

# 华泰资产管理有限公司股票投资管理能力建设及 自评估情况（年度披露-20240125）

## 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：	杨平	职务：	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	1970-05
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	总经理室	行政责任人入司时间	2015-04-01
行政责任人专业资质	无	行政责任人专业技术职务	经济师
专业责任人：	姜光明	职务：	资深副总经理兼证券投资事业部总经理
专业责任人类型：	高级管理人员	是否履行完备的授权程序：	
专业责任人性别	男	专业责任人出生年月	1979-12
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	2018-06-01	专业责任人所在部门	总经理室
专业责任人专业资质	无，具备股票投资领域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>华泰资产管理有限公司设置了独立的股票投资部门权益投资部，研究部为股票投资提供研究支持，交易室负责股票投资的集中交易，并且风险合规部、运营保障部和信息技术部为股票投资业务提供合规风控、绩效评估、清算核算、系统支持等方面的支持。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。</p> <p>1、权益投资部负责公司受托投资业务的股票、基金等权益投资的具体实施，设置总经理、投资经理等岗位，配置了专职的股票投资人员。</p> <p>2、研究部负责受托投资业务的研究工作，包括宏观、策略研究与行业及公司研究，设置行业研究、宏观策略研究等岗位，配置了专职的股票研究人员。</p> <p>3、交易室集中负责交易指令的执行，确保交易执行和投资决策相分离，设置权益交易员，配置了股票交易专职人员。</p> <p>4、风险合规部专门负责公司合规管理、风险控制和法务工作，与股票投资业务相关的岗位包括证券投资风险管理岗和信息技术与计量岗（绩效评估岗），配置了股票投资风险控制的专职人员。</p> <p>5、运营保障部负责公司运营保障相关工作，设置基金会计（投资清算岗）、基金会计（核算岗）等岗位，配置了专职于股票投资账户清算的专职人员。</p> <p>6、信息技术部负责公司信息技术相关工作，设置应用运维岗，为股票投资提供系统支持服务。</p> <p>公司根据账户/组合性质、管理资金规模等，配备了独立的股票投资经理。股票投资人员之间，建立了严格的防火墙机制。公司拥有足够的股票投资场所，能确保集中交易办公区域完全隔离。</p> <p>综上所述，华泰资产管理有限公司股票投资管理组织架构设置情况符合《保险机构股票投资管理标准》的规定。</p>			
股票投资部门：			
1			
部门名称	交易室		
发文时间	2022-08-10	文件名称（含文号）	华资字[2022]356号关于根据投资能力管理要求明确相关部门设置及岗位职责的通知
岗位设置：	权益交易员		
2			
部门名称	信息技术部		

