

中意资产管理有限责任公司衍生品运用管理能力 建设及自评估情况—股指期货（半年度披露— 20210129）

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：	贡磊	职务：	公司总经理
专业责任人：	DANNINGER MARKUS	职务：	公司总经理助理
类别：	高级管理人员		

二、基本条件

整体评估情况：	
2021年1月，公司法律合规部组织组合管理部、权益投资部、交易部、综合风控部、运营管理部、信息科技部、人力资源部、审计部、综合部等相关部门开展了2021年首次公司衍生品运用（股指期货）管理能力的半年度自评估工作。自评估工作由各部门做第一轮评估，法律合规部做第二轮评估并形成合规评估报告，公司投资管理委员会对自评估工作进行最终决策。法律合规部牵头组织各部门进行自评估完成后的信息披露和持续监管等相关工作。公司衍生品运用（股指期货）管理能力达到《中国银保监会关于优化保险机构投资管理能力的通知》的要求。	
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：			
公司建立了职责明确、分工合理的股指期货交易组织架构，董事会知晓参与股指期货交易的各类风险并承诺承担参与股指期货交易的最终责任。董事会授权经营管理层开展股指期货业务，按照分级管理、明确授权、规范操作、严格监管的原则，形成了规范的投资决策体系。公司下发《关于中意资产管理有限责任公司设立股指期货投资相关部门的通知》设立了股指期货交易相关部门（包括组合管理部、权益投资部、交易部、运营管理部、财务及清算部、综合风控部、法律合规部等），设置了股指期货业务的投资交易、风险管理、清算核算、内部稽核等岗位，并对部门职责、岗位职责、部门负责人及人员配置等进行了明确。上述岗位均无同一人员兼职情况并建立了防火墙机制保证岗位、账户及股指期货交易各项工作的独立性。公司股指期货交易相关人员均具有期货或证券业务经验，且通过了期货从业资格考试。			
投资交易部门			
1			
部门名称：		交易部	
发文时间：		2021-01-20	文件名称（含文号）： 《关于中意资产管理有限责任公司设立股指期货投资相关部门的通知》（中意资管[2021]人力10号）
岗位设置：		交易	
2			
部门名称：		组合管理部	
发文时间：		2021-01-20	文件名称（含文号）： 《关于中意资产管理有限责任公司设立股指期货投资相关部门的通知》（中意资管[2021]人力10号）
岗位设置：		股指期货投资负责人，资产配置	
风险管理部门			

1			
部门名称:	法律合规部		
发文时间:	2021-01-20	文件名称 (含文号):	《关于中意资产管理有限责任公司设立股指期货投资相关部门的通知》(中意资管[2021]人力10号)
岗位设置:	法律合规岗		
2			
部门名称:	综合风控部风控中心		
发文时间:	2021-01-20	文件名称 (含文号):	《关于中意资产管理有限责任公司设立股指期货投资相关部门的通知》(中意资管[2021]人力10号)
岗位设置:	风险控制岗		
清算核算部门			
1			
部门名称:	财务及清算部		
发文时间:	2021-01-20	文件名称 (含文号):	《关于中意资产管理有限责任公司设立股指期货投资相关部门的通知》(中意资管[2021]人力10号)
岗位设置:	清算岗		
2			
部门名称:	运营管理部		
发文时间:	2021-01-20	文件名称 (含文号):	《关于中意资产管理有限责任公司设立股指期货投资相关部门的通知》(中意资管[2021]人力10号)
岗位设置:	核算岗		
内部稽核部门			
1			
部门名称:	审计部		
发文时间:	2021-01-20	文件名称 (含文号):	《关于中意资产管理有限责任公司设立股指期货投资相关部门的通知》(中意资管[2021]人力10号)
岗位设置:	审计岗		

四、专业队伍

整体评估情况:						
公司配备的交易专业管理人员,包括分析研究、投资交易、财务处理、风险控制和审计稽核等人员,其中分析研究和投资交易专业人员5人,风险控制专业人员3人,清算和核算专业人员2人,均已通过期货从业人员资格考试,投资交易、风险控制和清算岗位人员不存在相互兼任情况。负责人员具有5年以上证券业务经验,业务经理具有3年以上证券业务经验。						
专业队伍人员基本信息:						
序号	姓名	岗位	是否兼职	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	张敏生	风险控制岗	否	期货或证券业务经验	已通过	8.15
2	苗清	交易	否	期货或证券业务经验	已通过	9.56
3	毛毛	审计岗	否	期货或证券业务经验	未通过	9.39
4	汪欣	法律合规岗	否	期货或证券业务经验	已通过	12.31
5	谭显英	股指期货投资负责人	否	期货或证券业务经验	已通过	7.57
6	钟楠	资产配置	否	期货或证券业务经验	已通过	1.77
7	李香蓉	资产配置	否	期货或证券业务经验	已通过	0.52

