

交银人寿保险有限公司股权投资管理能力(间接股权投资)建设及自评估情况 (年度披露-【20250127】)

一、风险责任人

| 风险责任人 | 姓名 | 职务 | 风险责任人基本信息 |
|-------|-----|-----|--|
| 行政责任人 | 王庆艳 | 董事长 | 交银人寿保险有限公司关于股权投资风险责任人的基本信息披露公告.pdf |
| 专业责任人 | 高军 | 总经理 | 交银人寿保险有限公司关于股权投资风险责任人的基本信息披露公告.pdf |

二、组织架构

| 整体评估情况 |
|---|
| <p>公司设立了独立的资产(委托)管理部,并根据《保险机构股权投资管理能力标准》的要求下发正式文件,在资产(委托)管理部下设了“股权投资室”,组建了股权投资团队,建立了职责明确、分工合理的股权投资组织架构。股权投资团队下设岗位3人,包括股权投资岗、股权投后管理岗,分别负责股权投资执行和投后管理等职责。股权投资团队人员相关工作经验均超过3年,在股权投资和投后管理等方面经验丰富。综上,公司符合“保险机构股权投资管理能力标准”中关于组织架构的相关要求。</p> |

| 资产管理部门设置 | | |
|----------------|-----------|---|
| 部门名称 | 资产(委托)管理部 | |
| 股权投资部门 (团队) | 发文时间 | 2021-01-29 |
| | 发文文号 | 交银人寿发〔2020〕52号、交银人寿人资〔2021〕1号 |
| | 文件名称 | 《关于优化股权投资管理组织架构的通知》、《关于明确资产(委托)管理部股权投资室人员配置的通知》 |
| | 岗位设置 | 股权投资岗、股权投后管理岗 |

三、专业队伍

| 整体评估情况 |
|---|
| <p>公司已按照《保险机构股权投资管理能力标准》配备熟悉股权投资业务、具备股权投资能力的专业人员,股权投资室投资团队目前共有3名专职人员,其中1名专职从事投后管理工作,相关股权投资工作经验均超过3年,在行业研究、股权投资和投后管理等方面经验丰富。综上,公司股权投资管理专业队伍建设符合规定。</p> |

专业队伍人员基本信息

资产管理部门当前拥有3名具有3年以上股权投资相关经验的专职人员,其中专职投后管理的人员1名

| 序号 | 姓名 | 岗位 | 相关经验类型 | 经验年限(年) | 是否兼职 |
|----|----|----|--------|---------|------|
| | | | | | |

| | | | | | |
|---|-----|---------|----------|---|---|
| 1 | 胡迎春 | 股权投资岗 | 股权投资相关经验 | 9 | 否 |
| 2 | 贾伯禹 | 股权投后管理岗 | 股权投资相关经验 | 4 | 否 |
| 3 | 金川 | 股权投资岗 | 股权投资相关经验 | 8 | 否 |

| | |
|------------|------------|
| 专业队伍人员管理模式 | |
| 股权投资人员管理模式 | 自行开展间接股权投资 |

四、基本制度

| |
|--|
| 整体评估情况 |
| <p>公司根据《保险资金投资股权暂行办法》、《保险机构股权投资管理能力标准》等监管文件的要求，建立了股权投资内部管理制度和风险控制制度，相关制度已按规定经公司董事会或经营管理层批准，并以正式文件形式下发。制度涵盖了授权机制、投资决策、投资操作、风险预算和全程管控、资产估值、激励约束和责任追究、信息披露和关联交易、后管理和退出安排、应急处置和危机解决、资产托管机制等方面，覆盖股权投资全业务流程。综上，公司符合保险机构股权投资管理能力标准中关于基本制度的相关要求。</p> |

