

# 中再资产管理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-20240122）

## 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：	李巍	职务：	党委书记、副董事长、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	1971-01
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	2017-03-15
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：	余辉	职务：	权益投资总监、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门负责人	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	1976-07
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	2019-10-10	专业责任人所在部门	权益投资部
专业责任人专业资质	无	专业责任人专业技术职务	无

## 二、组织架构

整体评估情况：			
<p>中再资产管理股份有限公司具备股票投资完善的组织架构，符合监管规定。股票投资部门设置、投资经理配备、防火墙机制、投资场所等方面符合监管规定。具体情况如下：</p> <p>公司设立权益投资部，该部门独立负责股票投资事宜，具体职责如下：1. 负责境内权益投资策略制定、投资实施，并根据市场形势变化及时调整（境内权益投资包括A股股票、权益类基金等权益类产品投资）；2. 牵头开展股票投资管理的一、二级市场投资以及互联互通下人民币计价的其他权益类品种投资；3. 负责境内公开市场股票投资的决策制定、报批和贯彻执行；4. 负责境内公开市场股票定向增发投资业务的决策制定、报批和贯彻执行；5. 负责境内公开市场新股投资业务的决策制定、报批和贯彻执行；6. 负责境内权益类基金投资业务的决策制定、报批和贯彻执行；7. 负责以权益法核算为基准的重大境内权益投资项目的决策制定、报批和贯彻执行；8. 负责境内向第三方发行或受托公开市场权益类资产管理产品的投资管理工作；9. 密切跟踪研究重点行业、重点公司，并根据投资需要，参与发起公司证券池（含股票池、基金池）的相关工作；10. 根据公司统一安排，参与外部券商投研服务评选打分及分仓管理等相关工作；11. 定期总结不同受托资金的境内公开市场权益投资管理情况，并提供投资总结等报告；12. 负责所投资资产的投后管理工作；13. 负责总经理室授权和交办的其他工作。公司采取投研一体化模式，投资与研究紧密互动，研究员的成果能够及时传达到投资经理，并充分讨论，投资端的需求和结果也能及时反馈给研究员。权益投资部内部设立部门负责人岗、股票投资岗、新股投资岗、股票研究岗、基金投资岗等，部门共计17人，实行专人专岗，其中股票投资经理6人。股票投资经理与基金投资经理岗位分别独立，存在防火墙机制。投资经理与交易人员、投资管理人员与风险控制、绩效评估人员分属于不同部门，均建立防火墙机制。清算人员与核算人员分属运营管理的不同处室，独立工作，存在防火墙机制。公司拥有足够的股票投资场所，交易管理部实行集中交易，具备独立办公场所。</p>			
股票投资部门：			
1			
部门名称	交易管理部		
发文时间	2023-12-29	文件名称（含文号）	《关于调整公司部分部门职责和内设岗位职责的通知》（中再资产发〔2023〕497号）
岗位设置：	权益交易员岗		
2			
部门名称	信息技术部		

发文时间	2023-12-29	文件名称 (含文号)	《关于调整公司部分部门职责和内设岗位职责的通知》(中再资产发(2023)497号)
岗位设置:	基础环境运营管理岗,系统建设管理岗,系统运维管理岗		
3			
部门名称	投资与创新研究中心		
发文时间	2023-12-29	文件名称 (含文号)	《关于调整公司部分部门职责和内设岗位职责的通知》(中再资产发(2023)497号)
岗位设置:	行业研究岗		
4			
部门名称	权益投资部		
发文时间	2023-12-29	文件名称 (含文号)	《关于调整公司部分部门职责和内设岗位职责的通知》(中再资产发(2023)497号)
岗位设置:	基金投资岗,新股投资岗,股票投资岗,股票研究岗,部门负责人岗		
5			
部门名称	运营管理部		
发文时间	2023-12-29	文件名称 (含文号)	《关于调整公司部分部门职责和内设岗位职责的通知》(中再资产发(2023)497号)
岗位设置:	会计核算岗,清算管理岗		
6			
部门名称	风险管理部		
发文时间	2023-12-29	文件名称 (含文号)	《关于调整公司部分部门职责和内设岗位职责的通知》(中再资产发(2023)497号)
岗位设置:	绩效考核岗,部门负责人岗,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:	防火墙机制建设情况符合监管规定。股票投资经理与基金投资经理岗位分别独立,存在防火墙机制。投资经理与交易人员、投资管理人与风险控制、绩效评估人员分属于不同部门,均建立防火墙机制。清算人员与核算人员在运营管理部区分岗位有不同处室独立工作,存在防火墙机制。均符合规定。		
评估结果:	符合规定		
投资场所:	投资场所情况及其隔离情况符合监管规定。公司拥有足够的股票投资场所,交易管理部具备独立的办公场所。		
评估结果:	符合规定		

