

荷全保险资产管理有限公司股票投资管理能力建设及自评估情况（首次披露-20260122）



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：	梁建刚	职务：	总经理
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	1971-04
行政责任人学历	本科	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	2025-05-27
行政责任人专业资质	具备金融领域20年以上从业经历	行政责任人专业技术职务	高级会计师
专业责任人：	许艺敏	职务：	权益投资部负责人
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	女	专业责任人出生年月	1978-04
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	2025-11-05	专业责任人所在部门	权益投资部
专业责任人专业资质	具备相关投资领域20年以上从业经历，特许金融分析师	专业责任人专业技术职务	无

二、组织架构

整体评估情况：			
公司已建立职责明确、分工合理的股票投资组织架构。公司已下发正式文件，设立了独立的权益投资部、交易部、风险管理部、运营管理部、信息科技部等部门，分别设置了股票研究、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。投资、研究、交易实行专人专岗，与其他投资业务严格分离。权益投资部根据账户或组合性质及管理资金规模等，配备独立的股票投资经理。公司通过落实物理隔离、业务职能隔离、人员隔离、信息系统隔离等方式建立了股票投资人员之间的防火墙机制，包括股票投资经理与基金清算人员、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、清算人员与核算人员相互独立。公司设立了交易部，建立了独立的、带有门禁系统的集中交易办公区域。经评估，符合《保险机构股票投资管理标准》要求。			
股票投资部门：			
1			
部门名称	交易部		
发文时间	2026-01-08	文件名称（含文号）	《关于明确信用风险管理能力、股票投资管理能力建设有关的组织架构、岗位职责及人员配置的通知》（荷全资管[2026] 011号）
岗位设置：	交易员		
2			
部门名称	信息科技部		
发文时间	2026-01-08	文件名称（含文号）	《关于明确信用风险管理能力、股票投资管理能力建设有关的组织架构、岗位职责及人员配置的通知》（荷全资管[2026] 011号）
岗位设置：	系统支持岗		

3			
部门名称	权益投资部		
发文时间	2026-01-08	文件名称(含文号)	《关于明确信用风险管理能力、股票投资管理能力建设有关的组织架构、岗位职责及人员配置的通知》(荷全资管[2026]011号)
岗位设置:	研究员岗,股票投资经理岗,部门负责人岗		
4			
部门名称	运营管理部		
发文时间	2026-01-08	文件名称(含文号)	《关于明确信用风险管理能力、股票投资管理能力建设有关的组织架构、岗位职责及人员配置的通知》(荷全资管[2026]011号)
岗位设置:	估值核算岗,清算岗		
5			
部门名称	风险管理部		
发文时间	2026-01-08	文件名称(含文号)	《关于明确信用风险管理能力、股票投资管理能力建设有关的组织架构、岗位职责及人员配置的通知》(荷全资管[2026]011号)
岗位设置:	绩效评估岗,资本市场风控岗		
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>公司权益投资业务相关部门设置遵循科学合理、有效运作的原则,在相关部门之间、岗位之间设置必要的防火墙,实行投资决策与投资执行、投资决策与风险管理、绩效评估严格分离的组织架构。公司制定了《荷全保险资产管理有限公司资产管理业务防火墙管理办法》,第五条中明确规定了对不同类型的业务建立防火墙,防范利益冲突和风险传导,落实相应的物理隔离、业务职能隔离、人员隔离、资金与账户隔离、信息系统隔离等内部控制措施,具体包括:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1.物理隔离:公司设置集中交易室,各部门都具备独立的办公场所,确保有效的岗位和办公区域隔离。 2.业务职能隔离:公司前中后台部门和岗位之间相互独立,各部门报告线路互相独立。 3.人员隔离:公司在存在利益冲突的岗位均安排独立的人员,不得兼任。满足投资决策人员与交易执行人员、风险管理人员、法律合规人员、信用评估人员、组合管理人员、清算核算人员等相互隔离;股票投资人员与基金投资人员相互隔离;信用评估人员与投资人员、风险管理人员相互隔离。 4.资金与账户隔离:不同委托人、同一委托人不同来源性质的资金应分账户管理,独立运作,单独核算。 5.信息系统隔离:公司各业务系统通过系统权限设置也能够实现不同人员之间的隔离。 <p>经评估,公司防火墙机制建设情况满足能力标准要求</p>		
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,其中交易室具备封闭、独立的办公场所和办公设备,配备独立的门禁、安全防护等措施,确保集中交易办公区域完全隔离。经评估,公司股票投资场所符合能力标准要求。		
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超过10亿元,专职人员合计17人,其中股票投资经理3人,研究人员6人(主要研究人员2人),交易人员3人,风控人员1人,清算人员1人,核算人员1人,绩效评估人员1人,系统支持人员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,投资经理具有3年以上股票投资管理经验,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。经评估,符合《保险机构股票投资管理能力标准》要求。</p> <p>专业队伍人员基本信息:</p>
---------	--

