

公司基本信息

(一) 公司名称: 中金浦成投资有限公司

(二) 注册地: 上海市

(三) 注册资本: 600000 万元

(四) 业务范围: 投资管理, 投资咨询(依法须经批准的项目, 经相关部门批准后方可开展经营活动)

(五) 法定代表人: 刘健

(六) 高级管理人员:

姓名	职务
刘健	公司总经理暨法定代表人
方华	风控负责人
陶方舟	合规负责人
李世红	财务负责人

公司风险控制机制的要点

公司自有资金投资业务的风险包括但不限于市场风险、信用风险、操作风险、流动性风险、法律风险、合规风险、声誉风险、跨境风险等。公司制定了相应机制对风险进行识别和应对, 主要包括:

(一) 市场风险

市场风险主要分布于受股票、利率、汇率等的价格或波动的变化影响的跨境业务。公司主要通过监控包括股票波动率、市盈率、合约持仓量等在内的市场风险指标并及时处理指标异常或超限情况来管理市场风险, 同时持续关注标的基本面, 并通过定期或不定期进行压力测试、VAR 值测试等评估整体风险。

(二) 信用风险

信用风险主要是指由于交易对手、中介机构、债券发行人及其他与公司有业务往来的机构违约而造成损失的风险。公司主要通过信用审批、信用敞口计量、收取担保品及信用风险限额设定等措施来管理信用风险。

(三) 操作风险

操作风险是指由于失效的或有缺陷的内部程序、系统、人员或外部事件而导致损失的风险。

1、为控制内部程序和人员风险, 在各业务流程中制定恰当的业务授权、业务隔离等风险规避措施, 实现公司与母公司及其他子公司之间的敏感信息的隔

离、监控和管理，防止敏感信息在各业务之间的不当流动和使用，防范内幕交易和利益输送风险。

2、为控制信息系统风险，对信息系统的风险管理贯穿于从规划、研发或采购、建立、运行、操作、维护直至最后处理的全部过程，建立明确的信息技术管理操作规程，制定充足的备用和恢复程序以保证公司在硬件、软件或通讯设备出现故障时能够及时应对。

3、为控制外部风险事件，制定公司的应急预案，以保证能够及时、有效应对各种重大突发事件。

（四）流动性风险

流动性风险指公司无法及时获得充足资金或无法以合理成本及时获得充足资金以应对资产增长、支付到期债务和满足正常业务开展的资金需求的风险。

公司主要通过如下措施管理流动性风险：

1、密切监控公司的资产负债表、资本金情况，基于业务计划，定期开展现金流预测，分析评估公司流动性敞口，确保公司流动性充足。

2、针对具体业务设定限额、分析业务流动性敞口，进行动态管理：针对资本金投资业务，分类别设定总体投资规模上限，单一标的投资上限，和期限限制；针对衍生品业务，设定业务规模上限，分析并监控业务流动性敞口及变化情况。

3、长期保持充足现金和高流动性资产以支持正常业务经营。

（五）法律风险

法律风险指公司签署的合同等法律文件存在违反有关法律或法规的可能性，或因其他原因导致未能得到部分或全部履行，或公司遭受侵权或其他不法侵害，或因公司业务所在国家和地区法律法规未尽完善或法律解释不明确导致公司某些业务所涉相关法律问题及可获得的法律救济存在不确定性，或公司遭受区域间司法及执法环境差异，从而使公司蒙受经济或声誉损失的风险。

公司法律事务人员对业务开展中的相关法律事务进行管理，负责为公司开展的相关业务提供合同审阅、法律咨询和法律意见，处理各种日常法律事务，以及各类涉及公司及员工的直接或者潜在的争议。

（六）合规风险应对措施

合规风险指公司因经营管理活动或员工的执业行为违反法律、法规、监管规定、自律准则或公司内部规章制度而受到法律制裁、被采取监管措施、遭受财产损失或者声誉损失的各类风险。

公司主要采取以下措施管理合规风险：

1、根据法律、法规、监管规定、自律准则的变动制定及持续更新公司的合规政策及流程；

- 2、对新业务进行合规审查，提供合规意见和合规风险防控措施的建议；
- 3、对敏感信息的流动进行管理，防范内幕交易风险及利益冲突；
- 4、根据法律、法规、监管规定、自律准则、行业规范及公司规章制度等规定开展合规检查，监测公司业务经营及员工执业行为的合规性，识别及防范合规风险；
- 5、通过各种方式向员工提供合规培训以提升员工的合规意识；
- 6、建立问责机制，以落实对违规人员的惩戒。

（七）声誉风险

声誉风险是指由公司经营、管理及其他行为或外部事件导致利益相关方对公司负面评价的风险。声誉风险存在于公司各项经营活动中，公司通过员工行为管理、各项业务活动中的声誉风险管理以及经营管理等方面管理声誉风险。

（八）跨境风险

跨境风险是指资本跨境转移和业务跨境运作时所面临的资本管制风险、汇率波动风险、法律风险和合规风险等。公司在开展跨境业务时，深入分析境内外市场在交易规则、监管规则和法律上的差异，提前识别潜在的跨境风险因素，在对客户进行充分风险揭示的基础上，制定符合交易对手资质的交易限额和标的管理方法，并考虑境内外交易时间的差别，及时对合约进行估值、密切关注交易情况和追保情况以规避相关风险。

公司防范利益冲突机制的要点

为防止保密信息的有害流动，协助防止未经授权披露或滥用（或可能的滥用）此类信息，杜绝公司与中金公司之间发生利益输送、“暗箱操作”等违法违规行为，公司制定了相应的隔离机制，以限制公司与中金公司之间信息的不当流动为基点，重点从防范利益冲突角度对公司员工的行为进行了规范，主要内容包括：

1. 对于业务保密信息，业务人员按照“需要知道”的原则获知，员工不应获知也不得问询其未参与的业务的保密信息。
2. 除非获得公司总经理和合规人员的批准，业务人员不得向任何无关人员披露其在开展业务过程中获知的保密信息，包括员工的家庭成员，以及中金公司投资银行、资产管理、自营、研究等部门员工，也不得从中金公司的投资银行、资产管理、自营、研究等业务部门获知保密信息。
3. 除业务活动以外，业务人员不得将其获知的保密信息用于个人交易，也不得用于向其亲友或任何其他他人提供投资建议。