

太平洋资产管理有限责任公司 2024 年第一季度信息披露报告

2024 年 7 月

目 录

一、基本信息	1
二、财务会计信息	2
三、公司治理信息	4
四、风险管理状况信息	10
五、关联交易总体情况	14
六、消费者保护工作和投诉情况	15
七、重大事项信息	15

太平洋资产管理有限责任公司

2024 年第一季度信息披露报告

一、基本信息

(一) 公司名称: 太平洋资产管理有限责任公司

名称缩写: 太保资产

(二) 注册资本: 人民币 21 亿元

(三) 公司住所和营业场所: 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 100 号 39 楼

(四) 成立时间: 2006 年 6 月 9 日

(五) 经营范围和经营区域:

经营范围: 管理运用自有资金及保险资金, 委托资金管理业务, 与资金管理业务相关的咨询业务及国家法律法规允许的其他资产管理业务。

经营区域: 在法律法规及监管规定允许的区域范围内开展业务。

(六) 法定代表人: 于业明

(七) 客服电话、投诉渠道和投诉处理程序

公司总机: (021)-33968999; 如有任何问题, 客户可随时反馈到其专属服务人员, 公司将主动、积极、及时地进行处理。

二、财务会计信息

(一) 财务报表数据：单位（元）

1. 资产负债情况

资产负债	公司合并财务报表数据（未经审计）
	2024年3月31日
资产	6,664,659,815.34
负债	1,343,268,996.24
所有者权益	5,321,390,819.10
负债和所有者权益总计	6,664,659,815.34

2. 损益情况

损益科目	公司合并财务报表数据（未经审计）
	2024年3月31日
一、营业收入	508,382,620.82
二、营业支出	276,209,853.85
三、营业利润	232,172,766.97
四、利润总额	232,172,766.97
五、净利润	179,309,083.25

3. 所有者权益情况

所有者权益	公司合并财务报表数据（未经审计）
	2024年3月31日
实收资本	2,100,000,000.00
资本公积	
其他综合收益	14,562,613.31
盈余公积	416,047,611.04
一般风险准备	1,137,808,794.12
未分配利润	1,050,243,847.45
少数股东权益	602,727,953.18
所有者权益合计	5,321,390,819.10

(二) 财务报表的编制基础

本财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）、财政部于2008年4月10日颁布的财办会[2008]3号《关于印发〈保险资产管理公司财务

报表列报要求>的通知》适用条款编制。

本财务报表以持续经营为基础列报。

三、公司治理信息

(一) 实际控制人情况

本公司无实际控制人；中国太平洋保险（集团）股份有限公司持有本公司 80%的股权，为本公司控股股东。

(二) 持股比例在 5%以上的股东及其持股变化情况

中国太平洋保险(集团)股份有限公司持股 16.8 亿元，占比 80%；中国太平洋人寿保险股份有限公司持股 3.36 亿元，占比 16%。2024 年一季度，持股情况未发生变化。

(三) 股东会职责和 2024 年一季度主要决议情况

1. 股东会主要职责

股东会由全体股东组成，是公司的权力机构，依法行使下列主要职权：

- (1) 决定公司的经营方针和自有资金的投资计划；
- (2) 选举和更换董事及由非职工代表担任的监事，决定有关董事、监事报酬事项；
- (3) 审议批准董事会报告、监事会报告、年度财务预算方案、决算方案、利润分配方案和弥补亏损方案；
- (4) 对公司增加或者减少注册资本、发行公司债券或者其他有价证券及公司上市、合并、分立、解散、清算或变更公司形式做出决议；
- (5) 审议批准修改公司章程、股东会、董事会和监事会议事规则；
- (6) 对聘用、解聘为公司财务报告进行定期法定审计的会计师事务所作出决议；
- (7) 审议批准公司设立法人机构；重大资产购置、处置与核销、重大资产抵押或质押、对外投资、对外投资处置等；