| 股权投资基本制度 | |
|----------|---|
| 授权机制 | |
| 制度明细一 | |
| 文件名称 | 《交银人寿股权投资管理办法（2023年版）》 |
| 发文文号 | 交银人寿办〔2023〕144号 |
| 发文时间 | 2023-10-08 |
| 评估结果 | 符合规定 |
| 制度明细二 | |
| 文件名称 | 《交银人寿资产负债管理执行委员会议事规则(2023年版)》 |
| 发文文号 | 交银人寿办〔2023〕128号 |
| 发文时间 | 2023-11-13 |
| 评估结果 | 符合规定 |
| 制度明细三 | |
| 文件名称 | 《交银人寿保险有限公司战略与资产负债管理及绿色金融委员会议事规则（2024年版）》 |
| 发文文号 | 交银人寿办〔2024〕5号 |
| 发文时间 | 2024-02-02 |
| 评估结果 | 符合规定 |
| 制度明细四 | |
| 文件名称 | 《交银人寿保险有限公司董事会对总经理授权方案（2024年版）》 |
| 发文文号 | 交银人寿发〔2024〕7号 |
| 发文时间 | 2024-03-28 |
| 评估结果 | 符合规定 |
| 投资决策 | |
| 制度明细一 | |

| | |
|------------------|---|
| 文件名称 | 《交银人寿股权投资管理办法（2023年版）》 |
| 发文文号 | 交银人寿办〔2023〕144号 |
| 发文时间 | 2023-10-08 |
| 评估结果 | 符合规定 |
| 制度明细二 | |
| 文件名称 | 《交银人寿保险有限公司战略与资产负债管理及绿色金融委员会议事规则（2024年版）》 |
| 发文文号 | 交银人寿办〔2024〕5号 |
| 发文时间 | 2024-02-02 |
| 评估结果 | 符合规定 |
| 制度明细三 | |
| 文件名称 | 《交银人寿资产负债管理执行委员会议事规则(2023年版)》 |
| 发文文号 | 交银人寿办〔2023〕128号 |
| 发文时间 | 2023-01-13 |
| 评估结果 | 符合规定 |
| 制度明细四 | |
| 文件名称 | 《交银人寿投资评审委员会工作条例（2024年修订版）》 |
| 发文文号 | 交银人寿办〔2024〕112号 |
| 发文时间 | 2024-10-17 |
| 评估结果 | 符合规定 |
| 制度明细五 | |
| 文件名称 | 《交银人寿股权投资业务立项委员会实施细则（2021年版）》 |
| 发文文号 | 交银人寿办〔2021〕58号 |
| 发文时间 | 2021-06-04 |
| 评估结果 | 符合规定 |
| 投资操作 | |
| 制度明细一 | |
| 文件名称 | 《交银人寿股权投资管理办法（2023年版）》 |
| 发文文号 | 交银人寿办〔2023〕144号 |
| 发文时间 | 2023-10-08 |
| 评估结果 | 符合规定 |
| 制度明细二 | |
| 文件名称 | 《交银人寿保险有限公司投资风险及绩效评估管理办法（2022年修订版）》 |
| 发文文号 | 交银人寿发〔2022〕50号 |
| 发文时间 | 2022-12-30 |
| 评估结果 | 符合规定 |
| 风险预算和全程管控 | |
| 制度明细一 | |
| 文件名称 | 《交银人寿股权投资管理办法（2023年版）》 |
| 发文文号 | 交银人寿办〔2023〕144号 |
| 发文时间 | 2023-10-08 |
| 评估结果 | 符合规定 |

