

前海再保险股份有限公司股权投资管理能力(直接股权投资)建设及自评估情况 (半年度披露-【20210128】)

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	王焱侠	董事长	前海再保险股份有限公司关于变更股权投资业务风险责任人的基本信息披露公告(行政责任人).pdf
专业责任人	李蒙	投资总监	前海再保险股份有限公司关于股权投资业务风险责任人的基本信息披露公告(专业责任人).pdf

二、组织架构

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”建立了职责明确、分工合理的股权投资组织架构：公司设立了投资管理部，并在投资管理部内设立了独立的股权投资团队负责股权投资业务相关的项目筛选、行业研究、尽职调查、投资交易、投后管理及项目退出等执行工作。公司已下发正式文件设立股权投资团队，并在发文中明确了该团队的职责、各岗位职责、团队负责人及人员配置等内容。综上，经自评估，公司满足“保险机构股权投资管理能力标准”中关于股权投资组织架构的相关要求。

资产管理部门设置		
部门名称	投资管理部	
股权投资部门 (团队)	发文时间	2020-12-28
	发文文号	前海再发【2020】196号
	文件名称	前海再保险股份有限公司关于投资管理部股权投资团队设置的通知
	岗位设置	股权投资团队负责人、股权投资岗、投后管理岗

三、专业队伍

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”组建了专业股权投资团队，目前配备有开展直接股权投资及间接股权投资所需要的专业人员，其中具有3年以上股权投资相关经验的专职投资人员5名，具有3年以上股权投资相关经验的专职投后管理人员1名。综上，经自评估，公司股权投资业务专业队伍已满足“保险机构股权投资管理能力标准”中关于专业队伍的相关要求。

专业队伍人员基本信息

资产管理部门当前拥有6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	杨绍东	股权投资团队负责人	股权投资相关经验	11	否
2	可宗嘉	股权投资团队成员	股权投资相关经验	7	否
3	李瀚瀛	股权投资团队成员	股权投资相关经验	11	否
4	娄欢	股权投资团队成员	股权投资相关经验	6	否
5	程刚	股权投资团队成员	股权投资相关经验	7	否
6	周晓易	股权投资团队成员	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	自行开展直接股权投资

四、基本制度

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”建立了股权投资基本制度，包括但不限于授权机制、投资决策、投资操作、风险预算和全程管理、资产估值、激励约束和责任追究、信息披露和关联交易、后续管理和退出安排、应急处置和危机解决等，相关制度已分别经公司高管工作会议、投资决议会议或其授权机构批准，并以公司正式文件形式下发执行。同时，公司已建立了资产托管机制，已与中国工商银行股份有限公司深圳市分行签署了资产托管协议，确保资产运作规范透明。综上，经自评，公司股权投资制度建设已满足“保险机构股权投资管理能力标准”中关于投资基本制度的相关要求。

股权投资基本制度	
授权机制	
制度明细一	
文件名称	前海再保险股份有限公司投资决策管理办法
发文文号	前海再制度【2019】8号
发文时间	2019-01-23
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	前海再保险股份有限公司股权投资管理办法
发文文号	前海再制度【2020】19号
发文时间	2020-12-30
评估结果	符合规定
投资决策	
制度明细	
文件名称	前海再保险股份有限公司股权投资决策管理实施细则
发文文号	前海再制度【2020】17号
发文时间	2020-12-30
评估结果	符合规定

投资操作	
制度明细一	
文件名称	前海再保险股份有限公司股权投资管理办法
发文文号	前海再制度【2020】19号
发文时间	2020-12-30
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	前海再保险股份有限公司股权投资决策管理实施细则
发文文号	前海再制度【2020】17号
发文时间	2020-12-30
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	前海再保险股份有限公司全面风险管理办法
发文文号	前海再制度【2018】26号
发文时间	2018-08-13
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	前海再保险股份有限公司全面风险管理实施细则
发文文号	前海再制度【2019】12号
发文时间	2019-02-25
评估结果	符合规定
制度明细三	
文件名称	前海再保险股份有限公司资产管理重大突发事件应急管理 办法
发文文号	前海再制度【2017】51号
发文时间	2017-04-06
评估结果	符合规定
制度明细四	
文件名称	前海再保险股份有限公司资金运用业务风险监控管理 细则
发文文号	前海再制度【2020】25号
发文时间	2020-12-30
评估结果	符合规定
制度明细五	
文件名称	前海再保险股份有限公司资金运用业务应急预案操作 指引
发文文号	前海再制度【2020】16号
发文时间	2020-12-30
评估结果	符合规定
制度明细六	
文件名称	前海再保险股份有限公司股权投资决策管理实施细则
发文文号	前海再制度【2020】17号
发文时间	2020-12-30
评估结果	符合规定
制度明细七	