8	张晗粟	资产配置	否	期货或证券业务经验	已通过	9.55
9	李少亨	风险控制岗	否	期货或证券业务经验	已通过	3.42
10	徐竞	清算岗	否	期货或证券业务经验	已通过	12.61
11	张玉亮	核算岗	否	期货或证券业务经验	已通过	14.39

五、投资规则与基本制度

整体评估情况： 公司建立了完善、有效的衍生品交易管理制度，相关制度均已经董事会、经营管理层或其授权机构批准，并以公司正式文件形式签署协议。公司已明确双方的权利和义务，公司建立了健全的衍生品种交易管理制度，明确了岗位职责，纳入公司总体风险控制制度，明确纳入专业人员的分工，确保操作规范，符合《期货交易所管理办法》、《期货公司监督管理办法》、《期货公司风险管理指引》等法律法规的要求。		
衍生品交易管理制度：		
制度内容	评估结果	制度明细
风险管理制度	符合规定	文件名称：股指期货业务风险管理办法， 发文文号：中意资管【2016】组合管理17号， 发文时间：2016-06-02；
风险对冲方案	符合规定	文件名称：中意资产管理有限责任公司股指期货投资管理制度， 发文文号：中意资管【2016】组合管理17号， 发文时间：2016-06-02； 文件名称：股指期货业务风险管理办法， 发文文号：中意资管【2016】组合管理17号， 发文时间：2016-06-02；
问责制度	符合规定	文件名称：股指期货业务人员守则， 发文文号：中意资管【2016】组合管理17号， 发文时间：2016-06-02；
衍生品交易业务操作制度	符合规定	文件名称：中意资产管理有限责任公司股指期货投资管理制度， 发文文号：中意资管【2016】组合管理17号， 发文时间：2016-06-02； 文件名称：股指期货保证金管理和结算管理办法， 发文文号：中意资管【2016】组合管理17号， 发文时间：2016-06-02； 文件名称：股指期货交易管理办法， 发文文号：中意资管【2016】组合管理17号， 发文时间：2016-06-02；
内部控制制度	符合规定	文件名称：中意资产管理有限责任公司股指期货投资管理制度， 发文文号：中意资管【2016】组合管理17号， 发文时间：2016-06-02； 文件名称：股指期货业务风险管理办法， 发文文号：中意资管【2016】组合管理17号， 发文时间：2016-06-02；
与交易结算机构签署协议文件	符合规定	文件名称：股指期货保证金管理和结算管理办法， 发文文号：中意资管【2016】组合管理17号， 发文时间：2016-06-02； 文件名称：股指期货交易管理办法， 发文文号：中意资管【2016】组合管理17号， 发文时间：2016-06-02； 文件名称：期货投资托管运营备忘录， 发文文号：无， 发文时间：2017-03-01；

六、托管机制

整体评估情况:

公司已经与期货交易结算机构、资产托管机构签订多方合作协议，协议中明确约定了股指期货业务的资金划拨、清算、估值等事项，并明确各方的权利和义务。符合《保险机构衍生品运用管理能力标准—股指期货》的相关要求。

