

关于合众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的 信息披露公告——年度披露

根据原中国银行保险监督管理委员会《关于优化保险机构投资管理能力监管有关事项的通知》及《保险机构股票投资管理标准》，合众资产管理股份有限公司（以下简称“公司”）开展了股票投资管理能力自评估相关工作。经公司自评估，公司股票投资管理能力建设达到《关于优化保险机构投资管理能力监管有关事项的通知》及《保险机构股票投资管理标准》要求。

公司已在中国保险资产管理业协会系统填报股票投资管理能力建设及自评估情况，并生成年度披露报告（对外披露版），现根据《关于优化保险机构投资管理能力监管有关事项的通知》规定予以披露。

附件：合众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-20240124）

合众资产管理股份有限公司

2024年1月25日

合众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-20240124）

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：	徐永伟	职务：	临时负责人
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	女	行政责任人出生年月	1969-09
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	总经理室	行政责任人入司时间	2023-11-06
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：	吴云峰	职务：	权益投资部总经理
专业责任人类别：	授权的相关资产管理部负责人	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	1981-12
专业责任人学历	博士研究生	专业责任人学位	博士
专业责任人入司时间	2021-06-07	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>公司已建立股东大会、董事会、监事会和经营管理层之间各施其责、规范运作、相互制衡的公司治理结构，符合监管规定。《合众资产管理股份有限公司关于明确股票投资管理能力和组织架构相关事宜的通知》（合众资产工作通知〔2021〕5号）明确了各业务部门及岗位人员的审批权限。公司设置了股票业务相关部门和岗位，权益投资部是公司独立的股票投资部门，其他部门包括研究部、组合管理部、集中交易部、风险管理部、信息技术部、法律合规部和运营保障部等。涉及股票投资的研究、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。涉及资产配置、投资交易、风险管理、清算核算、内部稽核等职能。股票投资业务的各相关部门和岗位职责遵循权责分明、相互独立、相互制衡和有效监督原则设立，股票投资决策、交易执行、资金清算、估值和核算、风险管理和系统支持等部门和岗位之间实行严格分离。研究、投资、交易岗位专人专岗，与其他投资业务严格分离。前、中、后台岗位严格分离，关键岗位相互制衡，重点环节双人复核。股票投资业务相关部门的设置均履行了发文程序，发文中明确了各部门职责、岗位职责、部门负责人及人员配置等。不同部门之间设有防火墙机制，股票投资人员之间也设有防火墙机制，并参照公司制定的《防范利益冲突与防火墙机制管理办法》执行。综上所述，公司在组织架构设置和投资场所方面均符合股票投资管理能力的要求。</p>			
股票投资部门：			
1			
部门名称	信息技术部		
发文时间	2021-01-25	文件名称（含文号）	《合众资产管理股份有限公司关于明确股票投资管理能力和组织架构相关事宜的通知》（合众资产工作通知〔2021〕5号）
岗位设置：	系统支持		
2			
部门名称	权益投资部		
发文时间	2021-01-25	文件名称（含文号）	《合众资产管理股份有限公司关于明确股票投资管理能力和组织架构相关事宜的通知》（合众资产工作通知〔2021〕5号）
岗位设置：	权益投资，负责人		

3			
部门名称	法律合规部		
发文时间	2021-01-25	文件名称 (含文号)	《合众资产管理股份有限公司关于明确股票投资管理能力的组织架构图相关工作的通知》(合众资产工作通知〔2021〕5号)
岗位设置:			
4			
部门名称	研究部		
发文时间	2021-01-25	文件名称 (含文号)	《合众资产管理股份有限公司关于明确股票投资管理能力的组织架构图相关工作的通知》(合众资产工作通知〔2021〕5号)
岗位设置:	研究		
5			
部门名称	组合管理部		
发文时间	2021-01-25	文件名称 (含文号)	《合众资产管理股份有限公司关于明确股票投资管理能力的组织架构图相关工作的通知》(合众资产工作通知〔2021〕5号)
岗位设置:	绩效评估		
6			
部门名称	运营保障部		
发文时间	2021-01-25	文件名称 (含文号)	《合众资产管理股份有限公司关于明确股票投资管理能力的组织架构图相关工作的通知》(合众资产工作通知〔2021〕5号)
岗位设置:	核算,清算		
7			
部门名称	集中交易部		
发文时间	2021-01-25	文件名称 (含文号)	《合众资产管理股份有限公司关于明确股票投资管理能力的组织架构图相关工作的通知》(合众资产工作通知〔2021〕5号)
岗位设置:	交易		
8			
部门名称	风险管理部		
发文时间	2021-01-25	文件名称 (含文号)	《合众资产管理股份有限公司关于明确股票投资管理能力的组织架构图相关工作的通知》(合众资产工作通知〔2021〕5号)
岗位设置:	风险管理		
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:	防火墙制度建设情况:公司制定了《防范利益冲突与防火墙机制管理办法》,规定了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不得相互兼岗。该内容符合规定。		
评估结果:	符合规定		
投资场所:	拥有足够的股票投资场所,集中交易办公区域完全隔离。《合众资产管理股份有限公司集中交易管理办法》中明确设立集中交易室,实行门禁管理,未经批准其他人不得随意进入。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,交易机设置交易密码并定期更换,以隔离投资决策与执行。		
评估结果:	符合规定		

