

光大永明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-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：	程锐	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	1982-12
行政责任人学历	研究生	行政责任人学位	博士
行政责任人所在部门	公司高管	行政责任人入司时间	2014-05-01
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：	牛继中	职务：	部门总监
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	1982-01
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	2017-09-21	专业责任人所在部门	权益投资部
专业责任人专业资质	无，具备相关投资领域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：

公司建立了职责明确、分工合理、有效制衡的股票投资组织架构，并以正式发文形式明确各部门及岗位职责。公司设立了权益投资部负责股票投资的研究和投资，交易管理部负责交易指令的具体执行，运营管理部负责资金清算与核算，风险管理部负责全面风险管理，信息技术部提供系统和技术支持，人力资源部负责绩效考核，并在各部门设置相应岗位负责各项具体工作。公司在不同部门之间建立防火墙机制，实行严格的业务分离和独立运作。公司拥有独立的股票投资场所并与其他办公区域严格隔离。经评估，符合《保险机构股票投资管理标准》相关要求。

股票投资部门：

1

部门名称	交易管理部		
发文时间	2021-12-08	文件名称（含文号）	关于优化投资条线组织架构及部门职责的通知（光保资发〔2021〕546号）
岗位设置：	股票交易员		

2

部门名称	人力资源部		
发文时间	2021-01-25	文件名称（含文号）	关于印发优化调整后的部门职责、岗位说明书的通知（光保资发〔2021〕52号）
岗位设置：	组织发展岗		

3

部门名称	信息技术部		
发文时间	2021-01-25	文件名称（含文号）	关于印发优化调整后的部门职责、岗位说明书的通知（光保资发〔2021〕52号）
岗位设置：	应用支持岗		

4

部门名称	权益投资部		
发文时间	2021-12-08	文件名称（含文号）	关于优化投资条线组织架构及部门职责的通知（光保资发〔2021〕546号）
岗位设置：	研究员,股票投资经理		

5

部门名称	运营管理部		
发文时间	2021-01-25	文件名称（含文号）	关于印发优化调整后的部门职责、岗位说明书的通知（光保资发〔2021〕52号）
岗位设置：	投资核算岗,投资清算岗		

6

部门名称	风险管理部		
发文时间	2022-12-21	文件名称（含文号）	关于调整法务合规部、风险管理部部门职责的通知（光保资发〔2022〕866号）
岗位设置：	全面风险管理岗,风险控制岗,风险监测岗		
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：	按照《保险机构股票投资管理能力标准》相关要求，公司防火墙机制建立符合规定。股票投资经理与基金投资经理专人专岗，无岗位兼任情况；公司设立独立交易管理部，实行集中交易制度，投资经理与交易人员之间严格分离；公司设立风险管理部、运营管理部、人力资源部，各部门工作严格分离，投资人员与风险控制、绩效评估人员之间严格分离，清算人员与核算人员之间严格分离、无岗位职责交叉。		
评估结果：	符合规定		
投资场所：	按照《保险机构股票投资管理能力标准》相关要求，公司投资场所情况符合规定。有独立的股票投资场所，集中交易室独立设置且有独立门禁，非交易人员不得入内。		
评估结果：	符合规定		

三、专业队伍

整体评估情况：					
公司股票投资规模超过10亿元，专职人员13人，其中专职股票投资经理4人，研究人员5人（其中主要研究人员2人），交易人员2人，风控人员1人，清算人员1人，核算人员1人，系统支持人员1人，绩效评估人员1人。其中股票投资负责人具有5年以上股票投资管理经验和8年以上金融证券从业经历及相关专业资质，投资经理具有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，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。公司采取投研一体化模式，股票投资经理兼职从事研究工作，人员数量和人员从业经历均符合能力标准。经评估，符合《保险机构股票投资管理能力标准》相关要求。					
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	张溶倩	股票交易员	是	金融证券投资从业经验	0.75
2	胡浩	股票交易员	是	金融证券投资从业经验	4.04
3	华野	组织发展岗	否	其他	7.54
4	常文程	应用支持岗	否	其他	12.28
5	杨赫尘	研究员	是	行业研究经验	15.39
6	王鹏	研究员	是	行业研究经验	8.02
7	李冰	研究员	是	行业研究经验	3.32
8	吴涛	研究员	是	行业研究经验	2.79
9	李辰	研究员	是	行业研究经验	9.40
10	王申璐	股票投资经理	是	金融证券投资从业经验	7.12
11	孙伟娜	股票投资经理	是	股票投资管理经验	11.80

