

生命保险资产管理有限公司衍生品运用管理能力 建设及自评估情况—股指期货（年度披露— 20240108）

一、风险责任人

风险责任人：	风险责任人信息披露公告		
行政责任人：	徐倩	职务：	拟任总经理/临时负责人
行政责任人类别：	授权总经理	是否履行完备的授权程序：	是
行政责任人性别	男	行政责任人出生年月	1980-10
行政责任人学历	博士研究生	行政责任人学位	博士
行政责任人所在部门	总经理室	行政责任人入司时间	2023-09-21
行政责任人专业资质	10年以上金融行业从业经验	行政责任人专业技术职务	无
专业责任人：	贾殿村	职务：	权益投资部总经理
专业责任人类别：	授权的相关资产管理部门负责人	是否履行完备的授权程序：	是
专业责任人性别	男	专业责任人出生年月	1969-06
专业责任人学历	博士研究生	专业责任人学位	博士
专业责任人入司时间	2016-10-09	专业责任人所在部门	权益投资部
专业责任人专业资质	具备相关投资领域十年以上从业经历	专业责任人专业技术职务	副研究员

二、基本条件

整体评估情况：	<p>公司具有良好的公司治理结构，以及健全的衍生品交易业务操作、内部控制和 risk 管理制度，并建立了相关投资交易、会计核算和风险管理信息系统，同时配备符合资质的衍生品交易专业管理人员，包括但不限于股指期货分析研究、投资交易、财务处理、风险控制人员等。公司近两年未受到监管机构重大行政处罚。</p> <p>根据《保险机构内部审计工作规范》（保监发【2015】133号）的相关规定，公司审计实行集团集中化管理，由公司控股股东富德保险控股股份有限公司（以下简称“富德保控”）审计稽核中心统一负责。根据《关于下发富德保险控股股份有限公司治理及经营管理组织架构的通知》（富保发【2016】10号），富德保控设置专门的审计稽核中心，负责集团本级及其子公司的审计稽核工作，我公司不再设置内部审计部门和岗位。经自评估，公司股指期货运用管理基本条件符合监管标准规定。</p>
行政处罚情况：	近两年无受到监管机构重大行政处罚
受托情况：	是受托参与交易

三、组织架构

整体评估情况：	<p>公司第一届董事会第十三次会议通过了关于开展股指期货业务的决议，董事会知晓相关风险并承担参与股指期货业务的最终责任，是股指期货业务的最高决策机构。董事会审议通过公司投资交易授权管理办法，明确股指期货授权权限和管理要求。公司已下发正式文件，明确股指期货业务相关的架构设置和岗位职责，包括投资交易、风险管理、清算核算等职能。不同部门之间设立防火墙体系，实行严格的业务分离制度，投资交易、风险管理、清算核算等部门独立运作、相互制约。</p> <p>根据《保险机构内部审计工作规范》（保监发【2015】133号）的相关规定，公司审计实行集团集中化管理，由公司控股股东富德保险控股股份有限公司（以下简称“富德保控”）审计稽核中心统一负责。根据《关于下发富德保险控股股份有限公司治理及经营管理组织架构的通知》（富保发【2016】10号），富德保控设置专门的审计稽核中心，负责集团本级及其子公司的审计稽核工作，我公司不再设置内部审计部门和岗位。经自评估，公司股指期货运用组织架构符合监管标准规定。</p>
投资交易部门	

1			
部门名称:	交易部		
发文时间:	2022-11-16	文件名称(含文号):	《关于印发公司部门“四定”方案的通知》生保资发【2022】44号
岗位设置:	场内交易员		
2			
部门名称:	权益投资部		
发文时间:	2022-11-16	文件名称(含文号):	《关于印发公司部门“四定”方案的通知》生保资发【2022】44号
岗位设置:	研究员岗,股票投资经理岗		
3			
部门名称:	组合管理部		
发文时间:	2022-11-16	文件名称(含文号):	《关于印发公司部门“四定”方案的通知》生保资发【2022】44号
岗位设置:	资产配置岗		
风险管理部			
1			
部门名称:	风险合规部		
发文时间:	2022-11-16	文件名称(含文号):	《关于印发公司部门“四定”方案的通知》生保资发【2022】44号
岗位设置:	风险管理岗		
清算核算部门			
1			
部门名称:	运营管理部		
发文时间:	2022-11-16	文件名称(含文号):	《关于印发公司部门“四定”方案的通知》生保资发【2022】44号
岗位设置:	估值核算岗,资金清算岗		
内部稽核部门			
1			
部门名称:	富德保险控股股份有限公司审计稽核中心		
发文时间:	2016-02-15	文件名称(含文号):	《关于下发富德保险控股股份有限公司治理及经营管理组织架构的通知》(富保发【2016】10号)
岗位设置:	专项审计岗		
防火墙机制:	公司不同部门之间设立防火墙体系,实行严格的业务分离制度,确保投资交易、风险管理、清算核算、内部稽核等部门独立运作。通过设置独立的交易办公场所等物理隔离、资金与账户隔离等措施,有效防控利益冲突。公司防火墙机制符合能力标准要求。		
评估结果:	符合规定		