三、专业队伍

整体评估情况：					
<p>我公司股票投资规模不超过10 亿元，股票投资专职人员（12）人，股票投资经理（3）人，研究人员（5）人（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，另配备了核算人员（1）人，绩效评估人员（1）人，系统支持人员（4）人。其中股票投资负责人具有（5）年以上股票投资管理经验或者（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。</p>					
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	李建国	系统支持	否	其他	23.10
2	张蕾	系统支持	否	其他	13.30
3	郑然	系统支持	否	其他	11.03
4	肖芳	系统支持	否	其他	16.27
5	杜若辰	权益投资	是	股票投资管理经验	4.60
6	王浩	权益投资	是	股票投资管理经验	11.64
7	吴云峰	负责人	是	股票投资管理经验	10.57
8	时应超	研究	是	行业研究经验	5.33
9	郭子煜	研究	是	行业研究经验	7.14
10	徐乐怡	研究	是	行业研究经验	0.80
11	穆婧	研究员	是	行业研究经验	4.86
12	张看	研究员	是	行业研究经验	4.21
13	陈莉	绩效评估	否	其他	4.50
14	赵二朋	核算	否	其他	11.31
15	张达帅	清算岗	是	其他	10.47
16	贾慧捷	交易	是	其他	7.44
17	刘晨宇	交易员	是	其他	12.14
18	张园园	风险管理	是	其他	5.45

四. 投资制度

整体评估情况：		
<p>在股票投资业务操作制度方面，公司制定了《合众资产管理股份有限公司股票投资管理办法》、《合众资产管理股份有限公司权益投资管理办法》等股票投资业务操作制度，制度明确了股票投资业务涉及的资产配置、投资、研究、交易、清算与结算等各环节的操作流程，覆盖股票投资交易的前、中、后台，各环节分工明确、权责清晰、紧密衔接。同时，相关制度已经过董事会或经营管理层批准，以公司正式文件形式下发并执行。</p>		
股票投资基本制度：		
制度内容	评估结果	制度明细
文档管理	符合规定	文件名称：《合众资产管理股份有限公司股票投资管理办法》， 发文文号：合众资产发（2019）138， 发文时间：2019-07-30；
清算与核算	符合规定	文件名称：《合众资产管理股份有限公司股票投资管理办法》， 发文文号：合众资产发（2019）138， 发文时间：2019-07-30；
股票投资岗位职责	符合规定	文件名称：《合众资产管理股份有限公司权益投资管理办法》， 发文文号：合众资产发（2018）217， 发文时间：2018-09-26；