发文时间	2021-01-13	文件名称（含文号）	华资字[2021]34号关于华泰资产管理有限责任公司根据投资能力管理要求明确相关部门设置及岗位职责的通知
岗位设置:	应用运维岗		
3			
部门名称	权益投资部		
发文时间	2021-01-13	文件名称（含文号）	华资字[2021]34号关于华泰资产管理有限责任公司根据投资能力管理要求明确相关部门设置及岗位职责的通知
岗位设置:	总经理,投资经理		
4			
部门名称	研究部		
发文时间	2021-01-13	文件名称（含文号）	华资字[2021]34号关于华泰资产管理有限责任公司根据投资能力管理要求明确相关部门设置及岗位职责的通知
岗位设置:	宏观策略研究岗,行业研究岗		
5			
部门名称	运营保障部		
发文时间	2021-01-13	文件名称（含文号）	华资字[2021]34号关于华泰资产管理有限责任公司根据投资能力管理要求明确相关部门设置及岗位职责的通知
岗位设置:	基金会计（投资清算岗）,基金会计（核算岗）		
6			
部门名称	风险合规部		
发文时间	2021-01-13	文件名称（含文号）	华资字[2021]34号关于华泰资产管理有限责任公司根据投资能力管理要求明确相关部门设置及岗位职责的通知
岗位设置:	信息技术与计量岗（绩效评估岗）,证券投资风险管理岗		
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:	<p>股票投资人员之间，建立了严格的防火墙机制，其中：</p> <p>1、股票投资经理与基金投资经理之间：股票投资经理和基金投资经理设置专人专岗，实现风险隔离。</p> <p>2、投资经理与交易人员之间：公司交易实行集中交易制度，并设立集中交易室，实行门禁管理，视频监控，未经批准交易室外其他人不得随意进入。交易室安装集中交易监测系统、预警系统和反馈系统，对交易室固定电话、网络通信等实施交易时间内监控，严格隔离投资决策与交易执行。</p> <p>3、投资管理人员与风险控制人员之间：风险合规部独立于股票投资部门，负责对投资经理的股票投资行为、股票投资风险等进行监控，风险控制人员与股票投资管理人员相互独立，并保持互相制衡关系。</p> <p>4、投资管理人员与绩效评估人员之间：风险合规部配置信息技术与计量岗（绩效评估岗），负责建立风险计量指标体系和绩效归因分析工作。投资管理人员不参与绩效评估工作。</p> <p>5、清算人员与核算人员之间：运营保障部分别设置投资清算岗和核算岗，清算人员和核算人员互相独立，不得相互兼职。</p> <p>另外，公司制定了《信息隔离墙管理办法》，从制度层面规定各项业务之间的风险隔离机制。</p>		
评估结果:	符合规定		
投资场所:	股票投资团队拥有足够的股票投资场所。交易室作为公司集中交易的场所，有独立的办公室，配有门禁系统、监控系统和录音电话，与公共办公区域完全隔离。		
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，股票投资专职人员29人，其中股票投资经理6人，研究人员15人（主要研究人员5人），交易人员3人，风控人员2人，清算人员3人。其中股票投资负责人具有18年以上金融证券从业经历及相关专业资质，投资经理具有8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5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	阙啟荣	权益交易员	是	金融证券投资从业经验	8.38
2	吴越菲	权益交易员	是	金融证券投资从业经验	6.81
3	叶晴	权益交易员	是	金融证券投资从业经验	22.56
4	孟文涛	应用运维岗	否	金融证券投资从业经验	3.49
5	王勃	应用运维岗	否	金融证券投资从业经验	14.56
6	曹骥	应用运维岗	否	金融证券投资从业经验	11.05
7	辛欢	总经理	是	金融证券从业经历	18.89
8	刘子渊	投资经理	是	金融证券投资从业经验	8.04
9	丁星乐	投资经理	是	金融证券投资从业经验	11.54
10	黄志刚	投资经理	是	金融证券投资从业经验	14.63
11	陶意非	投资经理	是	金融证券投资从业经验	17.79
12	万静茹	投资经理	是	金融证券投资从业经验	13.70
13	常晨	宏观策略研究岗	是	行业研究经验	5.00
14	杨帆	行业研究岗	是	行业研究经验	9.63
15	何淦	行业研究岗	是	行业研究经验	1.52
16	季熠	行业研究岗	是	行业研究经验	1.48
17	林子傲	行业研究岗	是	行业研究经验	0.49
18	郭元方	行业研究岗	是	行业研究经验	1.60
19	蒋领	行业研究岗	是	行业研究经验	5.96
20	严勳	行业研究岗	是	行业研究经验	1.93
21	夏炎	行业研究岗	是	行业研究经验	2.52
22	董懿夫	行业研究岗	是	行业研究经验	3.30
23	吴张爽	行业研究岗	是	行业研究经验	6.45
24	王翩翩	行业研究岗	是	行业研究经验	5.70
25	张燕	行业研究岗	是	行业研究经验	7.41
26	朱荣华	行业研究岗	是	行业研究经验	7.51
27	普绍增	行业研究岗	是	行业研究经验	6.13
28	史靖凡	基金会计（投资清算岗）	是	金融证券投资从业经验	7.80
29	耿谊凌	基金会计（投资清算岗）	是	金融证券投资从业经验	10.05
30	石文娟	基金会计（投资清算岗）	是	金融证券投资从业经验	7.50
31	耿书媛	基金会计（核算岗）	否	金融证券投资从业经验	7.37
32	邱云春	基金会计（核算岗）	否	金融证券投资从业经验	7.71
33	汪海媚	基金会计（核算岗）	否	金融证券投资从业经验	2.54
34	朱锡鹏	信息技术与计量岗（绩效评估岗）	否	金融证券投资从业经验	6.87