### 三、专业队伍

整体评估情况:					
中再资产管理股份有限公司具备完整的专业人员队伍,股票投资管理专业队伍建设情况符合监管规定。专业人员数量、经验、资质能力等均符合规定。具体情况如下: 我公司股票投资规模超过10亿元。专职人员21人,其中股票投资经理6人,研究人员8人(主要研究人员4人),交易人员3人,风险控制人员2人,清算人员2人。其中股票负责人具有10年以上股票投资管理经验,投资经理均具有3年以上股票投资管理经验或5年以上金融证券投资从业经验,具有良好的过往业绩表现,主要研究人员均具有3年以上行业研究经验。					
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	刘凡	权益交易员岗	是	金融证券投资从业经验	10.07
2	寇宇利	权益交易员岗	是	金融证券投资从业经验	2.81

3	陈英伦	权益交易员岗	是	金融证券投资从业经验	3.40
4	郑良平	系统建设管理岗	否	其他	5.65
5	颜涛	系统运维管理岗	否	其他	9.99
6	梁坤	行业研究岗	是	行业研究经验	6.73
7	孙浦哲	行业研究岗	是	行业研究经验	6.73
8	米建伟	行业研究岗	是	行业研究经验	7.39
9	祝佳婧	新股投资岗	是	金融证券投资从业经验	13.83
10	姜通晓	股票投资岗	是	金融证券投资从业经验	5.50
11	韩璐	股票投资岗	是	金融证券投资从业经验	6.42
12	潘庆华	股票投资岗	是	股票投资管理经验	6.81
13	张嵩	股票投资岗	是	股票投资管理经验	15.98
14	刘昕	股票投资岗	是	股票投资管理经验	9.23
15	陆铭	股票研究岗	否	行业研究经验	5.81
16	王润东	股票研究岗	是	行业研究经验	6.98
17	籍扬宇	股票研究岗	是	行业研究经验	7.90
18	周嵩尧	股票研究岗	是	行业研究经验	1.56
19	张懿	股票研究岗	是	行业研究经验	1.56
20	孙博睿	股票研究岗	是	行业研究经验	13.41
21	余辉	部门负责人岗	否	股票投资管理经验	12.57
22	闵雪	会计核算岗	否	金融证券投资从业经验	6.56
23	樊帆	会计核算岗	否	金融证券投资从业经验	8.49
24	秦莽	会计核算岗	否	金融证券投资从业经验	12.57
25	郝艳梅	会计核算岗	否	金融证券投资从业经验	8.48
26	邹玉山	会计核算岗	否	金融证券投资从业经验	17.50
27	向江林	清算管理岗	是	金融证券投资从业经验	6.56
28	张宏芸	清算管理岗	是	金融证券投资从业经验	18.15
29	杨宏亮	绩效考核岗	否	金融证券投资从业经验	5.23
30	龚达	绩效考核岗	否	金融证券投资从业经验	5.23
31	王玉翠	风险管理岗	是	金融证券投资从业经验	5.19
32	代俊杰	风险管理岗	是	金融证券投资从业经验	2.31

#### 四. 投资制度

整体评估情况:		
<p>中再资产管理股份有限公司建立了完善的股票投资制度体系,符合监管标准。公司建立了完备的股票投资基本制度、决策管理制度、研究管理制度、交易管理制度,相关制度文件均已正式发文。具体情况如下:</p> <p>基本制度方面,《中再资产管理股份有限公司境内公开市场股票投资管理办法》(中再资产发〔2022〕115号)等多个制度,涵盖了股票投资岗位职责、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。决策管理制度方面,《中再资产管理股份有限公司境内公开市场股票投资管理办法》(中再资产发〔2022〕115号)涵盖了投资决策体系内容、实施与控制,《中再资产管理股份有限公司股票池管理办法》(中再资产发〔2022〕132号)明确了投资授权的层级、流程、规则、授权监控等授权管理相关内容。研究管理制度方面,《中再资产管理股份有限公司投资管理暂行办法》(中再资产发〔2018〕308号)包括了投资策略、行业和个股研究、投资报告制度、调研管理制度等内容,《中再资产管理股份有限公司股票池管理办法》(中再资产发〔2022〕132号)等制度包括了股票池产生、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,《中再资产管理股份有限公司外部研究服务评价及交易单元管理办法》(中再资产发〔2020〕336号)包含了选择标准、研究服务质量评价等内容。交易管理制度方面,《中再资产管理股份有限公司投资交易管理办法》(中再资产发〔2022〕147号)等制度包含了集中交易、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