序号	姓名	岗位	是否为能力标准要求的人员	相关经验类型	相关经验年限
1	李欢	交易员	是	其他	14.96
2	翁康龄	交易员	是	其他	5.05
3	包涵丹	交易员	是	其他	2.40
4	庄晓杰	系统支持岗	是	其他	9.53
5	刘逸夫依马尼维尔	研究员岗	是	行业研究经验	0.26
6	陈恺豪	研究员岗	是	行业研究经验	5.06
7	柳云凯	研究员岗	是	行业研究经验	4.06
8	王梦婷	研究员岗	是	行业研究经验	1.33
9	尹奕勤	研究员岗	是	行业研究经验	7.76
10	臧劲哲	研究员岗	是	行业研究经验	3.81
11	任清莲	股票投资经理岗	是	股票投资管理经验	5.05
12	李浚哲	股票投资经理岗	是	股票投资管理经验	4.81
13	许艺敏	部门负责人岗	是	股票投资管理经验	20.30
14	刘鹏	估值核算岗	是	其他	9.53
15	霍胜强	清算岗	是	其他	27.29
16	陈亦柳	绩效评估岗	是	其他	9.56
17	许晓辉	资本市场风控岗	是	其他	15.54

四. 投资制度

整体评估情况：		
<p>公司建立了完善、有效的股票投资管理制度，制定了《荷全保险资产管理有限公司股票投资管理制度》、《关于明确信用风险管理能力、股票投资管理能力的组织架构、岗位职责及人员配置的通知》等股票投资管理基本制度，明确了公司股票投资管理业务的操作规程、会议制度、文档管理制度、绩效考核、清算与核算、信息系统管理、保密及危机处理等相关内容。公司建立了股票投资决策管理制度，通过《荷全保险资产管理有限公司股票投资决策管理办法》、《荷全保险资产管理有限公司股票研究管理制度》、《荷全保险资产管理有限公司股票池管理细则》、《荷全保险资产管理有限公司研究服务评价等内容。公司建立了股票交易管理制度，通过了《荷全保险资产管理有限公司交易管理办法》、《荷全保险资产管理有限公司公平交易、交易权限管理和交易监控等管理制度》。公司建立了《荷全保险资产管理有限公司投资绩效评估管理办法》，明确了股票投资业务绩效评估管理要求。上述所有制度均经公司经营管理委员会批准，以正式文件形式下发执行。经评估，符合《保险机构股票投资管理标准》要求。</p>		
股票投资基本制度：		
制度内容	评估结果	制度明细
股票投资岗位职责	符合规定	文件名称：《关于明确信用风险管理能力、股票投资管理能力的组织架构、岗位职责及人员配置的通知》， 发文文号：荷全资管[2026]011号， 发文时间：2026-01-08；
业务流程	符合规定	文件名称：《荷全保险资产管理有限公司股票投资管理制度》， 发文文号：荷全资管制度[2026]021号， 发文时间：2026-01-08；
操作规程	符合规定	文件名称：《荷全保险资产管理有限公司股票投资管理制度》， 发文文号：荷全资管制度[2026]021号， 发文时间：2026-01-08；
会议制度	符合规定	文件名称：《荷全保险资产管理有限公司股票投资管理制度》， 发文文号：荷全资管制度[2026]021号， 发文时间：2026-01-08；

文档管理	符合规定	文件名称：《荷全保险资产管理有限公司股票投资管理制度》， 发文文号：荷全资管制度[2026]021号， 发文时间：2026-01-08；
绩效考核	符合规定	文件名称：《荷全保险资产管理有限公司投资绩效评估管理细则》， 发文文号：荷全资管制度[2026]033号， 发文时间：2026-01-08；
清算与核算	符合规定	文件名称：《荷全保险资产管理有限公司资产管理业务估值与会计核算管理办法》， 发文文号：荷全资管制度[2026]027号， 发文时间：2026-01-08； 文件名称：《荷全保险资产管理有限公司投资结算业务管理办法》， 发文文号：荷全资管制度[2026]028号， 发文时间：2026-01-08；
信息系统管理	符合规定	文件名称：《荷全保险资产管理有限公司信息技术管理办法》， 发文文号：荷全资管制度[2026]029号， 发文时间：2026-01-08；
保密及危机处理	符合规定	文件名称：《荷全保险资产管理有限公司股票投资管理制度》， 发文文号：荷全资管制度[2026]021号， 发文时间：2026-01-08； 文件名称：《荷全保险资产管理有限公司重大投资风险事件应急处置办法》， 发文文号：荷全资管制度[2026]036号， 发文时间：2026-01-08； 文件名称：《荷全保险资产管理有限公司资产管理业务防火墙管理办法》， 发文文号：荷全资管制度[2026]035号， 发文时间：2026-01-08；
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：《荷全保险资产管理有限公司股票投资决策管理办法》， 发文文号：荷全资管制度[2026]022号， 发文时间：2026-01-08；
授权管理	符合规定	文件名称：《荷全保险资产管理有限公司投资授权管理办法》， 发文文号：荷全资管制度[2026]031号， 发文时间：2026-01-08；
实施与控制	符合规定	文件名称：《荷全保险资产管理有限公司股票投资决策管理办法》， 发文文号：荷全资管制度[2026]022号， 发文时间：2026-01-08； 文件名称：《荷全保险资产管理有限公司投资授权管理办法》， 发文文号：荷全资管制度[2026]031号， 发文时间：2026-01-08；
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：《荷全保险资产管理有限公司研究管理办法》， 发文文号：荷全资管制度[2026]023号， 发文时间：2026-01-08；
股票池管理办法	符合规定	文件名称：《荷全保险资产管理有限公司股票池管理细则》， 发文文号：荷全资管制度[2026]024号， 发文时间：2026-01-08；
交易单元管理办法	符合规定	文件名称：《荷全保险资产管理有限公司证券交易单元租用管理细则》， 发文文号：荷全资管制度[2026]025号， 发文时间：2026-01-08；
交易管理制度：		
制度内容	评估结果	制度明细

