

新华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-20220126）

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:	张弛	职务:	执行董事、总经理、审计负责人
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:	男	行政责任人出生年月:	1965-03
行政责任人学历:	博士研究生	行政责任人学位:	博士
行政责任人所在部门:	执行董事、总经理、审计负责人	行政责任人入司时间:	2011-03-01
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:	刘雨	职务:	副总经理、权益投资总监
专业责任人类别:	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:	1974-09
专业责任人学历:	硕士研究生	专业责任人学位:	硕士
专业责任人入司时间:	2005-01-28	专业责任人所在部门:	副总经理、权益投资总监
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:

公司股票投资管理能力和组织架构符合监管要求。公司的股票投资相关部门设置、投资经理配备、防火墙机制和投资场所等方面均符合监管规定。公司建立了职责明确、分工合理的股票投资组织架构。公司下发《新华资产管理股份有限公司2021年度公司组织架构设置方案（修订版）》（新资人〔2021〕27号），设立了独立的股票投资部门，公司设立了包括股票投资部、研究部、集中交易部、合规与风控部、组合管理部、运营管理部、信息管理部等部门，并明确各部门职责。公司下发《新华资产管理股份有限公司各项投资管理能力和岗位设置及人员配置方案》（新资人〔2022〕3号），配置了股票投资业务团队，由股票投资部负责人郑研担任股票投资业务团队负责人。公司设置了股票投资业务的研究、投资、交易、风险控制、绩效评估、清算核算、系统支持等相关岗位，并对岗位职责、部门负责人、人员配置情况进行了明确。公司研究、投资、交易岗位实行专人专岗，与其他投资业务严格分离。根据公司的账户/组合性质和管理资金规模，公司配备了独立的股票投资经理。公司下发《新华资产管理股份有限公司反舞弊措施纲要》（新资风〔2021〕2号），第二章组织架构与岗位设置中建立了防火墙机制。公司拥有足够的股票投资场所，公司下发《新华资产管理股份有限公司集中交易管理办法》（新资交〔2020〕1号），第五章第十八条要求集中交易部办公区域完全隔离，独立并设置门禁。

股票投资部门:

1			
部门名称	信息管理部		
发文时间	2021-11-30	文件名称（含文号）	《新华资产管理股份有限公司2021年度公司组织架构设置方案（修订版）》（新资人〔2021〕27号）
岗位设置:	系统支持岗		
2			
部门名称	合规与风控部		
发文时间	2021-11-30	文件名称（含文号）	《新华资产管理股份有限公司2021年度公司组织架构设置方案（修订版）》（新资人〔2021〕27号）
岗位设置:	风险控制岗		

3			
部门名称	研究部		
发文时间	2021-11-30	文件名称 (含文号)	《新华资产管理股份有限公司2021年度公司组织架构设置方案 (修订版)》 (新资人 (2021) 27号)
岗位设置:	研究岗, 部门负责人		
4			
部门名称	组合管理部		
发文时间	2021-11-30	文件名称 (含文号)	《新华资产管理股份有限公司2021年度公司组织架构设置方案 (修订版)》 (新资人 (2021) 27号)
岗位设置:	绩效评估岗		
5			
部门名称	股票投资部		
发文时间	2021-11-30	文件名称 (含文号)	《新华资产管理股份有限公司2021年度公司组织架构设置方案 (修订版)》 (新资人 (2021) 27号)
岗位设置:	投资岗, 部门负责人		
6			
部门名称	运营管理部		
发文时间	2021-11-30	文件名称 (含文号)	《新华资产管理股份有限公司2021年度公司组织架构设置方案 (修订版)》 (新资人 (2021) 27号)
岗位设置:	核算岗, 清算岗		
7			
部门名称	集中交易部		
发文时间	2021-11-30	文件名称 (含文号)	《新华资产管理股份有限公司2021年度公司组织架构设置方案 (修订版)》 (新资人 (2021) 27号)
岗位设置:	交易岗, 部门负责人		
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:	公司下发《新华资产管理股份有限公司反舞弊措施纲要》(新资风 (2021) 2号), 其中第二章组织结构与岗位设置中建立了防火墙机制, 第十二条规定了股票投资业务相关岗位应分离, 包括但不限于: (一) 股票投资经理与基金投资经理之间; (二) 投资经理与交易人员之间; (三) 投资管理人员与风险控制、绩效评估人员之间; (四) 清算人员与核算人员之间; (五) 投资前台与中台风控、组合管理以及后台清算、核算人员。		
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, 营业场所位于北京市朝阳区建国门外大街甲12号新华保险大厦19层及18层1801-1804, 1807、1808单元。公司下发《新华资产管理股份有限公司集中交易管理办法》(新资交 (2020) 1号), 第五章第十八条要求集中交易部办公区域完全隔离并且独立。公司对集中交易单独设置部门, 且集中交易办公区域出入有门禁。		
评估结果:	符合规定		

