                                                                             | 文件名称（含文号） | 关于成立运营保障部及人事任免的通知（华夏久盈发【2016】132号）  |
| 岗位设置：  | 证券清算岗                                                                                                  |           |                                     |
| 6      |                                                                                                        |           |                                     |
| 部门名称   | 集中交易部                                                                                                  |           |                                     |
| 发文时间   | 2015-07-06                                                                                             | 文件名称（含文号） | 关于部门设置的通知（华夏久盈发【2015】7号）            |
| 岗位设置：  | 权益投资交易岗                                                                                                |           |                                     |
| 7      |                                                                                                        |           |                                     |
| 部门名称   | 风险管理部                                                                                                  |           |                                     |
| 发文时间   | 2017-11-16                                                                                             | 文件名称（含文号） | 关于公司组织架构调整及人事任免的通知（华夏久盈发【2017】207号） |
| 岗位设置：  | 绩效分析岗                                                                                                  |           |                                     |
| 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： | 公司按《保险机构股票投资管理能力标准》相关要求建立了防火墙，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绩效评估人员之间、清算人员与核算人员之间等均建有防火墙，严格独立。 |           |                                     |
| 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，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：                                                                                                                                                                                  |     |         |                |          |        |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|---------|----------------|----------|--------|
| 我公司股票投资规模超过10亿元，专职人员32人，其中股票投资经理11人，研究人员11人，其中主要研究人员10人，交易人员2人，风控人员1人，清算人员2人，核算人员2人，绩效评估人员1人，系统支持人员2人。其中股票投资负责人具有10年以上股票投资管理经验，投资经理、研究员均具有丰富的相关行业经验，投资经理具有3年以上股票投资管理经验，主要研究人员从事行业研究3年以上。 |     |         |                |          |        |
| 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                                                                                                                                                                                        | 李莎  | 应用系统运维岗 | 是              | 其他       | 4.75   |
| 2                                                                                                                                                                                        | 樊文浩 | 应用系统运维岗 | 是              | 其他       | 5.99   |
| 3                                                                                                                                                                                        | 管云龙 | 合规管理岗   | 是              | 其他       | 6.80   |
| 4                                                                                                                                                                                        | 于海申 | 投资支持    | 是              | 股票投资管理经验 | 4.58   |
| 5                                                                                                                                                                                        | 默佳鑫 | 投资支持    | 是              | 股票投资管理经验 | 5.49   |
| 6                                                                                                                                                                                        | 姜微  | 投资支持岗   | 是              | 股票投资管理经验 | 6.19   |
| 7                                                                                                                                                                                        | 李树培 | 策略研究    | 是              | 行业研究经验   | 6.53   |
| 8                                                                                                                                                                                        | 韩冰清 | 股票投资    | 是              | 股票投资管理经验 | 4.06   |
| 9                                                                                                                                                                                        | 孟德鹏 | 股票投资    | 是              | 股票投资管理经验 | 7.23   |
| 10                                                                                                                                                                                       | 张剑  | 股票投资    | 是              | 股票投资管理经验 | 4.81   |
| 11                                                                                                                                                                                       | 李晓杰 | 股票投资    | 是              | 股票投资管理经验 | 5.51   |
| 12                                                                                                                                                                                       | 肖桂东 | 股票投资    | 是              | 股票投资管理经验 | 20.19  |