业务流程	符合规定	文件名称：《合众资产管理股份有限公司股票投资管理 办法》， 发文文号：合众资产发（2019）138， 发文时间：2019-07-30；
保密及危机处理	符合规定	文件名称：《合众资产管理股份有限公司股票投资管理 办法》， 发文文号：合众资产发（2019）138， 发文时间：2019-07-30；
会议制度	符合规定	文件名称：《合众资产管理股份有限公司股票投资管理 办法》， 发文文号：合众资产发（2019）138， 发文时间：2019-07-30； 文件名称：《合众资产管理股份有限公司权益投资管 理办法》， 发文文号：合众资产发（2018）217， 发文时间：2018-09-26；
绩效考核	符合规定	文件名称：《合众资产管理股份有限公司股票投资管理 办法》， 发文文号：合众资产发（2019）138， 发文时间：2019-07-30； 文件名称：《合众资产管理股份有限公司权益投资管 理办法》， 发文文号：合众资产发（2018）217， 发文时间：2018-09-26；
操作规程	符合规定	文件名称：《合众资产管理股份有限公司股票投资管理 办法》， 发文文号：合众资产发（2019）138， 发文时间：2019-07-30；
信息系统管理	符合规定	文件名称：《合众资产管理股份有限公司股票投资管理 办法》， 发文文号：合众资产发（2019）138， 发文时间：2019-07-30；
决策管理制度：		
制度内容	评估结果	制度明细
实施与控制	符合规定	文件名称：《合众资产管理股份有限公司投资管理委 员会工作管理办法》， 发文文号：合众资产发（2022）266， 发文时间：2022-12-19； 文件名称：《合众资产管理股份有限公司标准化投资 专项委员会议事规则》， 发文文号：合众资产发（2022）274， 发文时间：2022-12-21；
授权管理	符合规定	文件名称：《合众资产管理股份有限公司投资管理委 员会工作管理办法》， 发文文号：合众资产发（2022）266， 发文时间：2022-12-19； 文件名称：《合众资产管理股份有限公司标准化投资 专项委员会议事规则》， 发文文号：合众资产发（2022）274， 发文时间：2022-12-21； 文件名称：《合众资产管理股份有限公司权益投资管 理办法》， 发文文号：合众资产发（2018）217， 发文时间：2018-09-26； 文件名称：《合众资产管理股份有限公司投资授权管 理办法》， 发文文号：合众资产发（2023）130， 发文时间：2023-06-16；
投资决策体系	符合规定	文件名称：《合众资产管理股份有限公司股票投资管理 办法》， 发文文号：合众资产发（2019）138， 发文时间：2019-07-30； 文件名称：《合众资产管理股份有限公司投资管理委 员会工作管理办法》， 发文文号：合众资产发（2022）266， 发文时间：2022-12-19； 文件名称：《合众资产管理股份有限公司标准化投资 专项委员会议事规则》， 发文文号：合众资产发（2022）274， 发文时间：2022-12-21；
研究管理制度：		

制度内容	评估结果	制度明细
交易单元管理办法	符合规定	文件名称：《合众资产管理股份有限公司交易单元管理办法》， 发文文号：合众资产发（2021）402， 发文时间：2021-12-29；
股票池管理办法	符合规定	文件名称：《合众资产管理股份有限公司股票池管理办法》， 发文文号：合众资产发（2021）219， 发文时间：2021-06-30；
研究管理办法	符合规定	文件名称：《合众资产管理股份有限公司股票投资管理 办法》， 发文文号：合众资产发（2019）138， 发文时间：2019-07-30； 文件名称：《合众资产管理股份有限公司投资研究管 理办法》， 发文文号：合众资产发（2018）217， 发文时间：2018-09-26； 文件名称：《合众资产管理股份有限公司研究部研究 工作业务实施细则》， 发文文号：合众资产发（2018）217， 发文时间：2018-09-26；
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：《合众资产管理股份有限公司集中交易管 理办法》， 发文文号：合众资产发（2021）372， 发文时间：2021-12-06；
公平交易	符合规定	文件名称：《合众资产管理股份有限公司公平交易管 理办法》， 发文文号：合众资产发（2018）238， 发文时间：2018-10-23；
集中交易	符合规定	文件名称：《合众资产管理股份有限公司集中交易管 理办法》， 发文文号：合众资产发（2021）372， 发文时间：2021-12-06；
交易监控	符合规定	文件名称：《合众资产管理股份有限公司公平交易管 理办法》， 发文文号：合众资产发（2018）238， 发文时间：2018-10-23；

五. 系统建设

整体评估情况：			
公司在股票投资业务系统建设方面符合能力标准的基本要求。公司采购了行业头部供应商恒生电子的成熟产品，包括投资交易系统、研报系统和资产估值与会计核算系统，系统建设覆盖了股票投资业务全流程；采用万得、大智慧、同花顺多种资讯服务系统获取不同资讯信息，全面支持股票投资业务。核心系统在网络、存储、数据库和应用软件等层面进行了集群部署和热备份，保障系统和数据的高可用性，公司建立了灾备系统，极大程度保障核心业务的连续性和可靠性。公司制定了《合众资产管理股份有限公司投资系统重大突发事件应急预案》（合众资产发〔2023〕134号）相关制度，规范了核心系统的应急流程。			
交易管理系统：			
系统名称	恒生投资交易管理系统032		
上线时间	2013-01-01	评估结果	符合规定
主要功能	系统高效稳定，通过直连交易所报盘和交易网关满足股票交易功能、通过分组控制、授权管理机制实现投资经理授权管理、职级审批管理，风险控制模块实现合规要求的各类风险控制和风险预警。		
信息资讯系统：			
系统名称	万得资讯、大智慧资讯、同花顺资讯		
上线时间	2016-01-01	评估结果	符合规定
主要功能	包含万得资讯、大智慧资讯、同花顺资讯等多家资讯服务系统商获取市场资讯信息，从不同渠道获得券商研究服务支持		
研究分析系统：			
系统名称	恒生研报系统		
上线时间	2021-01-27	评估结果	符合规定