三、专业队伍

整体评估情况:

公司股票投资管理专业能力专业队伍符合监管规定。公司配备了熟悉股票投资业务、具备股票投资能力的专业人员。公司下发《新华资产管理股份有限公司各项投资管理能力和岗位设置及人员配置方案》（新资人〔2022〕3号），配置了股票投资业务团队，由股票投资部负责人郑研研担任股票投资业务团队负责人。公司股票投资规模超过10亿元，专职人员21人，其中投资经理、研究人员和交易人员等主要业务人员17人。专业人员数量、经验、资质能力等均符合监管要求。股票投资经理5人，研究人员8人，研究人员均为主要研究人员，交易人员4人，风控人员2人，清算人员2人。另外还有核算人员2人，绩效评估人员3人，系统支持人员3人。其中股票投资团队负责人具有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资质，投资经理均具有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与市场经验。主要研究人员均从事行业研究3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	孙双先	系统支持岗	否	其他	14.64
2	王瑞涵	系统支持岗	否	其他	12.05
3	杨雪	系统支持岗	否	其他	11.48
4	姬繁琼	风险控制岗	是	其他	7.88
5	李琳娜	风险控制岗	是	其他	3.70
6	李杰	研究岗	是	行业研究经验	7.39
7	耿金文	研究岗	是	行业研究经验	3.53
8	李东正	研究岗	是	行业研究经验	4.26
9	张滢潭	研究岗	是	行业研究经验	6.37
10	韩笑	研究岗	是	行业研究经验	5.15
11	雷凯	研究岗	是	行业研究经验	5.72
12	陈振华	研究岗	是	行业研究经验	6.45
13	刘磊	部门负责人	是	行业研究经验	18.37
14	聂芳敏	绩效评估岗	否	其他	12.39
15	周明月	绩效评估岗	否	其他	5.46
16	刘达	绩效评估岗	否	其他	5.55
17	林建臻	投资岗	是	股票投资管理经验	11.76
18	高丰臣	投资岗	是	股票投资管理经验	10.47
19	舒良	投资岗	是	股票投资管理经验	5.47
20	邓小钊	投资岗	是	股票投资管理经验	4.05
21	郑研研	部门负责人	是	股票投资管理经验	10.89
22	李想	核算岗	否	其他	7.22
23	仇月星	核算岗	否	其他	6.89
24	徐亚南	清算岗	是	其他	18.97
25	韩志昕	清算岗	是	其他	19.97
26	叶芳海	交易岗	是	金融证券投资从业经验	13.39
27	赵轶男	交易岗	是	金融证券投资从业经验	6.55
28	王博	交易岗	是	金融证券投资从业经验	5.64
29	张若朴	部门负责人	是	金融证券投资从业经验	24.56

四. 投资制度

整体评估情况：

公司股票投资管理能力和相关管理制度、体系建设均符合监管规定。公司建立了完善有效的股票投资管理制度，相关制度均经过经营管理层批准，以公司正式文件形式下发执行。公司股票基本制度中完整包含了股票投资及岗位职责、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、保密及危机处理相关内容。公司下发了《新华资产管理股份有限公司证券投资决策委员会议事规则》（新资组〔2021〕3号）、《新华资产管理股份有限公司境内投资授权管理办法》（新资组〔2022〕1号）、《新华资产管理股份有限公司受托境内投资限制管理办法》（新资风〔2021〕20号），包括了投资决策体系、授权管理、实施与控制等内容，组成了决策管理制度体系。公司下发《新华资产管理股份有限公司研究管理办法》（新资研〔2021〕1号），包括了投资决策、行业和个人股研究、投资报告制度、调研管理制度等内容。公司下发《新华资产管理股份有限公司股票库管理办法》（新资研〔2020〕1号）和《新华资产管理股份有限公司港股通股票库管理（暂行）办法》（新资研〔2018〕2号），规范了股票池产生、调整与维护、对投资决策的实施影响以及对投资操作的制约。公司下发《新华资产管理股份有限公司券商招标及租用交易单元管理细则》（新资研〔2018〕3号），明确了交易单元的管理，包括选择标准、研究服务质量评价等方面。公司下发《新华资产管理股份有限公司集中交易管理办法》（新资交〔2020〕1号）、《新华资产管理股份有限公司公平交易管理办法》（新资风〔2018〕17号）、《新华资产管理股份有限公司异常交易监察与处理细则》（新资风〔2020〕9号），对交易管理进行了约束，包含了集中交易、公平交易、交易权限管理和交易监控等方面。