35	董佳薇	证券投资风险 管理岗	是	金融证券投资从业经验	4.97
36	盛倬	证券投资风险 管理岗	是	金融证券投资从业经验	2.86

#### 四. 投资制度

整体评估情况：		
<p>华泰资产管理有限责任公司建立了完善、有效的股票投资管理基本制度。股票投资基本制度包括《华泰资产管理有限责任公司股票投资管理暂行办法》、《华泰资产管理有限责任公司股票投资管理暂行办法实施细则》、《华泰资产管理有限责任公司股票投资管理暂行办法实施细则》等；决策管理规则包括《华泰资产管理有限责任公司股票投资管理暂行办法》、《华泰资产管理有限责任公司股票投资管理暂行办法实施细则》等；交易管理规则包括《华泰资产管理有限责任公司股票投资管理暂行办法》、《华泰资产管理有限责任公司股票投资管理暂行办法实施细则》等。以上制度经公司管理层批准，以公司正式文件形式下发执行。综合来看，华泰资产管理有限责任公司股票投资管理基本制度符合《保险机构股票投资管理标准》的规定。</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：《华泰资产管理有限责任公司权益投资管理办法》， 发文字号：华资字[2019]157号， 发文时间：2019-07-02； 文件名称：《华泰资产管理有限责任公司研究部研究管理办法》， 发文字号：华资字[2021]38号， 发文时间：2021-01-18；
文档管理	符合规定	文件名称：《华泰资产管理有限责任公司档案管理办法》， 发文字号：华资字[2017]67号， 发文时间：2017-02-16； 文件名称：《华泰资产管理有限责任公司权益投资管理办法》， 发文字号：华资字[2019]157号， 发文时间：2019-07-02； 文件名称：《华泰资产管理有限责任公司研究部研究管理办法》， 发文字号：华资字[2021]38号， 发文时间：2021-01-18；
信息系统管理	符合规定	文件名称：《华泰资产管理有限责任公司信息技术管理制度》， 发文字号：华资字[2019]201号， 发文时间：2019-08-26；
会议制度	符合规定	文件名称：《华泰资产管理有限责任公司权益投资管理办法》， 发文字号：华资字[2019]157号， 发文时间：2019-07-02； 文件名称：《华泰资产管理有限责任公司研究部研究管理办法》， 发文字号：华资字[2021]38号， 发文时间：2021-01-18；
清算与核算	符合规定	文件名称：《华泰资产管理有限责任公司基金会计工作流程》， 发文字号：华资字[2021]37号， 发文时间：2021-01-15；
绩效考核	符合规定	文件名称：《华泰资产管理有限责任公司权益投资管理办法》， 发文字号：华资字[2019]157号， 发文时间：2019-07-02； 文件名称：《华泰资产管理有限责任公司研究部研究管理办法》， 发文字号：华资字[2021]38号， 发文时间：2021-01-18；

业务流程	符合规定	文件名称：《华泰资产管理有限公司创新投资业务流程》， 发文文号：华资字[2022]30号， 发文时间：2022-01-13； 文件名称：《华泰资产管理有限公司股票投资业务流程》， 发文文号：华资字[2022]27号， 发文时间：2022-01-13； 文件名称：《华泰资产管理有限公司股票大宗交易业务暂行管理办法》， 发文文号：华资字[2022]29号， 发文时间：2022-01-13； 文件名称：《华泰资产管理有限公司首次公开发行股票网下询价和申购业务流程》， 发文文号：华资字[2023]115号， 发文时间：2023-04-12；
股票投资岗位职责	符合规定	文件名称：《华泰资产管理有限公司权益投资管理办法》， 发文文号：华资字[2019]157号， 发文时间：2019-07-02； 文件名称：《华泰资产管理有限公司研究部研究管理办法》， 发文文号：华资字[2021]38号， 发文时间：2021-01-18；
保密及危机处理	符合规定	文件名称：《华泰资产管理有限公司重大突发事件应急管理规范》， 发文文号：华资字[2021]92号， 发文时间：2021-02-22； 文件名称：《华泰资产管理有限公司保密工作管理规定》， 发文文号：华资字[2013]53号， 发文时间：2013-04-15； 文件名称：《华泰资产管理有限公司权益投资管理办法》， 发文文号：华资字[2019]157号， 发文时间：2019-07-02； 文件名称：《华泰资产管理有限公司研究部研究管理办法》， 发文文号：华资字[2021]38号， 发文时间：2021-01-18；
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：《华泰资产管理有限公司受托投资管理制度》， 发文文号：华资字[2021]39号， 发文时间：2021-01-18； 文件名称：《华泰资产管理有限公司证券投资管理委员会工作规则》， 发文文号：华资字[2018]170号， 发文时间：2018-09-20；
实施与控制	符合规定	文件名称：《华泰资产管理有限公司受托投资管理制度》， 发文文号：华资字[2021]39号， 发文时间：2021-01-18；
授权管理	符合规定	文件名称：《华泰资产管理有限公司受托投资管理制度》， 发文文号：华资字[2021]39号， 发文时间：2021-01-18； 文件名称：《华泰资产管理有限公司证券投资管理委员会工作规则》， 发文文号：华资字[2018]170号， 发文时间：2018-09-20；
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：《华泰资产管理有限公司股票池管理规定》， 发文文号：华资字[2023]116号， 发文时间：2023-04-12；