清算与核算	符合规定	文件名称：中再资产管理股份有限公司投资业务会计核算实施细则， 发文文号：中再资产发（2016）125号， 发文时间：2016-05-20； 文件名称：中再资产管理股份有限公司清算管理办法， 发文文号：中再资产发（2020）395号， 发文时间：2020-12-29；
操作规程	符合规定	文件名称：中再资产管理股份有限公司境内公开市场股票投资管理办法， 发文文号：中再资产发（2022）115号， 发文时间：2022-04-13；
股票投资岗位职责	符合规定	文件名称：中再资产管理股份有限公司各部门内设岗位职责说明书， 发文文号：中再资产发（2023）497号， 发文时间：2023-12-29；
信息系统管理	符合规定	文件名称：中再资产管理股份有限公司投资管理系统权限管理规定， 发文文号：中再资产发（2020）413号， 发文时间：2020-12-29； 文件名称：中再资产管理股份有限公司投资管理系统生产环境管理规定， 发文文号：中再资产发（2020）414号， 发文时间：2020-12-29； 文件名称：中再资产管理股份有限公司外部资讯软件管理暂行办法， 发文文号：中再资产发（2020）412号， 发文时间：2020-12-29； 文件名称：中再资产管理股份有限公司投资管理系统业务操作管理办法， 发文文号：中再资产发（2021）498号， 发文时间：2021-12-24；
绩效考核	符合规定	文件名称：中再资产管理股份有限公司员工绩效考核管理办法， 发文文号：中再资产发（2022）167号， 发文时间：2022-04-19； 文件名称：中再资产管理股份有限公司风险类指标绩效考核管理办法， 发文文号：中再资产发（2022）174号， 发文时间：2022-04-20； 文件名称：中再资产管理股份有限公司投资绩效评估管理办法， 发文文号：中再资产发（2020）377号， 发文时间：2020-12-25；
保密及危机处理	符合规定	文件名称：中再资产管理股份有限公司境内公开市场股票投资管理办法， 发文文号：中再资产发（2022）115号， 发文时间：2022-04-13； 文件名称：中再资产管理股份有限公司突发事件应急处理总体预案， 发文文号：中再资产发（2021）295号， 发文时间：2021-08-11； 文件名称：中再资产管理股份有限公司保密管理办法， 发文文号：中再资产发（2022）168号， 发文时间：2022-04-20；
业务流程	符合规定	文件名称：中再资产管理股份有限公司境内公开市场股票投资管理办法， 发文文号：中再资产发（2022）115号， 发文时间：2022-04-13；
文档管理	符合规定	文件名称：中再资产管理股份有限公司业务档案管理细则， 发文文号：中再资产发（2022）185号， 发文时间：2022-04-20； 文件名称：中再资产管理股份有限公司境内公开市场股票投资管理办法， 发文文号：中再资产发（2022）115号， 发文时间：2022-04-13；
会议制度	符合规定	文件名称：中再资产管理股份有限公司境内公开市场股票投资管理办法， 发文文号：中再资产发（2022）115号， 发文时间：2022-04-13；
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：中再资产管理股份有限公司境内公开市场股票投资管理办法， 发文文号：中再资产发（2022）115号， 发文时间：2022-04-13；
授权管理	符合规定	文件名称：中再资产管理股份有限公司投资审批授权管理办法， 发文文号：中再资产发（2022）133号， 发文时间：2022-04-15；
实施与控制	符合规定	文件名称：中再资产管理股份有限公司境内公开市场股票投资管理办法， 发文文号：中再资产发（2022）115号， 发文时间：2022-04-13；
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：中再资产管理股份有限公司境内公开市场股票投资管理办法， 发文文号：中再资产发（2022）115号， 发文时间：2022-04-13； 文件名称：中再资产管理股份有限公司股票池管理办法， 发文文号：中再资产发（2022）132号， 发文时间：2022-04-18；
研究管理办法	符合规定	文件名称：中再资产管理股份有限公司投资研究管理暂行办法， 发文文号：中再资产发（2018）308号， 发文时间：2018-12-28；
交易单元管理办法	符合规定	文件名称：中再资产管理股份有限公司外部研究服务评价及交易单元管理办法， 发文文号：中再资产发（2020）336号， 发文时间：2020-12-17；
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：中再资产管理股份有限公司场内投资交易操作规程， 发文文号：中再资产发（2021）468号， 发文时间：2021-12-09； 文件名称：中再资产管理股份有限公司投资交易管理办法， 发文文号：中再资产发（2022）147号， 发文时间：2022-04-15；
集中交易	符合规定	文件名称：中再资产管理股份有限公司场内投资交易操作规程， 发文文号：中再资产发（2021）468号， 发文时间：2021-12-09； 文件名称：中再资产管理股份有限公司投资交易管理办法， 发文文号：中再资产发（2022）147号， 发文时间：2022-04-15；
交易权限管理	符合规定	文件名称：中再资产管理股份有限公司投资交易管理办法， 发文文号：中再资产发（2022）147号， 发文时间：2022-04-15；
交易监控	符合规定	文件名称：中再资产管理股份有限公司场内投资交易操作规程， 发文文号：中再资产发（2021）468号， 发文时间：2021-12-09； 文件名称：中再资产管理股份有限公司投资交易管理办法， 发文文号：中再资产发（2022）147号， 发文时间：2022-04-15；