主要功能	研报系统不仅满足内部研究报告功能，且包含资产配置模型、行业配置模型、个股估值模型、内部研报系统等		
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软件(企业版)V2.6		
上线时间	2016-01-01	评估结果	符合规定
主要功能	系统高效稳定，满足会计准则估值核算要求，支持股票业务相关会计科目、交易保证金、交易结算账户、业务种类等设置、股票交易结算数据导入、交易清算和估值核算等功能，完成每日会计确认、清算交割、财务核算，实现报表自动生成。		

六. 风险控制

整体评估情况：			
公司将股票投资纳入全面风险管理，制定了《合众资产管理股份有限公司风险管理制度》、《合众资产管理股份有限公司内部控制制度》、《合众资产管理股份有限公司风险管理策略实施细则》、《合众资产管理股份有限公司股票禁投池管理流程书》。建立了事前、事中和事后独立于投资管理的风险控制、监控机制，明确了风险监测指标和风险预警机制，并将投资授权、风险限额、持仓限额、禁投股票、持仓集中度、行业集中度等风险指标固化到投资交易系统中，建立了异常行为和公平交易的自动监控和预警机制。针对应急管理预案方面，公司制定了统一的《合众资产管理股份有限公司重大突发事件和应急管理制度》、《合众资产管理股份有限公司金融市场突发剧烈波动应急预案》和《合众资产管理股份有限公司投资系统重大突发事件应急预案》等，公司在管理制度、业务流程、信息系统、应急机制和管理预案等方面形成了全面动态风险管理机制。			
评估结果	符合规定		
风险管理制度：			
制度名称	《合众资产管理股份有限公司风险管理制度》（合众资产发〔2023〕114号）；《合众资产管理股份有限公司内部控制制度》（合众资产发〔2019〕20号）；《合众资产管理股份有限公司风险管理策略实施细则》（合众资产发〔2018〕223号）；《合众资产管理股份有限公司股票禁投池管理流程书》（合众资产发〔2022〕237号）		
评估情况	公司制定了《合众资产管理股份有限公司风险管理制度》、《合众资产管理股份有限公司风险管理策略实施细则》，明确了风险管理的原则和风险计量的定性定量方法，实行独立于投资管理的报告制度。对风险点的识别和报告建立了完整的业务流程预警体系，具体的包括权益市场系统性风险、持仓集中度、行业集中度、地区集中度等风险指标的监测和预警，并依据风险异常情况启用相应的报告流程，业务部门收到风险提示函，在规定的时间内进行反馈和调整。公司制定了《合众资产管理股份有限公司内部控制制度》，对内控环境、流程、稽核及责任追究机制作出了相应规定、进行合规管理；同时结合绩效评估系统，制定年度员工绩效考核方案，未将权益交易盈亏与前台业务人员绩效工资简单直接挂钩，而是与前台业务人员绩效考核结果和部门绩效考核评估结果密切相关，前台业务人员绩效考核依据投资业绩、风险管理、研究支持、制度和团队建设、风控合规以及能力、行为和态度等各项KPI指标进行综合评分；后台及风险管理部的人员报酬完全独立于交易盈亏情况。		
评估结果	符合规定		
压力测试系统：			
系统名称	恒生中台绩效评估与风险管理系统		
上线时间	2012-05-14	评估结果	符合规定
主要功能	系统高效稳定，可以实现对股票仓位、行业集中度、个股集中度进行压力测试，评估投资组合在不同压力测试情景下产生的影响，并制定了相应的应急预案。		
风险管理系统：			
系统名称	恒生O32投资管理系统，恒生中台绩效评估与风险管理系统		
上线时间	2012-05-14	评估结果	符合规定
主要功能	系统高效稳定，支持交易投资授权管理、风险预警管理、风险阈值限额管理、业绩分析和绩效归因、持仓集中度、在险价值计算和系统性风险监测、合规管理、绩效评估等，满足股票投资管理要求。		

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。