研究管理办法	符合规定	文件名称：《华泰资产管理有限公司研究部研究管理办法》， 发文文号：华资字[2021]38号， 发文时间：2021-01-18；
交易单元管理办法	符合规定	文件名称：《华泰资产管理有限公司交易单元管理办法》， 发文文号：华资字[2021]597号， 发文时间：2021-12-23； 文件名称：《华泰资产管理有限公司外部券商研究服务考评细则》， 发文文号：华资字[2023]320号， 发文时间：2023-08-10；
交易管理制度：		
制度内容	评估结果	制度明细
交易监控	符合规定	文件名称：《华泰资产管理有限公司交易室安全管理规定》， 发文文号：华资字[2019]19号， 发文时间：2019-01-21；
集中交易	符合规定	文件名称：《华泰资产管理有限公司交易室投资交易管理办法》， 发文文号：华资字[2019]22号， 发文时间：2019-01-21；
交易权限管理	符合规定	文件名称：《华泰资产管理有限公司交易室投资交易管理办法》， 发文文号：华资字[2019]22号， 发文时间：2019-01-21；
公平交易	符合规定	文件名称：《华泰资产管理有限公司公平交易管理办法》， 发文文号：华资字[2013]63号， 发文时间：2013-04-23；

## 五. 系统建设

整体评估情况：			
<p>公司高度重视信息系统建设，持续加强系统建设投入，建立了完备的股票投资技术系统，包含携宁投资研究管理平台、Wind金融终端、同花顺金融终端、恒生03.2交易系统、恒生资产估值与会计核算系统、华泰资管投资研究平台等。研究分析平台通过数据库建立资产配置模型和行业配置模型、股票估值模型，通过携宁投资研究管理平台实现内部研报归档，为投资决策提供依据。信息资讯系统运行稳定，并获得多家券商研究服务支持，为投资管理提供准确高效的实时行情和金融数据分析。交易管理系统与资产估值和核算系统运行稳定，架构成熟，功能模块充分满足投资交易需求，并能迅速响应市场新增业务要求。综上所述，华泰资产管理有限公司股票投资技术系统建设情况符合《保险机构股票投资管理标准》的规定。</p>			
交易管理系统：			
系统名称	恒生03.2交易系统		
上线时间	2008-08-11	评估结果	符合规定
主要功能	恒生03.2交易系统运行稳定，架构成熟，具备授权管理、合规控制和交易功能，还具备每日清算交割的功能，功能模块充分满足投资交易需要。		
信息资讯系统：			
系统名称	Wind金融终端		
上线时间	2007-09-11	评估结果	符合规定
主要功能	wind金融终端是国内主流的金融数据和分析工具服务商之一，获得大部分券商研究服务支持，具有行情分析、金融资讯数据库、数据提取与分析等功能，为投资管理提供研究支持服务。		
系统名称	同花顺金融终端		
上线时间	2013-04-01	评估结果	符合规定
主要功能	同花顺金融终端是国内主流的金融数据和分析工具服务商之一，获得大部分券商研究服务支持，具有行情分析、金融资讯数据库、数据提取与分析等功能，为投资管理提供研究支持服务。		
研究分析系统：			
系统名称	携宁投资研究管理平台		
上线时间	2022-12-13	评估结果	符合规定