## 五. 系统建设

整体评估情况：

<p>经评估，中再资产管理股份有限公司的股票投资系统建设情况符合监管规定。研究分析系统、信息资讯系统、交易管理系统、资产估值和核算系统的建设、功能、使用、运行情况均符合规定。具体情况如下：</p> <p>研究分析系统：公司已有的投研平台，萝卜投研研究分析系统等支持投资业务，支持资产配置模型、行业配置模型、个股研究、个股估值模型、内部研究报告系统。为投资及研究提供有效支持。符合监管规定。</p> <p>信息资讯系统：公司接入多家资讯服务系统和资讯数据，包含：同花顺iFind大金融数据终端、Wind金融终端、启明星证券研究终端等。在公司内部研究和系统中可获得多家券商的研究信息及市场报告等资讯内容，可获得每日市场的金融数据，为投资及研究和内部估值核算提供有效支持。符合监管规定。</p> <p>交易管理系统：投资交易系统支持投资指令的下达，投资指令的执行和委托。支持投资部门负责人，投资经理，投资经理备岗的投资授权管理。投资交易指令通过系统风险检查和合规控制。系统具备投资交易功能，实现电子化直连接入沪/深交易所、银行间、期货商柜台等。为投资管理提供有效支持。符合监管规定。</p> <p>资产估值和核算系统：估值和核算系统每日日终从交易所、中登、期货商、托管行处接收当日清算数据，系统具备安全、高效的清算交割、财务核算模块。支持每日投资交易的清算和估值，同时与多家托管行的划款电子指令直连，支持投资交易清算划款。系统支持报表的自动生成和导出。符合监管规定。</p>			
交易管理系统：			
系统名称	恒生系统		
上线时间	2005-02-28	评估结果	符合规定
主要功能	支持开展上交所、深交所、沪港通、深港通股票一级市场和二级市场的相关业务。系统支持日常投资交易中授权管理、交易管理、合规控制等。支持投资指令的下达，投资指令的执行和委托。支持投资部门负责人，投资经理，投资经理备岗的投资授权管理。投资交易指令通过系统风险检查和合规控制。系统具备投资交易功能，实现电子化接入沪/深交易所、银行间、期货商柜台等。为投资管理提供有效支持。		
信息资讯系统：			
系统名称	同花顺iFind大金融数据终端		
上线时间	2021-05-01	评估结果	符合规定
主要功能	同花顺iFind大金融数据终端可以为投研团队提供股票、债券、期货、基金、宏观行业、新闻研报、产权交易、行情、分析工具等综合性金融服务。		
系统名称	Wind金融终端		
上线时间	2005-02-28	评估结果	符合规定
主要功能	Wind金融数据终端可以为投研团队提供市场数据、资讯信息，包括行业研究、债券信息、各类指数信息等。		
系统名称	启明星证券研究终端		
上线时间	2022-04-30	评估结果	符合规定
主要功能	启明星证券研究终端能够提供多家国内外券商的研究报告，满足投研团队日常的研报阅读需求。		
研究分析系统：			
系统名称	投研平台		
上线时间	2017-11-15	评估结果	符合规定
主要功能	支持资产配置，行业配置，个股研究等模型及功能，内部研究报告流转。		
系统名称	萝卜投研		
上线时间	2018-05-30	评估结果	符合规定
主要功能	支持资产配置，行业配置，个股估值等模型及功能，内部研究报告流转。		
资产估值和核算系统：			
系统名称	Fusion系统		
上线时间	2023-04-17	评估结果	符合规定
主要功能	系统支持每日清算和估值对账，能够实现安全、高效的清算交割。该系统符合监管规定。		