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：《新华资产管理股份有限公司2021年度公司组织架构设置方案（修订版）》， 发文文号：新资人〔2021〕27号， 发文时间：2021-11-30； 文件名称：《新华资产管理股份有限公司各项投资管理能力和岗位设置及人员配置方案》， 发文文号：新资人〔2022〕3号， 发文时间：2022-01-25；
业务流程	符合规定	文件名称：《新华资产管理股份有限公司2016年度公司层流程汇编》， 发文文号：新资风〔2017〕6号， 发文时间：2017-03-21； 文件名称：《新华资产管理股份有限公司2019年度公司层流程汇编》， 发文文号：新资风〔2020〕4号， 发文时间：2020-03-18； 文件名称：《新华资产管理股份有限公司2020年度公司层流程汇编》， 发文文号：新资风〔2021〕4号， 发文时间：2021-02-03； 文件名称：《新华资产管理股份有限公司2017年度公司层流程汇编》， 发文文号：新资风〔2018〕1号， 发文时间：2018-03-20；
绩效考核	符合规定	文件名称：《新华资产管理股份有限公司员工绩效考核管理办法（试行）》， 发文文号：新资人〔2013〕4号， 发文时间：2013-03-15；
信息系统管理	符合规定	文件名称：《新华资产管理股份有限公司信息技术管理办法》， 发文文号：新资信〔2020〕3号， 发文时间：2020-12-21； 文件名称：《新华资产管理股份有限公司股票投资管理办法》， 发文文号：新资股〔2020〕1号， 发文时间：2020-12-30；
文档管理	符合规定	文件名称：《新华资产管理股份有限公司股票投资管理办法》， 发文文号：新资股〔2020〕1号， 发文时间：2020-12-30； 文件名称：《新华资产管理股份有限公司档案管理暂行办法》， 发文文号：新资人〔2019〕10号， 发文时间：2019-08-14；

保密及危机处理	符合规定	<p>文件名称：《新华资产管理股份有限公司保密工作暂行规定》， 发文文号：新资风（2011）6号， 发文时间：2011-06-10； 文件名称：《新华资产管理股份有限公司内幕交易防控管理细则》， 发文文号：新资风（2020）15号， 发文时间：2020-05-28； 文件名称：《新华资产管理股份有限公司异常交易监察与处理细则》， 发文文号：新资风（2020）9号， 发文时间：2020-04-17； 文件名称：《新华资产管理股份有限公司交易资金前端控制突发事件应急预案》， 发文文号：新资风（2020）7号， 发文时间：2020-03-19；</p>
操作规程	符合规定	<p>文件名称：《新华资产管理股份有限公司2016年度公司层流程汇编》， 发文文号：新资风（2017）6号， 发文时间：2017-03-21； 文件名称：《新华资产管理股份有限公司2019年度公司层流程汇编》， 发文文号：新资风（2020）4号， 发文时间：2020-03-18； 文件名称：《新华资产管理股份有限公司2020年度公司层流程汇编》， 发文文号：新资风（2021）4号， 发文时间：2021-02-03； 文件名称：《新华资产管理股份有限公司2017年度公司层流程汇编》， 发文文号：新资风（2018）1号， 发文时间：2018-03-20；</p>
清算与核算	符合规定	<p>文件名称：《新华资产管理股份有限公司保险资产管理产品估值办法（试行）》， 发文文号：新资运（2021）5号， 发文时间：2021-08-03； 文件名称：《新华资产管理股份有限公司投资结算管理办法》， 发文文号：新资运（2016）3号， 发文时间：2016-10-10；</p>
会议制度	符合规定	<p>文件名称：《新华资产管理股份有限公司股票投资管理暂行办法》， 发文文号：新资股（2020）1号， 发文时间：2020-12-30；</p>
决策管理制度：		
制度内容	评估结果	制度明细
授权管理	符合规定	<p>文件名称：《新华资产管理股份有限公司境内投资授权管理办法》， 发文文号：新资组（2022）1号， 发文时间：2022-01-18；</p>
实施与控制	符合规定	<p>文件名称：《新华资产管理股份有限公司股票投资管理暂行办法》， 发文文号：新资股（2020）1号， 发文时间：2020-12-30； 文件名称：《新华资产管理股份有限公司受托境内投资限制管理办法》， 发文文号：新资风（2021）20号， 发文时间：2021-09-10；</p>
投资决策体系	符合规定	<p>文件名称：《新华资产管理股份有限公司证券投资决策委员会议事规则》， 发文文号：新资组（2021）3号， 发文时间：2021-06-08；</p>
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	<p>文件名称：《新华资产管理股份有限公司券商招标及租用交易单元管理细则》， 发文文号：新资研（2018）3号， 发文时间：2018-02-05；</p>