(8) 审议批准监管规定、太保集团关联交易管理制度或公司章程规定应由股东会审批的关联交易；

(9) 审议批准长期激励或股权计划方案；

(10) 以及法律法规、监管规定及公司章程规定的其他职权。

2. 股东会主要决议

2024 年一季度，本公司未召开股东会。

(四) 董事会职责、人员构成和工作情况

1. 董事会职责

董事会行使下列主要职权：

(1) 召集股东会，并向股东会报告工作，执行股东会决议；

(2) 决定公司经营计划和自有资金投资方案；

(3) 制订公司年度财务预算方案、决算方案、利润分配方案和弥补亏损方案；

(4) 制订公司增加或者减少注册资本、发行公司债券或者其他证券及上市方案；制定公司重大收购或合并、分立、解散、清算或者变更公司形式的方案；

(5) 决定公司内部管理机构设置；

(6) 聘任或解聘公司高级管理人员，决定其报酬和奖惩事项，监督经营管理层履行职责；

(7) 制订公司章程修改方案，拟订股东会、董事会议事规则；审议批准董事会专门委员会工作规则；制定公司的基本管理制度，审议批准数据治理等事项；制定公司风险管理和内部控制相关政策，承担全面风险管理的最终责任；

(8) 审议批准在股东会授权范围内的公司资产购置、资产处置与核销、资产抵押或质押等事项的权限；审议批准对外投资和

对外投资处置事项；审议批准重大关联交易。制定公司与股东特别是主要股东之间利益冲突的识别、审查和管理机制；承担股东事务的管理责任；制定公司资本规划、发展战略并监督战略实施；

(9) 负责公司信息披露，并对会计和财务报告真实性、准确性、完整性和及时性承担最终责任；定期评估并完善公司治理。

(10) 法律法规、监管规定及公司章程规定的其他职权。

2. 董事会人员构成

本公司董事会由9名董事组成，人员组成较2023年末无变化，分别为于业明、傅帆、张卫东、潘艳红、顾越、苏罡、齐亮、曹志龙、蔡晓虹。其中齐亮、曹志龙、蔡晓虹为独立董事。

3. 董事会工作情况

2024年一季度，公司召开1次董事会会议，审议了总经理工作报告、2023年度财务决算等议案。全体董事根据法律法规、监管规定和公司章程赋予的职责，履行董事义务，按时出席会议，忠实勤勉、恪尽职守，充分审议和讨论公司相关议案，在审慎判断的基础上独立作出审议意见并表决。

(五) 独立董事工作情况

本公司有3名独立董事。全体独立董事按照《公司法》、《银行保险机构公司治理准则》、《保险公司独立董事管理办法》和《公司章程》的要求，忠诚、勤勉、独立履行职责，按时出席了一季度董事会及专门委员会会议，认真审议会议议案，独立发表审议意见，切实维护本公司和其他利益相关者合法权益。

(六) 监事会职责、人员构成和工作情况

1. 监事会职责

监事会行使下列主要职权：

(1) 检查公司财务；

(2) 监督董事会确立稳健的经营理念、价值准则和制定符合公司情况的发展战略；对公司发展战略的科学性、合理性和稳健性进行评估；

(3) 对公司经营决策、风险管理和内部控制等进行监督检查并督促整改；

(4) 对董事的选聘程序进行监督；对公司薪酬管理制度实施情况及高级管理人员薪酬方案的科学性、合理性进行监督；对董事、高级管理人员执行公司职务的行为进行监督，对违反法律法规、监管规定、公司章程或者股东会决议的董事、高级管理人员提出罢免建议；当董事、高级管理人员的行为损害公司利益时，要求董事、高级管理人员予以纠正；

(5) 提议召开临时股东会会议，在董事会不履行召集和主持股东会职责时召集和主持股东会会议；

(6) 向股东会提出议案；

(7) 依照相关规定对董事、高级管理人员提起诉讼；提名股东代表监事候选人、制订监事会议事规则；

(8) 法律法规、监管规定及公司章程规定的其他职权。

2. 监事会人员构成

本公司监事会由 3 名监事构成，人员组成较 2023 年末无变化，分别为顾强、袁颂文、钱鲲。

3. 监事会工作情况

2024 年一季度，公司召开 1 次监事会会议，全体监事履行法律法规、监管规定和公司章程赋予的职责，按时参加会议并审议各项议案，在审慎判断的基础上独立作出审议意见并表决。

（七）外部监事工作情况

2024年一季度，公司外部监事任职资格在监管机构审批过程中。2024年5月7日，公司收到国家金融监督管理总局关于杜爱武担任公司监事会外部监事任职资格的批复。

（八）高级管理层构成及职责

《公司章程》规定，公司高级管理人员是指公司的执行董事、总经理、副总经理、总经理助理、首席风险管理执行官、合规负责人、财务负责人、审计责任人、董事会秘书以及由董事会聘任的其他管理人员。