四、专业队伍

整体评估情况:						
公司配备股指期货交易专业管理人员,包括分析研究、资产配置、投资交易、风险控制、清算核算等专业管理人员。其中资产配置和投资交易专业人员6人,分析研究专业人员1人,风险控制专业人员3人,清算和核算专业人员2人,上述人员均通过了期货从业人员资格考试。投资负责人员具有5年以上证券业务经验,投资业务经理具有3年以上证券业务经验。公司审计实行集中化管理,我公司不再设置内部审计部门和岗位。						
专业队伍人员基本信息:						
序号	姓名	岗位	是否为能力标准要求的专职人员	相关经验类型	是否通过期货从业人员资格考试	相关经验年限

1	王蕾	场内交易员	否	期货或证券业务经验	已通过	12.52
2	苏佳琦	场内交易员	否	期货或证券业务经验	已通过	8.52
3	宋红萍	场内交易员	否	期货或证券业务经验	已通过	12.18
4	詹迪斌	投资经理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	12.18
5	卢森堡	投资经理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	9.43
6	何佳天	研究员岗	否	期货或证券业务经验	已通过	3.68
7	刘俊利	资产配置岗	否	期货或证券业务经验	已通过	10.52
8	杜佩纯	估值核算岗	否	期货或证券业务经验	已通过	10.93
9	林育华	清算岗	否	期货或证券业务经验	已通过	12.52
10	肖志成	风控经理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	7.35
11	梁聪	风控经理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	12.18
12	蔡杰	风险管理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	3.93

五、投资规则与基本制度

整体评估情况：		
<p>公司建立了完善、有效的衍生品交易管理制度，明确股指期货交易的操作规范、内部控制、风险管理和问责机制、相关制度已经董事会、经营管理层或其授权机构批准，并以公司正式文件形式下发执行。公司《股指期货投资风险管理办法》明确了对冲方案的制定流程和实施流程，对冲方案需经公司风险合规部及有关决策人员审批。公司已与交易结算机构签署协议文件，确定股指期货业务交易、保证金管理、风险控制及数据据传输等事项，明确双方的权利和义务。公司通过制定《金融衍生品交易管理办法》、《股指期货投资风险管理办法》、《股指期货投资风险管理办法》建立健全衍生品交易业务操作、内部控制和风险管理制度。业务操作涵盖研究、决策、交易、清算与结算等全过程，明确责任分工，确保业务流程清晰，环节紧密衔接。内部控制和风险管理制度的明确了岗位职责，确保业务操作和风险管理流程可执行，关键岗位相互制衡，重点环节双人复核，并纳入公司总体风险管理架构，能够覆盖股指期货交易前、中、后台。同时，公司制定《从业人员职业操守及行为准则》，明确公司从业人员的行为准则和禁止性行为以及相关处罚措施。</p>		
衍生品交易管理制度：		
制度内容	评估结果	制度明细
与交易结算机构签署协议文件	符合规定	文件名称：生命保险资产管理有限公司-农业银行-中信期货投资托管操作三方备忘录， 发文文号：无， 发文时间：2021-01-22；
风险管理制度	符合规定	文件名称：生命保险资产管理有限公司股指期货投资风险管理办法， 发文文号：生保资发[2021]10号， 发文时间：2021-01-15； 文件名称：生命保险资产管理有限公司金融衍生品交易管理办法， 发文文号：生保资发[2021]6号， 发文时间：2021-01-15；
问责制度	符合规定	文件名称：生命保险资产管理有限公司风险事件责任追究管理办法， 发文文号：生保资发[2020]7号， 发文时间：2020-01-06； 文件名称：生命保险资产管理有限公司从业人员职业操守及行为准则， 发文文号：生保资发[2023]12号， 发文时间：2023-04-12；
风险对冲方案	符合规定	文件名称：生命保险资产管理有限公司股指期货投资风险管理办法， 发文文号：生保资发[2021]5号， 发文时间：2021-01-15；
内部控制制度	符合规定	文件名称：生命保险资产管理有限公司股指期货投资风险管理办法， 发文文号：生保资发[2021]5号， 发文时间：2021-01-15； 文件名称：生命保险资产管理有限公司内部控制评价管理办法， 发文文号：生保资发[2020]62号， 发文时间：2020-09-10；

衍生品交易业务操作制度	符合规定	文件名称：生命保险资产管理有限公司股指期货投资管理 办法， 发文文号：生保资发[2021]5号， 发文时间：2021-01-15； 文件名称：生命保险资产管理有限公司金融衍生产品 交易管理办法， 发文文号：生保资发[2021]6号， 发文时间：2021-01-15； 文件名称：生命保险资产管理有限公司股指期货投资 业务会计核算办法， 发文文号：生保资发[2021]12号， 发文时间：2021-01-25；
-------------	------	---