主要功能	携宁投资研究管理平台具备股票池管理、研究报告分类归档等功能，作为公司内部研究报告系统，为投资决策提供依据。		
系统名称	华泰资管投资研究平台		
上线时间	2020-09-25	评估结果	符合规定
主要功能	通过数据库搭建资产配置模型、行业配置模型、股票估值模型，为投资决策提供依据。		
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	2006-05-30	评估结果	符合规定
主要功能	恒生资产估值与会计核算系统整体运行稳定，系统采用了成熟架构设计，具备完整、安全、高效的清算和财务核算功能，能够每日进行清算和核算估值，可实现财务报表的自动生成，能够满足公司投资业务需要。		

## 六. 风险控制

整体评估情况：			
公司建立了健全的风险管理制度体系，风险管理工作遵循全面控制原则、有效性原则、责任追究原则、成本效益原则和动态管理原则，公司持续完善交易系统风控条款设置，实时监控各个账户的投资运作，采用科学合理的风险计量模型对投资风险进行量化分析和评估，加强对公司各项投资业务的事前审核、事中监控和事后管理，定期和不定定期进行风险评估和报告，实行独立于投资管理的报告制度，风险控制体系符合《关于优化保险机构投资管理能力和监管有关事项的通知》的要求。			
评估结果	符合规定		
风险管理制度：			
制度名称	《华泰资产管理有限公司风险管理制度》-华资字[2023]492号-2023年12月22日-董事会、《华泰资产管理有限公司风险管理手册》-华资字[2013]60号-2013年4月23日-经营管理层、《华泰资产管理有限公司压力测试手册》-华资字[2013]77号-2013年4月23日-经营管理层、《华泰资产管理有限公司市场风险管理办法》-华资字[2024]20号-2024年1月18日-经营管理层、《华泰资产管理有限公司流动性风险管理办法》-华资字[2017]195号-2017年7月20日-经营管理层、《华泰资产管理有限公司操作风险管理办法》-华资字[2017]193号-2017年7月20日-经营管理层、《华泰资产管理有限公司内部问责制度》-华资字[2011]3号-2011年1月24日-经营管理层		
评估情况	公司制定了《华泰资产管理有限公司风险管理制度》、《华泰资产管理有限公司风险管理手册》、《华泰资产管理有限公司市场风险管理办法》、《华泰资产管理有限公司流动性风险管理办法》、《华泰资产管理有限公司操作风险管理办法》、《华泰资产管理有限公司内部问责制度》等一系列风险管理制度，建立了健全的风险管理制度体系，规定风险管理工作遵循全面控制原则、有效性原则、责任追究原则、成本效益原则和动态管理原则，针对各个风险点提出了控制手段，明确了内部问责和责任追究机制，并针对各类风险建立了量化分析指标体系，建立和运用限额分析、情景分析、压力测试及归因分析等模型和方法，预测和充分揭示承担的风险状况，并且对投资组合进行风险调整后收益分析及绩效归因分析，进行绩效考核和评估。		
评估结果	符合规定		
压力测试系统：			
系统名称	衡泰xAsset风控系统-压力测试模块		
上线时间	2020-12-14	评估结果	符合规定
主要功能	衡泰xAsset风控系统压力测试模块可实现对股票仓位、行业集中度、个股集中度进行压力测试，评估测试结果对组合净值影响，将测试结果发送投资经理及时制定应急预案。		
风险管理系统：			
系统名称	恒生投资交易系统-风险控制模块		
上线时间	2008-08-11	评估结果	符合规定
主要功能	恒生投资交易系统-风险控制模块可实现组合投前风险指标控制和审批、合规指标盘中盯市监控等。		
系统名称	衡泰xAsset风控系统-风险管理模块		
上线时间	2015-08-03	评估结果	符合规定
主要功能	衡泰xAsset风控系统风险管理模块拥有风险限额管理和分析、绩效评估、证券池管理、异常交易管理、风险管理报告等功能，实现了组合风险指标预警、合规风险控制、组合投资收益分解、组合股票归因和债券归因分析等。		
系统名称	风险管控及监督系统RMIS		

上线时间	2023-12-05	评估结果	符合规定
主要功能	系统主要功能包括综合风险监控地图、股票多因子收益归因及风险归因、股票组合风格暴露及敞口监控、组合风险绩效、风险管理公示、跨组合（虚拟组合）分析、组合间对比分析、个性化风险计量指标及报告监控等模块。		

## 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。