

太平洋资产管理有限责任公司 2016年度财务会计和风险管理信息报告

一、财务会计信息

公司2016年度财务会计信息如下：

（一）资产负债情况

单位：元

资产负债	公司合并财务报表数据	
	2016年12月31日	2015年12月31日
资产	2,690,085,239.62	1,572,671,058.43
负债	479,597,121.34	429,220,287.55
股东权益	2,210,488,118.28	1,143,450,770.88
负债和股东权益总计	2,690,085,239.62	1,572,671,058.43

（二）损益情况

单位：元

损益科目	公司合并财务报表数据	
	2016年度	2015年度
一、营业收入	842,924,278.70	807,694,991.99
二、营业支出	-450,288,196.27	-463,521,755.84
三、营业利润	392,636,082.43	344,173,236.15
四、利润总额	406,698,310.96	351,470,098.50
五、净利润	305,182,882.73	262,625,471.57

备注：公司聘请普华永道中天会计师事务所对公司2016年财务报表进行了审计，
审计师出具了标准无保留意见审计报告。

二、风险管理信息

根据保监会的要求，秉承太保集团“诚信天下，稳健一生，追求卓越”的核心价值观，太平洋资产管理有限责任公司坚持“全面风险管理，实现可持续价值增长”的风险管理理念，坚持并实施“分类管理、合理承担、全面控制”的总体风险管理策略，进一步加强风险管理体系建设，提高风险管控能力。

（一）风险管理组织体系

公司建立了完善的风险管理体系。公司章程明确了股东会、董事会、监事会、经营委员会及总经理的工作职责、授权机制、议事规则等，为内部控制目标的实现提供合理保证。董事会是全面风险管理的最高决策机构。经营委员会下设负责证券投资、产品委员会和风险管理专业委员会。风险管理委员会主要负责审议风险管理重要事项，监督风险管理体系运行的有效性。根据保监会要求，公司设首席风险管理执行官及品种投资专业风险责任人。公司设有独立的合规与风险管理部、信用评估部，行使风险管理相关职责。

（二）风险管理总体策略

公司从维护股东和资产委托人的权益和利益出发，努力保证公司规范、稳健的运作，全面防范和控制业务过程中的各类风险，继续坚持并实施“分类管理、合理承担、全面控制”的总体风险管理策略。

在公司运营过程中，采取的风险管理策略：1. 通过建立完善的制度与流程，尽可能地消除操作风险隐患，设计严密的监控检查手段，及时发现操作风险并降低可能的损失，做好充分的应急准备，以防止操作风险损失的扩散。2. 建立严谨的合规管理体系，

通过必要的审查措施与监控手段，规避并消除合规风险。3. 通过规范的业务流程和专业的法律审查，规避并消除法律风险。4. 对于其余风险采取适当承担原则。

（三）风险评估方法

公司通过建立风险跟踪、监控预警、风险评估指标体系，对市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规风险等进行持续预警监控和定期评估。

1、市场风险评估

公司建立了主要的量化风险指标体系，定期维护模型与参数，通过计算在险价值（VaR）、债券久期、凸性、 β 等风险指标，合理评估市场风险。定期对市场价格波动风险、利率风险和汇率风险进行敏感性分析和压力测试，以全面真实地反映投资资产的市场风险。

2、信用风险评估

公司建立内部信用评级模型，对偿债主体和债项条款进行分析和评估，确定债项的内部评级结果。定期依据保监会认可的评级机构的外部评级和公司的内部评级结果，合理测算信用风险敞口头寸。

3、流动性风险评估

公司通过测算各账户受托资产投资集中度、流动性资产准备、融资杠杆、资产变现比例等指标评估资产流动性风险。各帐户整体流动性压力较小。

4、操作风险评估

风险评估工作从内部控制角度出发，制定风险评估标准。通过自评系统下发风险调研问卷，收集风险基础数据，汇总风险事

件。综合评估风险事件，从风险事件发生的可能性和影响程度两方面，以定性和定量的方式评估风险，确定风险评级，提示内控重点领域，研究风险应对策略。

5、合规风险评估

公司根据合规控制表和合规评估表对合规风险点的特征描述，计算和监控投资业务的合规比例，分析和评估各类投资资产的合规资质。在投资比例方面，公司受托管理的各类资产投资比例均在中国保监会规定的比例范围内。在投资活动方面，公司遵守保监会的监管规定，坚持安全稳健原则。

公司严格遵守国家相关法律法规和监管机构的监管规定，坚持稳定的投资策略，坚持稳健的投资风格，公司的内控不断强化，业务流程持续优化，风险管控有力，各项投资业务有序进行，风险可控，公司全面风险管理稳步深入推进，保障公司业务持续健康发展。