| | |
|------------------|---------------------------------------|
| 制度明细二 | |
| 文件名称 | 《交银人寿市场风险管理办法（2024年版）》 |
| 发文文号 | 交银人寿办〔2024〕46号 |
| 发文时间 | 2024-04-28 |
| 评估结果 | 符合规定 |
| 制度明细三 | |
| 文件名称 | 《交银人寿保险有限公司偿付能力风险管理政策（2024年版）》 |
| 发文文号 | 交银人寿办〔2024〕39号 |
| 发文时间 | 2024-04-28 |
| 评估结果 | 符合规定 |
| 制度明细四 | |
| 文件名称 | 《交银人寿保险有限公司股权投资风险及绩效评估管理办法（2022年修订版）》 |
| 发文文号 | 交银人寿发〔2022〕50号 |
| 发文时间 | 2022-12-30 |
| 评估结果 | 符合规定 |
| 资产估值 | |
| 制度明细一 | |
| 文件名称 | 《交银人寿股权投资管理办法（2023年版）》 |
| 发文文号 | 交银人寿办〔2023〕144号 |
| 发文时间 | 2023-10-08 |
| 评估结果 | 符合规定 |
| 制度明细二 | |
| 文件名称 | 《交银人寿保险有限公司投资风险及绩效评估管理办法（2022年修订版）》 |
| 发文文号 | 交银人寿发〔2022〕50号 |
| 发文时间 | 2022-12-30 |
| 评估结果 | 符合规定 |
| 制度明细三 | |
| 文件名称 | 《交银人寿金融工具公允价值计量管理操作规程（2024年版）》 |
| 发文文号 | 交银人寿办〔2024〕34号 |
| 发文时间 | 2024-04-23 |
| 评估结果 | 符合规定 |
| 激励约束和责任追究 | |
| 制度明细一 | |
| 文件名称 | 《交银人寿保险有限公司股权投资风险及绩效评估管理办法（2022年修订版）》 |
| 发文文号 | 交银人寿发〔2022〕50号 |
| 发文时间 | 2022-12-30 |
| 评估结果 | 符合规定 |
| 制度明细二 | |
| 文件名称 | 《交银人寿不良资产责任认定和追究办法（2022版）》 |
| 发文文号 | 交银人寿办〔2022〕142号 |

| | |
|------------------|---------------------------------------|
| 发文时间 | 2022-10-27 |
| 评估结果 | 符合规定 |
| 制度明细三 | |
| 文件名称 | 《交银人寿非信贷风险资产责任认定和追究办法》 |
| 发文文号 | 交银人寿办〔2024〕127号 |
| 发文时间 | 2024-12-11 |
| 评估结果 | 符合规定 |
| 制度明细四 | |
| 文件名称 | 《交银人寿监管处罚责任认定实施办法》 |
| 发文文号 | 交银人寿办〔2022〕149号 |
| 发文时间 | 2022-11-30 |
| 评估结果 | 符合规定 |
| 信息披露和关联交易 | |
| 制度明细一 | |
| 文件名称 | 《交银人寿股权投资管理办法（2023年版）》 |
| 发文文号 | 交银人寿办〔2023〕144号 |
| 发文时间 | 2023-10-08 |
| 评估结果 | 符合规定 |
| 制度明细二 | |
| 文件名称 | 《交银人寿保险有限公司信息披露基本管理办法（2023年版）》 |
| 发文文号 | 交银人寿办〔2023〕154号 |
| 发文时间 | 2023-12-06 |
| 评估结果 | 符合规定 |
| 制度明细三 | |
| 文件名称 | 《交银人寿保险有限公司关联交易管理办法（2022年版）》 |
| 发文文号 | 交银人寿发〔2022〕34号 |
| 发文时间 | 2022-10-11 |
| 评估结果 | 符合规定 |
| 后续管理和退出安排 | |
| 制度明细一 | |
| 文件名称 | 《交银人寿股权投资管理办法（2023年版）》 |
| 发文文号 | 交银人寿办〔2023〕144号 |
| 发文时间 | 2023-10-08 |
| 评估结果 | 符合规定 |
| 制度明细二 | |
| 文件名称 | 《交银人寿保险有限公司股权投资项目投资后管理办法（2022年修订版）》 |
| 发文文号 | 交银人寿发〔2022〕48号 |
| 发文时间 | 2022-12-30 |
| 评估结果 | 符合规定 |
| 应急处置和危机解决 | |
| 制度明细一 | |
| 文件名称 | 《交银人寿保险有限公司股权投资风险及绩效评估管理办法（2022年修订版）》 |