12	牛继中	股票投资经理	是	股票投资管理经验	16.13
13	刘奇	股票投资经理	是	金融证券投资从业经验	7.62
14	杨艳	投资核算岗	否	其他	15.55
15	李豫玲	投资清算岗	是	其他	8.11
16	罗常章	风险监测岗	是	其他	3.47

四. 投资制度

整体评估情况：		
公司建立了完善、有效的股票投资管理制度体系，均已按照公司规章制度管理规定履行审批及发文程序。制度内容包括：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。基本制度内容涵盖股票投资岗位职责、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；决策管理制度内容涵盖投资决策体系、授权管理、实施与控制等；研究管理制度内容涵盖研究管理、股票池管理、交易单元管理；交易管理制度内容涵盖集中交易、公平交易、交易权限管理和交易监控等。经评估，符合《保险机构股票投资管理能力标准》相关要求。		
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：股票一级市场投资操作规程， 发文文号：光保资发〔2023〕564号， 发文时间：2023-09-25； 文件名称：资产管理业务会计核算与估值管理办法， 发文文号：光保资发〔2022〕757号， 发文时间：2022-11-04； 文件名称：股票二级市场投资操作规程， 发文文号：光保资发〔2022〕880号， 发文时间：2022-12-27； 文件名称：投资清算管理办法， 发文文号：光保资发〔2023〕570号， 发文时间：2023-09-27；
业务流程	符合规定	文件名称：股票一级市场投资操作规程， 发文文号：光保资发〔2023〕564号， 发文时间：2023-09-25； 文件名称：股票二级市场投资操作规程， 发文文号：光保资发〔2022〕880号， 发文时间：2022-12-27；
绩效考核	符合规定	文件名称：绩效考核管理办法， 发文文号：光保资发〔2023〕1号， 发文时间：2023-01-03；
股票投资岗位职责	符合规定	文件名称：股票投资管理办法， 发文文号：光保资发〔2020〕335号， 发文时间：2020-11-12；
保密及危机处理	符合规定	文件名称：股票投资管理办法， 发文文号：光保资发〔2020〕335号， 发文时间：2020-11-12； 文件名称：保密管理办法， 发文文号：光保资发〔2021〕439号， 发文时间：2021-09-28； 文件名称：重大突发事件应急处理办法， 发文文号：光保资发〔2021〕125号， 发文时间：2021-03-16； 文件名称：突发事件信息报告与调查处理管理办法， 发文文号：光保资发〔2021〕154号， 发文时间：2021-03-30； 文件名称：内幕交易风险防范管理办法， 发文文号：光保资发〔2022〕390号， 发文时间：2022-06-22； 文件名称：集中交易管理办法， 发文文号：光保资发〔2023〕598号， 发文时间：2023-10-12；
信息系统管理	符合规定	文件名称：投资交易系统日常维护操作规程， 发文文号：光保资发〔2023〕760号， 发文时间：2023-12-28； 文件名称：集中交易管理办法， 发文文号：光保资发〔2023〕598号， 发文时间：2023-10-12；

操作规程	符合规定	文件名称：股票一级市场投资操作规程， 发文文号：光保资发〔2023〕564号， 发文时间：2023-09-25； 文件名称：股票二级市场投资操作规程， 发文文号：光保资发〔2022〕880号， 发文时间：2022-12-27；
会议制度	符合规定	文件名称：股票投资管理办法， 发文文号：光保资发〔2020〕335号， 发文时间：2020-11-12；
文档管理	符合规定	文件名称：股票一级市场投资操作规程， 发文文号：光保资发〔2023〕564号， 发文时间：2023-09-25； 文件名称：股票投资管理办法， 发文文号：光保资发〔2020〕335号， 发文时间：2020-11-12； 文件名称：股票二级市场投资操作规程， 发文文号：光保资发〔2022〕880号， 发文时间：2022-12-27； 文件名称：档案管理办法， 发文文号：光保资发〔2023〕544号， 发文时间：2023-09-13；
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：股票投资管理办法， 发文文号：光保资发〔2020〕335号， 发文时间：2020-11-12；
授权管理	符合规定	文件名称：股票投资管理办法， 发文文号：光保资发〔2020〕335号， 发文时间：2020-11-12； 文件名称：2023年度投资授权方案， 发文文号：光保资发〔2023〕285号， 发文时间：2023-05-11；
实施与控制	符合规定	文件名称：股票一级市场投资操作规程， 发文文号：光保资发〔2023〕564号， 发文时间：2023-09-25； 文件名称：股票二级市场投资操作规程， 发文文号：光保资发〔2022〕880号， 发文时间：2022-12-27；
研究管理制度：		
制度内容	评估结果	制度明细
研究管理办法	符合规定	文件名称：股票投资管理办法， 发文文号：光保资发〔2020〕335号， 发文时间：2020-11-12； 文件名称：内幕交易风险防范管理办法， 发文文号：光保资发〔2022〕390号， 发文时间：2022-06-22；
交易单元管理办法	符合规定	文件名称：交易单元管理办法， 发文文号：光保资发〔2023〕610号， 发文时间：2023-10-19；
股票池管理办法	符合规定	文件名称：股票投资管理办法， 发文文号：光保资发〔2020〕335号， 发文时间：2020-11-12； 文件名称：股票禁投池管理办法， 发文文号：光保资发〔2015〕188号， 发文时间：2015-09-14；
交易管理制度：		
制度内容	评估结果	制度明细
交易权限管理	符合规定	文件名称：股票一级市场投资操作规程， 发文文号：光保资发〔2023〕564号， 发文时间：2023-09-25； 文件名称：股票二级市场投资操作规程， 发文文号：光保资发〔2022〕880号， 发文时间：2022-12-27；
公平交易	符合规定	文件名称：集中交易管理办法， 发文文号：光保资发〔2023〕598号， 发文时间：2023-10-12；