|    |     |         |   |          |       |
|----|-----|---------|---|----------|-------|
| 13 | 郭文峰 | 股票投资    | 是 | 股票投资管理经验 | 4.05  |
| 14 | 桑永亮 | 股票投资    | 是 | 股票投资管理经验 | 6.42  |
| 15 | 刘强  | 股票投资    | 是 | 股票投资管理经验 | 4.84  |
| 16 | 陈淑翠 | 股票投资负责人 | 否 | 股票投资管理经验 | 12.75 |
| 17 | 翟晓虹 | 行业研究    | 是 | 行业研究经验   | 8.46  |
| 18 | 官永建 | 行业研究    | 是 | 行业研究经验   | 4.59  |
| 19 | 周武  | 行业研究    | 是 | 行业研究经验   | 7.34  |
| 20 | 赵佳  | 行业研究    | 是 | 行业研究经验   | 5.48  |
| 21 | 王德彬 | 行业研究    | 是 | 行业研究经验   | 7.44  |
| 22 | 谢达成 | 行业研究    | 是 | 行业研究经验   | 7.65  |
| 23 | 谢雯  | 行业研究    | 是 | 行业研究经验   | 1.50  |
| 24 | 黄礞  | 行业研究    | 是 | 行业研究经验   | 7.52  |
| 25 | 王祎佳 | 行业研究岗   | 是 | 行业研究经验   | 10.81 |
| 26 | 张伟光 | 行业研究岗   | 是 | 行业研究经验   | 10.75 |
| 27 | 杜洋  | 估值核算岗   | 是 | 其他       | 6.59  |
| 28 | 王阳  | 估值核算岗   | 是 | 其他       | 3.27  |
| 29 | 朱莹  | 证券清算岗   | 是 | 其他       | 3.75  |
| 30 | 刘馨远 | 证券清算岗   | 是 | 其他       | 6.97  |
| 31 | 赵雪君 | 权益投资交易岗 | 是 | 其他       | 6.64  |
| 32 | 吕一凡 | 权益投资交易岗 | 是 | 其他       | 3.35  |
| 33 | 陈伟  | 绩效分析岗   | 是 | 其他       | 5.55  |

#### 四. 投资制度

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |      |                                                                                                                                                                 |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 整体评估情况：                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |      |                                                                                                                                                                 |
| 公司已建立完善、有效的股票投资管理制度，包括但不限于股票投资基本制度、决策管理制度、研究管理制度、交易管理制度等制度。涵盖了投资决策、授权管理、实施与控制、投资研究、投资操作、岗位职责、业务流程、交易管理、会议制度、清算与核算、绩效考核、信息系统管理、文档管理、保密及危机处理等所有业务环节，相关制度均已正式发文。其中股票投资基本制度有：股票投资业务管理办法、非公开发行股票投资业务管理办法、新股申购业务管理细则、投资管理委员会管理细则、档案管理暂行办法、绩效考核实施细则、结算管理办法（修订）、会计核算办法、计算机信息系统运行管理规定、信息技术管理制度（修订）、保密信息管理办法、重大突发事件应急处理暂行办法（修订）。决策管理制度有：投资管理委员会议事规则、资金运用业务授权与审批管理暂行办法、标准类权益资产投资业务风险管理细则。研究管理制度有：股票投资研究管理办法、股票投资池管理办法、交易单元管理办法。交易管理制度有：集中交易管理办法、公平交易管理办法。 |      |                                                                                                                                                                 |
| 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：华夏久盈资产管理有限责任公司投资管理委员会管理细则，<br>发文文号：华夏久盈发〔2019〕30号，<br>发文时间：2019-01-24；                                                                                     |
| 保密及危机处理                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | 符合规定 | 文件名称：华夏久盈资产管理有限责任公司保密信息管理办法，<br>发文文号：华夏久盈发〔2015〕101号，<br>发文时间：2015-09-22；<br>文件名称：华夏久盈资产管理有限责任公司重大突发事件应急处理暂行办法（修订），<br>发文文号：华夏久盈发〔2017〕62号，<br>发文时间：2017-02-22； |
| 绩效考核                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 符合规定 | 文件名称：华夏久盈资产管理有限责任公司2019年度绩效考核实施细则，<br>发文文号：华夏久盈发〔2019〕183号，<br>发文时间：2019-11-19；                                                                                 |