## 六. 风险控制

整体评估情况：
---------

<p>经评估，中再资产管理股份有限公司的股票投资风险控制体系符合监管规定。公司的风险控制体系覆盖了事前控制、事中监督、事后评价，具备独立于投资管理的报告制度。公司秉承“全面覆盖、全程管理、全员参与”的风险管理理念，构筑了多层次、多角度、全方位覆盖的风险管理体系。风险管理决策层、执行层、操作层，建立了由总经理后室及其下设风险管理部、审计委员会、各职能部门事前控制、事中监督、事后评价，各司其职、全体员工共同参与的全面风险管理组织体系。《中再资产管理股份有限公司全面风险管理办法》（中再资产发〔2023〕370号）规定了公司风险管理政策及程序等相关内容，《中再资产管理股份有限公司投资风险管理办法》（中再资产发〔2022〕315号）规定并明确了风险管理方面独立于投资管理的报告制度。</p>			
评估结果	符合规定		
风险管理制度：			
制度名称	《中再资产管理股份有限公司全面风险管理办法》、《中再资产管理股份有限公司投资风险管理办法》、《中再资产管理股份有限公司股票池管理办法》、《中再资产管理股份有限公司禁投A股股票池管理办法》、《中再资产管理股份有限公司投资风险限额管理办法》、《中再资产管理股份有限公司权益资产止损管理办法》、《中再资产管理股份有限公司投资绩效评估管理办法》、《中再资产管理股份有限公司问责管理办法》		
评估情况	<p>经评估，中再资产管理股份有限公司的股票投资风险控制体系符合监管规定，包括了风险管理原则、风险计量、风险点与控制手段、责任追究机制及绩效评估等内容。具体情况如下：</p> <p>《中再资产管理股份有限公司全面风险管理办法》（中再资产发〔2023〕370号）规定了公司风险管理政策及程序等相关内容。《中再资产管理股份有限公司投资风险管理办法》（中再资产发〔2022〕315号）规定并明确了风险管理原则、风险计量、风险点与控制手段、独立于投资管理的报告制度等细则。《中再资产管理股份有限公司股票池管理办法》（中再资产发〔2022〕132号）《中再资产管理股份有限公司禁投A股股票池管理办法》（中再资产发〔2023〕104号）《中再资产管理股份有限公司投资风险限额管理办法》（中再资产发〔2022〕137号）《中再资产管理股份有限公司权益资产止损管理办法》（中再资产发〔2023〕493号）《中再资产管理股份有限公司投资绩效评估管理办法》（中再资产发〔2020〕377号）明确了绩效评估，事后评价原则等。《中再资产管理股份有限公司问责管理办法》（中再资产发〔2022〕160号）明确了责任追究机制。</p>		
评估结果	符合规定		
压力测试系统：			
系统名称	数据平台		
上线时间	2018-06-30	评估结果	符合规定
主要功能	该系统符合监管要求。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，并制定相应的应急预案。		
系统名称	自建SAS压力测试程序		
上线时间	2019-01-01	评估结果	符合规定
主要功能	该系统符合监管要求。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，并制定相应的应急预案。		
风险管理系统：			
系统名称	中再A股绩效评估系统		
上线时间	2018-01-01	评估结果	符合规定
主要功能	该系统符合监管要求。满足境内股票组合的绩效评估相关要求。		
系统名称	彭博		
上线时间	2018-01-01	评估结果	符合规定
主要功能	该系统符合监管要求。满足境内外股票组合的绩效评估相关要求。		
系统名称	恒生系统		
上线时间	2005-02-28	评估结果	符合规定
主要功能	该系统符合监管要求。满足事前风控合规管理要求，包括监管比例、集中度、股票池等合规检查。		
系统名称	数据平台		
上线时间	2018-06-30	评估结果	符合规定
主要功能	该系统符合监管要求。满足事后风险监控要求，包括监管比例、限额指标、止损指标、风险指标及收益回撤指标等风险预警与合规管理功能。		

## 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。