于业明为本公司董事长、执行董事。余荣权为本公司总经理，其他经监管批复任职资格的高级管理人员为严赞华、杨一君、殷春平、易平、赵峰等。

公司高级管理层根据法律法规、监管规定、公司章程及董事会授权组织开展经营管理活动，对董事会负责，同时接受监事会监督。

（九）薪酬制度及董事、监事和高级管理人员薪酬管理工作

公司落实监管机构及公司治理要求，制定了《董事、监事薪酬管理制度》、《薪酬管理办法》、《绩效薪酬追索扣回暂行办法》等制度。2024年一季度，公司严格执行相关制度，相关工作符合监管规定和公司制度要求。

（十）公司部门设置情况和分支机构设置情况

公司共设置了17个部门，分别为权益投资部、固定收益部、量化投资部、市场部、另类投资管理中心、结构融资部、研究部、信用评估部、集中交易室、产品管理部、风险管理部、组合管理部、法律合规部、信息技术部、营运部、财务部、综合管理部（纪

律检查室、董事会、监事会办公室合署办公)。暂无分支机构。

(十一) 银行保险机构对本公司治理情况的整体评价

本公司公司治理体系较为完善，决策机制健全，公司股东会、董事会、监事会、经营管理层运作顺畅。2024年一季度，本公司认真贯彻国家各项法律法规和监管规定，积极践行企业社会责任，完善公司治理，以健全的公司治理促进公司业务发展。

(十二) 监管机构规定的其他信息

无。

四、风险管理状况信息

（一）风险管理组织体系

公司建立了由董事会承担最终责任、高级管理层直接领导，以风险管理部门为依托，各职能部门密切配合，覆盖所有业务和岗位的风险管理组织架构。

董事会对公司全面风险管理有效性承担最终责任，董事会下设审计、风险管理与关联交易控制委员会，由独立董事担任主任委员。公司监事会对公司风险管理和内部控制等工作进行监督检查并督促整改。

公司经营委员会对全面风险管理有效性承担直接领导责任，每年向公司董事会报告公司风险评估与管理情况。经营委员会下设风险管理工作委员会，负责组织开展公司全面风险管理工作。根据监管规定，公司对相关投资业务设立了风险行政责任人和风险专业责任人，并设首席风险管理执行官。公司设有独立的风险管理部门执行风险管理相关职能。

（二）公司风险管理总体目标、总体策略及执行情况

公司全面风险管理的总体目标是：确保公司风险管理体系的完整性和有效性；规范公司风险管理行为，提高公司经营效率和效果，降低实现公司经营目标的不确定性；确保公司业务开展符合资金委托人和公司的风险偏好；确保公司风险管理工作符合各项法律法规和公司有关管理规定；确保与太保集团公司风险管理要求相一致。

公司风险管理的总体策略是：在公司全面风险管理的总体目标指导下，通过健全的管理体系、规范的管理流程、科学的管理手段，高效地实现风险管理目标，支持与促进公司经营目标的实

现和资产管理业务的高质量发展。

公司风险管理工作遵循以下原则：集团一体化管控与公司专业化运作相统一；全面管理与重点监控相协调；各司其职与形成合力相一致；充分有效与效率提升相平衡；风险管理与经营管理相融合。

2024年一季度，公司继续坚持“价值投资、稳健投资、长期投资、责任投资”的基本投资理念，风险管理策略执行情况良好，未发生重大、恶性的风险事件。

（三）制度建设

公司制定了《全面风险管理办法》并定期更新。《全面风险管理办法》是公司风险管理的基本制度及各类专门风险管理工作的准则和基础。在此基础上，公司建立健全了各类专项风险制度，涵盖市场风险、流动性风险、信用风险、操作风险、合规风险、战略风险、声誉风险、洗钱风险、信息科技风险、环境、社会和治理（ESG）风险等，作为日常风险管理工作的指引。同时，公司在投资组合风险管理、新业务风险管控及重大突发事件风险应对等方面也制定了相应的管理办法和操作规程。以上各类专项管理制度全面覆盖了各类风险的识别、评估、监测、报告、控制处理、应急处置等环节。