七、系统建设

整体评估情况：			
股指期货交易的系统建设情况符合监管要求。公司在投资交易、会计核算、风险管理等方面都进行了系统化建设。投资交易系统方面，采购了金仕达公司研发的资产管理交易系统；结合金仕达内置的风控系统，并配以自主开发，能实时对股指期货交易的指标进行监控；恒生公司的资产估值与会计核算V2.6系统配备了相应的股指期货估值与清算模块，账务记账、清算逻辑遵循相应的会计准则。相关系统均通过了可靠性测试。符合《保险机构衍生品运用管理能力标准—股指期货》的相关要求。			
交易结算系统：			
系统名称	金仕达资产管理系统		
上线时间	2016-09-30	评估结果	符合规定
主要功能	交易结算通过金仕达系统进行，目前通过深圳通专线对接了中信，华泰等多家期货柜台，并配备多条备份通道。为了保证系统的稳定，高效，期货交易管理系统设计了双机互备架构，并通过深圳通专线交易，保证了期货交易的安全稳定。		
投资分析系统：			
系统名称	FDA系统（内部开发）		
上线时间	2016-01-31	评估结果	符合规定
主要功能	FDA系统是我司自主研发的投资分析平台，其子模块能够根据资产配置和风险约束，自动计算对冲需要的衍生品数量，能够在盘中和盘后对衍生品规模和担保品数量进行及时监控，并依此进行动态调整，确保对冲有效和担保品充足。		
资产估值和核算系统：			
系统名称	资产估值与会计核算系统		
上线时间	2013-05-31	评估结果	符合规定
主要功能	资产估值和核算系统采购恒生公司的资产估值与会计核算系统。配备了相应的股指期货估值与清算模块，账务记账、清算逻辑遵循相应的会计准则。产品托管都是选取工行、农行、招行等合规可靠的银行，运营人员会及时与对方进行清算数据核算，对账。股指期货估值系统运行稳定，能满足运营人员日常的估值需求。		
风险管理信息系统：			
系统名称	金仕达资产管理系统		
上线时间	2016-09-30	评估结果	符合规定
主要功能	公司以金仕达系统作为交易系统和风控系统，并配以自主开发，实时监控股指期货交易，对持仓头寸、比例、保证金等风险管理指标进行监控，并能及时预警。		

八、风险管理

整体评估情况：	
公司已经建立了涵盖动态风险管理机制、风险预警机制、激励制度和机制、监督检查机制、偏差回溯机制等在内的股指期货运用管理制度和体系，符合《保险机构衍生品运用管理能力标准》相关要求。	
动态风险管理机制评估：	公司已经制订了股指期货交易的全面风险管理制度，其中在《股指期货业务风险管理办法》中列明了风险控制原则、风险控制的组织机构及各机构风险控制职责、风险的识别、风险量化指标、各类风险控制的工具和措施、覆盖事前事中和事后风险控制流程以及风险报告体系等。风控合规部会对超限等风险状况进行持续监控，直至恢复风险限额之内为止。公司亦建立了股指期货的业务操作流程，包括投资决策、授权管理、投资交易、保证金管理、结算处理、风险控制等，并在《中意资产管理有限责任公司股指期货投资管理制度》、《股指期货保证金管理和结算管理办法》和《股指期货交易管理办法》中进行了明确。公司以金仕达系统作为交易系统和风控系统，并配以自主开发，实时监控股指期货交易，对持仓头寸、比例、保证金等风险管理指标进行监控，并能及时预警。以上符合《保险机构衍生品运用管理能力标准》相关要求。

风险对冲有效性预警机制评估：	根据《股指期货业务风险管理办法》，公司会结合自身及资产组合实际情况出具风险监控日报，对于接近限额或者超限的合约及账户进行风险预警；出具风险评估日报，评估股指期货及套保组合、其他对冲策略产品的市场风险状况，包括但不限于股指期货及套保组合仓位、贝塔、VaR等。公司还会定期出具压力测试报告，对股指期货仓位、基差风险、展期风险等进行压力测试，分析不同情景假设下的公司与股指期货相关产品组合的市值变动情况、净值增长情况以及偿付能力变化情况等，并根据实际情况提出应对预案。以上符合《保险机构衍生品运用管理能力标准》相关要求。
激励制度和机制评估：	公司已经制定有效的激励制度和机制，并非简单将交易盈亏与业务人员收入挂钩，此外后台及风险管理部门的人员报酬也均独立于交易盈亏情况，符合《保险机构衍生品运用管理能力标准》相关要求。
定期监督检查情况评估：	公司的内部审计部门会定期对衍生品交易的风险管理情况进行监督检查，独立提交半年度和年度稽核报告。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等，符合《保险机构衍生品运用管理能力标准》相关要求。
回溯分析情况评估：	公司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，符合《保险机构衍生品运用管理能力标准》相关要求。

九、自评估结果及承诺

根据《关于优化保险机构投资管理能力监管有关事项的通知》及相关监管规定，我对保险资管机构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。