股票池管理办法	符合规定	文件名称：《新华资产管理股份有限公司股票库管理办法》， 发文文号：新资研（2020）1号， 发文时间：2020-05-08； 文件名称：《新华资产管理股份有限公司港股通股票库管理（暂行）办法》， 发文文号：新资研（2018）2号， 发文时间：2018-01-08；
研究管理办法	符合规定	文件名称：《新华资产管理股份有限公司研究管理办法》， 发文文号：新资研（2021）1号， 发文时间：2021-01-05；
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：《新华资产管理股份有限公司公平交易管理办法》， 发文文号：新资风（2018）17号， 发文时间：2018-12-13；
交易监控	符合规定	文件名称：《新华资产管理股份有限公司异常交易监察与处理细则》， 发文文号：新资风（2020）9号， 发文时间：2020-04-17；
集中交易	符合规定	文件名称：《新华资产管理股份有限公司集中交易管理办法》， 发文文号：新资交（2020）1号， 发文时间：2020-12-31；
交易权限管理	符合规定	文件名称：《新华资产管理股份有限公司集中交易管理办法》， 发文文号：新资交（2020）1号， 发文时间：2020-12-31；

五. 系统建设

整体评估情况：			
公司股票投资管理能力和股票投资技术系统建设情况符合监管规定。公司建立了符合监管要求的信息技术系统，并且能对投资管理产生实质性影响。公司下发的《新华资产管理股份有限公司股票投资管理办法》（新资股（2020）1号），第四章要求股票投资业务部门建立科学的研究分析系统、信息资讯系统、交易管理系统，以及资产估值和核算系统。其中研究分析系统包括投研知识库管理系统和资产配置系统，涵盖了资产配置模型、行业配置模型、个股估值模型和内部研究报告系统等模块。信息资讯系统财汇、信息资讯系统、聚源、万得信息资讯系统支持对信息资讯系统的日常投资交易清算和估值，实现报表自动生成。			
交易管理系统：			
系统名称	恒生投资交易系统		
上线时间	2005-08-01	评估结果	符合规定
主要功能	恒生投资交易系统支持对公投资资金的日常投资交易进行授权管理、交易管理、合规控制等。针对授权管理，系统可按资金性质、投资类型设置多层次帐户管、理体系，实现用户授权管理分为两部分，功能菜单访问授权和基金组合操作授权，能可实现在对投资人员与交易执行人员的分离与制约，并提供指令审批管理的功能，支持接收沪深A股、港股通、银行间交易、股指期货等实时交易行情，可将交易委托及时准确报送至沪深交易所，并同步接收处理实时成交数据。针对合规控制，系统可根据监管和公司内控制度进行相关指标设置，限制不同投资帐户的交易品种、金额和交易行为，实现交易合规性的实时检查与控制。		
信息资讯系统：			
系统名称	信息资讯系统		
上线时间	2007-03-01	评估结果	符合规定
主要功能	信息资讯系统包括财汇信息资讯系统、聚源信息资讯系统、万得信息资讯系统、舆情系统以及外部研报系统。财汇、聚源、万得信息资讯系统几乎涵盖金融全市、全品类的资讯数据，舆情系统包括新闻舆情、行政处罚、法律诉讼等资讯数据，外部研报系统能对接多家券商研究服务。		
研究分析系统：			
系统名称	研究分析系统		

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。