六、托管机制

整体评估情况： 公司通过制定《资产托管业务管理办法》明确公司托管人管理的职责分工、托管人选择、托管人监管、托管人更换的事项。在实际业务操作中，公司严格按照制度选择托管人，与资产托管机构签署协议文件，确定资金划拨、清算、估值等事项，明确双方的权利和义务。 经自评估，公司股指期货运用托管机制符合监管标准规定。

七、系统建设

整体评估情况：			
公司购入并上线恒生系统股指期货模块，实现股指期货投资交易、会计核算、风险管理等系统功能。公司可利用投资分析相关系统功能计算对冲资产组合风险所需的衍生品数量，并根据市场变化，调整衍生品规模，逐步实现担保品动态调整；公司可利用资产估值和核算相关功能实现会计确认、计量、账务处理；公司可利用风险管理相关系统功能实现股指期货交易的实时监控，各项风险管理指标固化在系统中，能够及时预警；公司可利用交易结算相关功能实现与合作机构的交易结算机构信息对接，并建立相应的备份通道。股指期货交易管理系统稳定高效，且能够满足交易需求。 经自评估，公司股指期货运用系统建设符合监管标准规定。			
交易结算系统：			
系统名称	恒生投资交易管理系统软件 V03.2		
上线时间	2020-12-26	评估结果	符合规定
主要功能	能够与合作的交易结算机构信息系统对接，并建立相应的备份通道。该系统稳定高效，且能够满足交易需求。		
投资分析系统：			
系统名称	恒生投资绩效评估与风险管理系统软件 V3.0		
上线时间	2020-12-26	评估结果	符合规定
主要功能	依托恒生投资交易管理系统，并辅以BI报表系统，计算对冲资产组合风险所需的衍生品数量，并根据市场变化，调整衍生品规模，逐步实现担保品动态调整。		
资产估值和核算系统：			
系统名称	恒生资产估值与会计核算系统软件（企业版） V2.6		
上线时间	2020-12-26	评估结果	符合规定
主要功能	支持完整的股指期货日常估值方案，对交易行为：开仓、平仓、交割等估值；对交易策略：投机、套保、套利等估值；满足日常保证金调整、无负债结算、费用等估值处理。支持市场上各类外部数据，包括中金所、监控中心等接口的读入，满足在当前会计准则下进行会计确认、计量、账务处理及财务报告符合规定，在估值表上可体现出持仓的估值数据，并提供期货台账用来比对。支持股指期货业务清算功能。股指期货估值系统稳定高效，且能够满足估值需求。		
风险管理信息系统：			
系统名称	恒生投资绩效评估与风险管理系统软件 V3.0		
上线时间	2020-12-26	评估结果	符合规定
主要功能	能够根据实际风险管理需求配置风控规则，实现事前、事中的实时风险监控，并能够及时预警。		

八、风险管理

整体评估情况：	
公司通过制定《生命保险资产管理有限公司全面风险管理办法》、《生命保险资产管理有限公司市场风险管理办法》、《生命保险资产管理有限公司股指期货投资管理暂行办法》、《生命保险资产管理有限公司风险管理考核方案》、《生命保险资产管理有限公司突发事件应急管理暂行办法》、《生命保险资产管理有限公司重大突发事件应急预案实施规范》等制度，建立了股指期货交易的全面风险管理制度与业务操作流程，具备完善的应急机制和管理预案。	
动态风险管理机制评估：	《生命保险资产管理有限公司股指期货投资风险管理暂行办法》明确了动态风险管理评估机制及风险对冲有效性预警机制，包括制定股指期货交易的全面风险管理制度与业务操作流程，建立实时监测、评估与处置风险的信息系统，完善应急机制和管理预案。
风险对冲有效性预警机制评估：	《生命保险资产管理有限公司股指期货投资风险管理暂行办法》明确了动态风险管理评估机制及风险对冲有效性预警机制，包括市场风险、流动性风险、强制平仓风险、合规风险、操作风险及风险对冲失效风险的识别和控制。
激励制度和机制评估：	《生命保险资产管理有限公司金融衍生产品交易管理办法》明确不得简单将股指期货交易盈亏与业务人员收入挂钩。后台及风险管理部门的人员报酬，应当独立于交易盈亏情况。
定期监督检查情况评估：	审计稽核团队已将衍生品风险管理纳入定期内部审计机制，根据《生命保险资产管理有限公司金融衍生产品交易管理办法》，内部审计机构定期对衍生品业务进行稽核检查，独立提交半年度和年度报告，并按规定向银保监会报告。检查至少包括业务合规情况、制度执行情况、人员资质情况、避险政策及有效性评估、买入计划与实际执行的偏差等。
回溯分析情况评估：	审计稽核团队根据监管要求，将衍生品风险管理纳入定期稽核审计范围，并在公司开展衍生品业务后形成审计报告。每半年回溯买入计划与实际执行的偏差，纳入每半年及年度稽核审计报告，并按规定向银保监会报告。

九、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，我公司对保险资管公司衍生品运用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，我公司达到了该项能力的基本要求，现按规定披露相关信息。

我公司承诺对本公告披露的及时性、内容的真实性、完整性负责。