集中交易	符合规定	文件名称：《荷全保险资产管理有限公司交易管理办法》， 发文文号：荷全资管制度[2026]026号， 发文时间：2026-01-08；
交易权限管理	符合规定	文件名称：《荷全保险资产管理有限公司交易管理办法》， 发文文号：荷全资管制度[2026]026号， 发文时间：2026-01-08；
公平交易	符合规定	文件名称：《荷全保险资产管理有限公司交易管理办法》， 发文文号：荷全资管制度[2026]026号， 发文时间：2026-01-08； 文件名称：《荷全保险资产管理有限公司公平交易管理办法》， 发文文号：荷全资管制度[2026]034号， 发文时间：2026-01-08；
交易监控	符合规定	文件名称：《荷全保险资产管理有限公司交易管理办法》， 发文文号：荷全资管制度[2026]026号， 发文时间：2026-01-08；

五. 系统建设

整体评估情况：			
<p>公司投研分析系统采购万得Wind金融终端（WFT）系统（以下简称“万得”）进行建设，包含资产配置模型、行业研究模型、个股估值模型、内部研究报告等系统功能；交易管理系统采购恒生投资交易管理系统软件V03.2（以下简称“投资交易系统”），包含授权管理、合规控制及交易功能，可满足投资需求；信息资讯系统采购万得、同花顺金融终端系统（以下简称“同花顺”）和财汇金融大数据终端（以下简称“财汇”）系统进行建设，包含交易行情信息及券种的各类信息，可满足投研需求；资产估值核算系统采购恒生资产估值与会计核算系统（以下简称“估值核算系统”），功能包括对股票等资金交易的清算、做账功能，集成交易所、投资交易及后台管理系统接口文件支持，支持股票、债券、基金、回购等标准业务的清算，并由清算结果自动生成财务凭证，最终生成各类报表完成资产的估值核算，以上系统目前全部运行良好。经评估，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	恒生投资交易管理系统软件V03.2		
上线时间	2025-11-17	评估结果	符合规定
主要功能	<p>交易管理系统采购恒生投资交易管理系统软件V03.2，在授权管理方面采用角色进行权限管理，严格区分投资经理、交易员、运营人员等，避免出现越权操作；在合规控制方面严格根据法律法规、监管政策和公司规定等设置相应的风控条目，避免触发风险事件；在交易方面，系统支持手动交易、算法交易、篮子交易等多种交易方式，满足不同投资策略的需求；也可根据市场情况和交易规则，智能选择最优的交易路径，提高交易执行效率，降低交易成本；此外，投资交易系统支持交易指令的创建、修改、撤销等操作，确保交易指令的准确性和及时性。经评估，符合《保险机构股票投资管理标准》的规定。</p>		
信息资讯系统：			
系统名称	同花顺金融终端系统		
上线时间	2025-11-17	评估结果	符合规定
主要功能	<p>信息资讯系统采购同花顺金融终端系统研究资讯系统进行建设，包含交易行情信息及券种的各类信息，可满足投研需求。公司与中信证券、中金公司等券商建立合作，获得多家券商研究服务支持。经评估，符合《保险机构股票投资管理标准》的规定。</p>		
系统名称	财汇金融大数据终端		
上线时间	2025-11-17	评估结果	符合规定
主要功能	<p>信息资讯系统采购财汇金融大数据终端研究资讯系统进行建设，包含交易行情信息及券种的各类信息，可满足投研需求。经评估，符合《保险机构股票投资管理标准》的规定。</p>		
研究分析系统：			
系统名称	万得Wind金融终端（WFT）系统		
上线时间	2025-11-17	评估结果	符合规定

主要功能	恒生绩效评估与风险管理系统功能包括事后限额监控、多维度持仓分析、收益分解、绩效归因分析等功能。该系统中心限额监控模块主要针对投资组合要求的法律、法规以及公司内部规定进行合规监控与限额管理，每日生成投资组合限额监控结果，提示违规、预警信息。组合绩效模块主要从收益分析、业绩归因、风险调整收益、业绩持续性以及多组合横向对比等多个方面对组合的绩效作出量化分析。经评估，符合《保险机构股票投资管理标准》的规定。
------	---

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。

我承诺对本公告披露的及时性、内容的真实性、完整性负责。我确认，应当至少在首次开展本投资管理业务前10日已完成并公开披露本投资管理能力建设及自评估情况。