（四）关键风险管理

公司遵循委托人投资指引和资产管理产品契约要求，持续完善并落实风险监控和预警工作。主要体现在以下几个方面：

1. 市场风险管理

2024年一季度，外部环境复杂严峻，地缘政治风险持续加深。国内一季度经济运行继续回升向好，但也面临有效需求不足等挑

战。在此形势下，国内权益市场收益继续出现波动，市场基础利率下行。公司始终坚持稳健的投资策略，高度重视资产配置的均衡和分散，主动管理市场风险。

2. 信用风险管理

2024年一季度，市场流动性合理充裕，但结构性信用风险继续显现，主要表现在地产行业风险、地方债务风险和中小金融机构风险等方面。公司继续坚持高等级信用投资和发行的总体策略，实施信用主体分类授信管理，严格执行各类风险限额，积极控制整体信用风险。

3. 流动性风险管理

2024年一季度，公司所有受托专户和组合类资管产品流动性情况良好，申购和赎回正常。

4. 投资集中度风险管理

公司根据各类投资业务特点，建立健全投资集中度风险管理机制，有效识别、计量、管理和控制各维度的集中度风险。针对市场风险集中度，公司建立了集中度监控机制。针对信用风险集中度管理，公司建立了交易对手管理制度和授信制度，并通过风险管理系统严格执行限额管理。公司建立了组合类保险资产管理产品集中度管理制度，针对单一信用主体、单一股票、基金管理人等维度设置限额。2024年一季度，公司投资资产分散适度，投资集中度风险可控。

5. 操作风险管理

公司从交易、法律、财务、数据报送、合规、审计、信息安全等方面建立操作风险关键指标，持续优化和改进操作风险识别和监测方式。利用数据技术手段提高操作风险控制、监测的水平

和能力，完善各类投资业务在事前、事中和事后的风险管控机制。通过日常操作风险事件的发现、收集、分析，持续改进工作流程和管控方法，有效防范操作风险。

2024年一季度，公司各项投资业务合法合规开展，主要合规经营指标总体平稳，操作风险管理机制运作有效。

6. 信息科技风险管理

公司全面贯彻监管机构要求，落实信息科技风险各项管控措施，持续推进信息科技风险管理体系建设。加强科技风险管理组织建设，提升信息安全岗位专业能力。开展安全文化建设。加强科技外包管理和数据安全管理工作，建立覆盖数据全生命周期的数据安全管理体系。定期开展信息安全监测及风险评估工作。2024年一季度，公司信息科技风险管理工作有序开展，未发生重大信息科技风险事件。

（五）风险管理系统建设

公司风险管理信息系统以专业化的风险数据集市为依托，通过多层次、系统化的风险指标计算、风险模型的运用、及时的风险监控预警和报告，为公司各类投资业务提供全面适用的风险信息，涵盖公司所有业务条线和资产类别，基本实现风险计量、监测、预警和报告等日常工作的系统化。2024年一季度，公司继续推进风险管理系统平台建设，加强风险管理数据整合，优化风险因子算法，完善相关风险计量模型，提升系统的完善性和成熟度。

五、关联交易总体情况

根据监管机构关联交易管理的相关要求，本公司建立了较为完善的关联交易管理体系。在制度建设、运行机制和流程等方面符合监管规定。

（一）关联交易基本情况

2024年一季度，本公司发生的关联交易主要包括受托资产管理、销售保险资产管理产品以及资金运用等事项，共发生需报送的关联交易14笔。2024年一季度，本公司未发生重大关联交易。

（二）关联交易制度执行情况

按照《银行保险机构关联交易管理办法》（银保监会令〔2022〕1号）和中国太平洋保险（集团）股份有限公司关联交易管理相关规定，本公司制定了《关联交易管理工作规程》、《关联交易管理办公室工作规则》，在公司董事会下设立了审计、风险管理和关联交易控制委员会，在公司层面设立了关联交易管理办公室，构建了符合监管政策要求的关联交易管理架构和流程。公司2024年一季度发生的关联交易，均按照监管要求及公司关联交易管理办法的规定，执行了审批、报告、披露流程。

（三）关联交易报告和信息披露情况

2024年一季度，公司按规定向监管机构报送关联交易逐笔报告和季度报告，在公司网站和中国保险行业协会网站上及时发布逐笔披露公告和季度分类合并披露公告。

六、消费者保护工作和投诉情况

公司根据《银行保险机构消费者权益保护管理办法》，制定了《金融消费者权益保护管理办法》，在金融消费者权益保护方面持续努力，通过制定详细的制度和流程，提供清晰、准确和全面的信息，建立完善的投诉处理机制。公司严格按照相关制度执行，确保金融消费者的权益得到保障和维护。2024年一季度，公司未发生金融消费者投诉事件。

七、重大事项信息

无。

太平洋资产管理有限责任公司

2024年7月