交易监控	符合规定	文件名称：股票一级市场投资操作规程， 发文文号：光保资发〔2023〕564号， 发文时间：2023-09-25； 文件名称：股票二级市场投资操作规程， 发文文号：光保资发〔2022〕880号， 发文时间：2022-12-27； 文件名称：集中交易管理办法， 发文文号：光保资发〔2023〕598号， 发文时间：2023-10-12；
集中交易	符合规定	文件名称：股票投资管理办法， 发文文号：光保资发〔2020〕335号， 发文时间：2020-11-12； 文件名称：集中交易管理办法， 发文文号：光保资发〔2023〕598号， 发文时间：2023-10-12；

五. 系统建设

整体评估情况：			
公司股票投资技术系统包括研究分析系统、信息资讯系统、交易管理系统、资产估值和核算系统。研究分析系统采用Wind金融终端，包括资产配置模型、行业配置模型、个股估值模型、内部研究报告等功能，有效支持投资研究工作。信息资讯系统采用Wind金融终端和同花顺金融数据终端，提供全面、准确的数据、资讯信息，并获得多家券商研究服务支持。交易管理系统采用恒生投资交易管理系统软件V03.2，该系统具备授权管理、合规控制和交易功能。资产估值和核算系统采用HUND SUN资产估值与会计核算系统软件V2.6，具备安全、高效的财务核算功能，每日进行估值和核算，实现报表自动生成等。以上系统在建设、功能、使用、运行情况及投资管理影响等方面符合《保险机构股票投资管理能力标准》相关要求。			
交易管理系统：			
系统名称	恒生投资交易管理系统软件V03.2		
上线时间	2012-03-02	评估结果	符合规定
主要功能	交易管理系统采用恒生投资交易管理系统软件V03.2，具备授权管理、合规控制、交易和清算交割功能。		
信息资讯系统：			
系统名称	Wind金融终端		
上线时间	2012-03-02	评估结果	符合规定
主要功能	信息资讯系统采用Wind金融终端，提供全面、准确的数据、资讯信息，并获得多家头部券商研究服务支持。		
系统名称	同花顺金融数据终端		
上线时间	2016-11-18	评估结果	符合规定
主要功能	信息资讯系统采用同花顺金融数据终端，提供全面、准确的数据、资讯信息，并获得多家头部券商研究服务支持。		
研究分析系统：			
系统名称	Wind金融终端		
上线时间	2012-03-02	评估结果	符合规定
主要功能	研究分析系统采用Wind金融终端，包括资产配置模型、行业配置模型、个股估值模型、内部研究报告等功能，有效支持投资研究工作。		
资产估值和核算系统：			
系统名称	HUND SUN资产估值与会计核算系统软件V2.6		
上线时间	2012-03-02	评估结果	符合规定
主要功能	资产估值和核算系统采用HUND SUN资产估值与会计核算系统软件V2.6，具备安全、高效的财务核算功能，每日进行估值和核算，实现报表自动生成等。		
系统名称	恒生投资交易管理系统软件V03.2日终清算功能		
上线时间	2012-03-12	评估结果	符合规定
主要功能	恒生投资交易管理系统软件V03.2日终清算功能为公司股票业务清算系统，每日进行高效的清算交割。		

六. 风险控制

整体评估情况：

公司实施全面风险管理与嵌入式风险管理相结合的风险管理理念，从风险管理要求嵌入业务流程及风险偏好嵌入决策体系两大方面着手，持续推进风险管理体系与机制建设。公司从内部控制与风险管理层面建立了事前防范、事中控制、事后检查的风险控制体系，实行独立于投资管理的报告制度。三道防线贯穿业务开展全流程，与多层次管理架构共同构建了公司严密有效的立体式风险防范网络。