| | |
|--------|-------------------------------------|
| 发文文号 | 交银人寿发〔2022〕50号 |
| 发文时间 | 2022-12-30 |
| 评估结果 | 符合规定 |
| 制度明细二 | |
| 文件名称 | 《交银人寿突发事件管理办法（2021年修订版）》 |
| 发文文号 | 交银人寿办〔2021〕55号 |
| 发文时间 | 2021-06-03 |
| 评估结果 | 符合规定 |
| 制度明细三 | |
| 文件名称 | 《交银人寿保险有限公司股权投资项目投资后管理办法（2022年修订版）》 |
| 发文文号 | 交银人寿发〔2022〕48号 |
| 发文时间 | 2022-12-30 |
| 评估结果 | 符合规定 |
| 资产托管机制 | |
| 制度明细 | |
| 文件名称 | 《交银人寿投资资产托管管理办法（2024年修订版）》 |
| 发文文号 | 交银人寿办〔2024〕106号 |
| 发文时间 | 2024-09-26 |
| 评估结果 | 符合规定 |

五、管理能力

| |
|--|
| 整体评估情况 |
| 公司已按照《保险机构股权投资管理能力标准》制定了清晰的发展战略和投资策略。公司具有完善的公司治理、管理制度、决策流程和内控机制，系统覆盖风险预警与合规管理系统、绩效评估模型，并已建立资产托管机制，资产运作规范透明。公司已建立了一支专业的投资队伍，具备丰富的投资经验，并不断通过公司内部外部培训提升专业能力。公司每年滚动制定三年资产配置规划与年度资产配置计划，经公司董事会审议通过后实施，股权投资策略严格按照公司资产配置方案执行，并依照公司有关机制履行投前把控、投中监控和投后管理的工作要求。综上所述，公司符合间接股权投资管理能力的有关要求。 |

六、风险控制体系

| |
|---|
| 整体评估情况 |
| 公司已建立了覆盖事前控制、事中监督、事后评价的风险控制体系，实行的独立于投资管理的报告制度。公司建立了全面风险管理体系，包括健全的风险管理制度和可靠的风险管理系统，明确了风险管理组织架构、职责分工及工作流程，并依据偿付能力风险管理要求搭建了适应公司自身的偿付能力风险管理体系，制定了一系列资金运用相关的制度和操作细则，对各类风险进行有效管控，对股权投资的风险识别、监控、预警和评估、风险控制和防范机制进行全面管理。综上所述，公司符合保险机构股权投资管理能力标准中关于风险管理体系的有关要求。 |

| | |
|---------------|--|
| <p>风险管理制度</p> | <p>公司制定了《交银人寿市场风险管理办法（2024年版）》、《交银人寿保险有限公司偿付能力风险管理政策（2024年版）》、《交银人寿股权投资风险及绩效评估管理办法（2022年修订版）》、《交银人寿保险有限公司股权投资项目投资后管理办法（2022年修订版）》、《交银人寿不良资产责任认定和追究办法（2022版）》、《交银人寿监管处罚责任认定实施办法》、《交银人寿突发事件管理办法（2021年修订版）》、《交银人寿保险有限公司关于报送股权投资风险责任人的报告》等制度，涵盖了风险管理原则、风险计量、风险点与控制手段、责任追究机制及绩效评估等方面内容。</p> |
| <p>风险管理系统</p> | <p>公司搭建了资产数据平台，该系统包括运用数据、资产负债管理数据以及偿付能力数据填报复核等模块，通过该系统对公持仓资产进行梳理、识别，实现对底层资产穿透管理，可根工要求以系统，抓取底层资产数据形成报送报表，进一步提升监管报送与底层资产穿透管理工作效率与质量。该系统功能包括风险指标、集中度及限额进行定期跟踪，该系统功能包括风险指标管理、风险报告管理，对各类风险指标进行监测和分析，实现对异常指标数据进行预警，为股权投资风险管理提供有力支持。与风险管理系统，其中该系公司采用了恒生绩效评估与风险管理系统，其内统功能包括组合查询、组合风险、绩效评估等模块内容，通过该系统实时掌握包括股权投资在内的资产配置规模、投资收益情况，对投资进行回溯评估，为资产配置动态调整提供参考，为资金运用数据报送提供系统化支持。</p> |

自评估结果及承诺

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》及相关监管规定，我对股权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。