|          |      |                                                                                                                                                               |
|----------|------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 文档管理     | 符合规定 | 文件名称：华夏久盈资产管理有限责任公司档案管理暂行办法，<br>发文文号：华夏久盈发（2016）22号，<br>发文时间：2016-03-16；                                                                                      |
| 业务流程     | 符合规定 | 文件名称：华夏久盈资产管理有限责任公司非公开发行股票投资业务管理办法，<br>发文文号：华夏久盈发（2020）110号，<br>发文时间：2020-07-07；                                                                              |
| 清算与核算    | 符合规定 | 文件名称：华夏久盈资产管理有限责任公司会计核算办法，<br>发文文号：华夏久盈发（2017）45号，<br>发文时间：2017-02-21；<br>文件名称：华夏久盈资产管理有限责任公司结算管理办法（修订），<br>发文文号：华夏久盈发（2017）178号，<br>发文时间：2017-08-29；         |
| 股票投资岗位职责 | 符合规定 | 文件名称：华夏久盈资产管理有限责任公司股票投资业务管理办法，<br>发文文号：华夏久盈发（2020）115号，<br>发文时间：2020-07-13；                                                                                   |
| 操作规程     | 符合规定 | 文件名称：华夏久盈资产管理有限责任公司新股申购业务管理细则，<br>发文文号：华夏久盈发（2020）124号，<br>发文时间：2020-07-29；                                                                                   |
| 信息系统管理   | 符合规定 | 文件名称：华夏久盈资产管理有限责任公司计算机信息系统运行管理规定，<br>发文文号：华夏久盈发（2016）60号，<br>发文时间：2016-04-15；<br>文件名称：华夏久盈资产管理有限责任公司信息技术管理制度（修订），<br>发文文号：华夏久盈发（2018）13号，<br>发文时间：2018-01-12； |
| 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：华夏久盈资产管理有限责任公司投资管理委员会议事规则，<br>发文文号：华夏久盈发（2021）76号，<br>发文时间：2021-06-10；                                                                                   |
| 授权管理     | 符合规定 | 文件名称：华夏久盈资产管理有限责任公司资金运用业务授权与审批管理暂行办法，<br>发文文号：华夏久盈董发（2017）13号，<br>发文时间：2017-02-24；                                                                            |
| 实施与控制    | 符合规定 | 文件名称：华夏久盈资产管理有限责任公司标准类权益资产投资业务风险管理细则，<br>发文文号：华夏久盈发（2021）68号，<br>发文时间：2021-05-25；                                                                             |
| 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：华夏久盈资产管理有限责任公司股票投资池管理办法，<br>发文文号：华夏久盈发（2021）99号，<br>发文时间：2021-07-28；                                                                                     |
| 交易单元管理办法 | 符合规定 | 文件名称：华夏久盈资产管理有限责任公司交易单元管理办法，<br>发文文号：华夏久盈发（2020）114号，<br>发文时间：2020-07-13；                                                                                     |
| 研究管理办法   | 符合规定 | 文件名称：华夏久盈资产管理有限责任公司股票投资研究管理办法，<br>发文文号：华夏久盈发（2017）40号，<br>发文时间：2017-02-21；                                                                                    |
| 交易管理制度：  |      |                                                                                                                                                               |
| 制度内容     | 评估结果 | 制度明细                                                                                                                                                          |
| 公平交易     | 符合规定 | 文件名称：华夏久盈资产管理有限责任公司公平交易管理办法，<br>发文文号：华夏久盈发（2018）53号，<br>发文时间：2018-03-29；                                                                                      |

|        |      |                                                                           |
|--------|------|---------------------------------------------------------------------------|
| 集中交易   | 符合规定 | 文件名称：华夏久盈资产管理有限责任公司集中交易管理办法，<br>发文文号：华夏久盈发〔2019〕180号，<br>发文时间：2019-11-05； |
| 交易监控   | 符合规定 | 文件名称：华夏久盈资产管理有限责任公司集中交易管理办法，<br>发文文号：华夏久盈发〔2019〕180号，<br>发文时间：2019-11-05； |
| 交易权限管理 | 符合规定 | 文件名称：华夏久盈资产管理有限责任公司集中交易管理办法，<br>发文文号：华夏久盈发〔2019〕180号，<br>发文时间：2019-11-05； |