股票投资业务开展过程中，公司建立了覆盖投前、投中、投后的一系列投资管理及风险控制制度。风险管理制度层面，《风险管理办法》（光保资发〔2023〕472号）从公司层面明确了风险管理原则，风险管理组织体系，风险偏好体系传导，风险识别、评估和计量，风险应对和控制方式，风险报告机制及监督改进机制；《市场风险管理办法》（光保资发〔2020〕410号）明确了包含股票投资在内的投资市场风险评估、识别、计量及压力测试机制；《风险限额管理办法》（光保资发〔2017〕319号）规定了风险限额管理组织机构与职责，风险限额的制定、调整、实施机制，预警和超限额处理方式步骤；《2023年度投资授权方案》（光保资发〔2023〕285号）明确了覆盖股票投资的各投资角色可投额度及审批流程；《股票投资管理办法》（光保资发〔2020〕335号）、《股票投资池管理办法》（光保资发〔2023〕593号）、《股票禁投池管理办法》（光保资发〔2015〕188号）、《权益类投资止损管理办法》（光保资发〔2023〕534号）、《股票一级市场投资业务操作规程》（光保资发〔2023〕564号）和《股票二级市场投资操作规程》（光保资发〔2022〕880号）等多项制度及操作规程从股票投资池和禁投池管理、止损操作流程机制、股票投资交易执行等方面详细规定了股票投资的全流程投资管理及风险控制方式。风险管理系统方面，公司采用恒生投资交易系统V03.2的风险控制类参数模块对投资授权、投资比例和集中度等各项指标进行事前控制；采用证券风险预警系统对持仓证券进行舆情监控及风险预警提示，确保事中风险可控；采用恒生绩效评估与风险管理V3.0系统对股票仓位、集中度等指标开展包括压力测试在内的投资组合风险评估、监测及报告，并依据监测结果进行事后反馈及调整。经评估，符合《保险机构股票投资管理能力和标准》相关要求。

评估结果	符合规定
------	------

风险管理制度：

制度名称	风险管理办法、权益类投资止盈止损管理办法、风险限额管理办法、内幕交易风险防范管理办法
------	--

评估情况	公司制定了《风险管理办法》（光保资发〔2023〕472号）、《权益类投资止盈止损管理办法》（光保资发〔2015〕249号）、《风险限额管理办法》（光保资发〔2017〕319号）等风险管理制度，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条款。《风险管理办法》（光保资发〔2023〕472号）明确了风险管理的原则、组织机制、风险偏好体系，对风险识别、风险评估和计量进行了规定，同时规定了风险应对和控制、风险报告以及监督改进相关内容。《权益类投资止损管理办法》（光保资发〔2023〕534号）对账户检测、止损标准、方案制定执行、责任追究机制等内容进行了规定。《风险限额管理办法》（光保资发〔2017〕319号）主要是对业务开展过程中主要风险指标的控制上下限进行管理。《内幕交易风险防范管理办法》（光保资发〔2022〕390号）明确了内幕交易识别认定、内幕信息流转控制等内幕交易风险防范机制。符合《保险机构股票投资管理能力和标准》相关要求。
------	--

评估结果	符合规定
------	------

压力测试系统：

系统名称	HUND SUN投资绩效评估与风险管理系统软件V3.0
------	-----------------------------

上线时间	2012-03-02	评估结果	符合规定
------	------------	------	------

主要功能	压力测试系统采用HUND SUN投资绩效评估与风险管理系统软件V3.0，系统有压力测试功能，包括对股票仓位、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。
------	---

风险管理系统：

系统名称	恒生投资交易管理系统软件V03.2
------	-------------------

上线时间	2012-03-02	评估结果	符合规定
------	------------	------	------

主要功能	风险管理系统采用恒生投资交易管理系统软件V03.2，系统功能包括风险预警与合规管理系统、绩效评估系统等。
------	--

系统名称	证券风险预警系统高清版
------	-------------

上线时间	2019-01-24	评估结果	符合规定
------	------------	------	------

主要功能	风险管理系统采用证券风险预警系统高清版，系统包括风险预警与合规管理系统、绩效评估系统等。
------	--

系统名称	HUND SUN投资绩效评估与风险管理系统软件V3.0
------	-----------------------------

上线时间	2012-03-02	评估结果	符合规定
------	------------	------	------

主要功能	风险管理系统采用HUND SUN投资绩效评估与风险管理系统软件V3.0，系统功能包括风险预警与合规管理系统、绩效评估系统等。
------	--

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和标准有关事项的通知》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。