文件名称	前海再保险股份有限公司资产风险五级分类管理办法
发文文号	前海再制度【2019】19号
发文时间	2019-07-23
评估结果	符合规定
制度明细八	
文件名称	前海再保险股份有限公司股权投资投后管理办法
发文文号	前海再制度【2020】13号
发文时间	2020-12-30
评估结果	符合规定
资产估值	
制度明细一	
文件名称	前海再保险股份有限公司投资资产估值办法指引
发文文号	前海再制度【2018】7号
发文时间	2018-05-15
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	前海再保险股份有限公司股权投资管理办法
发文文号	前海再制度【2020】19号
发文时间	2020-12-30
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	前海再保险股份有限公司股权投资绩效考核与激励管理办法
发文文号	前海再制度【2020】15号
发文时间	2020-12-30
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	前海再保险股份有限公司员工违规行为管理办法
发文文号	前海再制度【2016】34号
发文时间	2016-12-27
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	前海再保险股份有限公司股权投资管理办法
发文文号	前海再制度【2020】19号
发文时间	2020-12-30
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	前海再保险股份有限公司关联交易管理办法
发文文号	前海再制度【2019】20号
发文时间	2019-10-25
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	前海再保险股份有限公司股权投资管理办法
发文文号	前海再制度【2020】19号
发文时间	2020-12-30
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	前海再保险股份有限公司股权投资投后管理办法
发文文号	前海再制度【2020】13号
发文时间	2020-12-30
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	前海再保险股份有限公司资产管理重大突发事件应急管理 办法
发文文号	前海再制度【2017】51号
发文时间	2017-04-06
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	前海再保险股份有限公司资金运用业务风险监控管理 细则
发文文号	前海再制度【2020】25号
发文时间	2020-12-30
评估结果	符合规定
制度明细三	
文件名称	前海再保险股份有限公司资金运用业务应急预案操作 指引
发文文号	前海再制度【2020】16号
发文时间	2020-12-30
评估结果	符合规定
资产托管机制	
制度明细	
文件名称	前海再保险股份有限公司保险资金托管管理办法
发文文号	前海再制度【2018】11号
发文时间	2018-06-22
评估结果	符合规定

五、管理能力

整体评估情况

公司按照“保险机构股权投资管理标准”制定了清晰的战略发展规划，明确了投资目标，提升投资效率，通过加强基金、私募、直投等多种投资方式，提高投资回报。同时，公司建立了完善的风险管理体系，覆盖事前、事中、事后全流程，确保投资安全。此外，公司还注重人才培养和团队建设，不断提升核心竞争力。在监管方面，公司严格遵守相关法律法规，积极配合监管机构的检查，确保合规经营。未来，公司将继续加大研发投入，优化投资结构，实现高质量发展。

六、风险控制体系

<p>整体评估情况</p> <p>公司已按照“保险机构股权投资管理标准”建立了覆盖事前、事中、事后全流程的风险管理体系，包含风险评估、风险监控、风险预警、风险处置等环节。公司还建立了完善的内部控制制度，确保各项业务合规开展。此外，公司还注重人才培养和团队建设，不断提升核心竞争力。在监管方面，公司严格遵守相关法律法规，积极配合监管机构的检查，确保合规经营。未来，公司将继续加大研发投入，优化投资结构，实现高质量发展。</p>	<p>建立了覆盖事前、事中、事后全流程的风险管理体系，包含风险评估、风险监控、风险预警、风险处置等环节。公司还建立了完善的内部控制制度，确保各项业务合规开展。此外，公司还注重人才培养和团队建设，不断提升核心竞争力。在监管方面，公司严格遵守相关法律法规，积极配合监管机构的检查，确保合规经营。未来，公司将继续加大研发投入，优化投资结构，实现高质量发展。</p>
<p>风险管理制度的</p>	<p>公司按照“保险机构股权投资管理标准”制定了风险管理制度的具体内容，包括风险评估、风险监控、风险预警、风险处置等环节。公司还建立了完善的内部控制制度，确保各项业务合规开展。此外，公司还注重人才培养和团队建设，不断提升核心竞争力。在监管方面，公司严格遵守相关法律法规，积极配合监管机构的检查，确保合规经营。未来，公司将继续加大研发投入，优化投资结构，实现高质量发展。</p>

<p>风险管理系统</p>	<p>公司具有绩效评估与风险管理系统，该系统涵盖限额监控、组合查询、组合风险、固定收益等模块，实现内司资金运用业务对风险、合规指标的监测与预警。其中限额监控中包括了规则库设置、监控规则设置、投资库设置等功能；组合风险中包括了Var分析、波动率分析、Beta分析、流动性分析等功能；固定收益中包括了利率分析、现金流分析和情景分析等功能；同时，该系统具备组合绩效模块，实现公司资金运用业务的绩效评估与归因分析，包括收益概貌、净值收益对比、风险调整收益、择机分析、Fama分解、Brinson业绩归因、主动贡献归因等功能。同时，公司具有独立的风险管理指标，涵盖风险指标管理、风险报表报告、压力测试、RCSA管理、损失事件管理、制度管理、关联方查询等模块，其中风险指标管理设置了关键风险及合规指标，并根据风险类别划分三档进行预警。</p>
---------------	---

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。