五. 系统建设

|                                                                                           |                                                                                          |      |      |
|-------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------|------|------|
| 整体评估情况：                                                                                   |                                                                                          |      |      |
| 公司已按《保险机构股票投资管理能力和标准》相关要求建设了股票投资技术系统。其中：                                                  |                                                                                          |      |      |
| 1、研究分析系统使用的是恒生聚源研报系统，具备内部研究报告系统相关管理功能。同时，公司已构建资产配置模型、行业配置模型、个股估值模型，对资产配置、行业配置、行业估值进行分析管理。 |                                                                                          |      |      |
| 2、信息资讯系统使用的是Wind资讯系统和同花顺资讯系统，具备信息查询、研报查询等功能，使用和运行良好。                                      |                                                                                          |      |      |
| 3、交易管理系统使用的是恒生投资03系统，具备授权管理、合规控制、交易、查询等功能，使用和运行良好。                                        |                                                                                          |      |      |
| 4、资产估值和核算系统使用的是恒生估值系统，具备安全、高效的清算交割、财务核算等功能，能够每日进行清算和估值，实现报表自动生成等，使用和运行良好。                 |                                                                                          |      |      |
| 交易管理系统：                                                                                   |                                                                                          |      |      |
| 系统名称                                                                                      | 恒生投资03系统                                                                                 |      |      |
| 上线时间                                                                                      | 2015-05-12                                                                               | 评估结果 | 符合规定 |
| 主要功能                                                                                      | 交易管理系统使用的是恒生投资03系统，具备授权管理、合规控制、交易、查询等功能，使用和运行良好。                                         |      |      |
| 信息资讯系统：                                                                                   |                                                                                          |      |      |
| 系统名称                                                                                      | Wind资讯系统和同花顺资讯系统                                                                         |      |      |
| 上线时间                                                                                      | 2015-05-12                                                                               | 评估结果 | 符合规定 |
| 主要功能                                                                                      | 信息资讯系统使用的是Wind资讯系统和同花顺资讯系统，具备信息查询、研报查询等功能，使用和运行良好。                                       |      |      |
| 研究分析系统：                                                                                   |                                                                                          |      |      |
| 系统名称                                                                                      | 恒生聚源研报系统                                                                                 |      |      |
| 上线时间                                                                                      | 2015-05-12                                                                               | 评估结果 | 符合规定 |
| 主要功能                                                                                      | 研究分析系统使用的是恒生聚源研报系统，具备内部研究报告系统相关管理功能。同时，公司已经构建资产配置模型、行业配置模型、个股估值模型，对资产配置、行业配置、行业估值进行分析管理。 |      |      |
| 资产估值和核算系统：                                                                                |                                                                                          |      |      |
| 系统名称                                                                                      | 恒生估值系统                                                                                   |      |      |
| 上线时间                                                                                      | 2015-05-12                                                                               | 评估结果 | 符合规定 |
| 主要功能                                                                                      | 资产估值和核算系统使用的是恒生估值系统，具备安全、高效的清算交割、财务核算等功能，能够每日进行清算和估值，实现报表自动生成等，使用和运行良好。                  |      |      |

六. 风险控制

|         |
|---------|
| 整体评估情况： |
|---------|

公司已按《保险机构股票投资管理能力标准》相关要求建立有完善的股票业务投资风险控制体系，通过始终坚持事前控制防范、严格事中监督审查、认真事后检查评价的监控模式，监控范围能够涵盖所有股票投资业务环节。具体如下：

1、通过事前拟定投资业务内部决策流程与授权体系、建立股票投资池和禁投池及其入池审查流程、投资系统风控阈值设置与维护实现等方式实现事前防范控制。

2、在交易执行时，通过重要投资事项会议决策、入池审查、投资业务流程审批等方式实现事中监督审查。

3、在交易完成后，通过定期或不定期对持仓股票的合规检查和风险跟踪、投资池和禁投池的合规梳理、业务执行情况合规检查等方式实现事后检查评价。

公司风险管理部门作为中台部门，对股票投资风险管理的报告路径区别于前台投资业务部门，可以直接向公司首席风险管理执行官和审计与风险管理委员会报告。

|         |                                                                                             |      |      |
|---------|---------------------------------------------------------------------------------------------|------|------|
| 压力测试系统： |                                                                                             |      |      |
| 系统名称    | 股票压力测试模型                                                                                    |      |      |
| 上线时间    | 2015-06-01                                                                                  | 评估结果 | 符合规定 |
| 主要功能    | 公司构建了压力测试模型，定期对股票仓位、行业集中度、个股集中度等指标进行压力测试，评估投资组合的影响，并以此进行应急管理处置。                             |      |      |
| 风险管理系统： |                                                                                             |      |      |
| 系统名称    | 恒生投资 O3管理系统                                                                                 |      |      |
| 上线时间    | 2015-05-12                                                                                  | 评估结果 | 符合规定 |
| 主要功能    | 恒生投资 O3管理系统能够通过对各项合规指标和内部风险管理指标设置监控阈值来实现包含各项风险指标预警、合规指标管控的功能；恒生中台绩效评估与风险管理系统能够实现绩效评估的计算和报表。 |      |      |

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。