

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（年度披露— 20230129）

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
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	1973-03
行政责任人学历	研究生	行政责任人学位	硕士
行政责任人所在部门	管理层	行政责任人入司时间	2013-12-02
行政责任人专业资质	具备相关领域10年以上从业经历	行政责任人专业技术职务	无
专业责任人：	DANNINGER MARKUS	职务：	公司总经理助理
专业责任人类别：	高级管理人员	是否履行完备的授权程序：	
专业责任人性别	男	专业责任人出生年月	1977-02
专业责任人学历	研究生	专业责任人学位	硕士
专业责任人入司时间	2013-08-01	专业责任人所在部门	管理层
专业责任人专业资质	具备相关领域10年以上从业经历	专业责任人专业技术职务	无

二、基本条件

整体评估情况：	<p>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交易业务并定期向董事会报告，由经营管理层下设的投资管理委员会负责股指期货交易业务的具体开展，并按照分级管理、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。衍生品交易业务操作、内部控制和风险管理方面，公司发布了《中意资产管理有限责任公司股指期货投资管理制度》《中意资产管理有限责任公司股指期货保证金管理和结算管理办法》《中意资产管理有限责任公司股指期货交易管理办法》《中意资产管理有限责任公司股指期货业务风险管理办法》等制度，对衍生品交易业务操作、内部控制和风险管理做出了规定。信息系统方面，公司通过金仕达研发的资产管理交易系统、金仕达内置的风控系统、恒生公司的资产估值核算系统与会计核算V2.6系统及自建的FDA系统等，实现了股指期货的投资交易、会计核算和风险管理。人员方面，公司配备了股指期货交易专业管理人员，包括但不限于分析研究、投资交易、财务处理、风险控制和审计稽核等。公司近两年未受到监管机构重大行政处罚。经评估，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监管有关事项的通知》的要求。</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：	
---------	--

防火墙机制：	公司在不同部门之间设立了防火墙机制，实行严格的业务分离制度并明确公司应保持前中后台的相对独立性。股指期货交易相关的投资交易、财务处理、风险控制制度和审计稽核等人员均无同一人员兼职情况，确保岗位、账户及股指期货交易各项工作的独立性和客观性。
评估结果：	符合规定

四、专业队伍

整体评估情况：						
经评估，公司股指期货专业队伍建设达到《关于优化保险机构投资管理能力监管有关事项的通知》的相关要求。公司股指期货交易专业管理人员中，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，其中资产配置和投资交易专业人员5人，分析研究人员2人，风险控制专业人员3人，清算和核算专业人员2人，审计稽核人员1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年以上期货或证券业务经验，业务经理具有3年以上期货或证券业务经验。						
专业队伍人员基本信息：						
序号	姓名	岗位	是否为能力的标准要求 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	苗清	交易	否	期货或证券业务经验	已通过	9.50
2	陈清爽	交易	否	期货或证券业务经验	已通过	9.42
3	王天一	审计岗	否	期货或证券业务经验	已通过	2.64
4	谷风	分析研究	否	期货或证券业务经验	已通过	11.49
5	汪欣	法律合规岗	否	期货或证券业务经验	已通过	7.61
6	聂小军	股指期货投资 负责人	否	期货或证券业务经验	已通过	9.42
7	聂小军	资产配置	否	期货或证券业务经验	已通过	9.42
8	许飞虎	量化投资研究	否	期货或证券业务经验	已通过	11.50
9	许飞虎	量化投资研究	否	期货或证券业务经验	已通过	11.50
10	张玉亮	核算岗	否	期货或证券业务经验	已通过	5.67
11	王润	清算岗	否	期货或证券业务经验	已通过	1.49
12	张繁超	风险控制岗	否	期货或证券业务经验	已通过	5.71
13	张敏生	风险控制岗	否	期货或证券业务经验	已通过	7.09

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，相关制度均经过董事会、经营管理层或其授权机构批准，并以正式文件形式下发执行。公司制定了《股指期货交易管理办法》和《股指期货交易实施细则》，明确了股指期货交易各环节的风险管理要求，并建立了完善的内部控制体系，确保股指期货交易业务的合规性和风险可控。公司建立了完善的股指期货交易管理制度，相关制度均经过董事会、经营管理层或其授权机构批准，并以正式文件形式下发执行。公司制定了《股指期货交易管理办法》和《股指期货交易实施细则》，明确了股指期货交易各环节的风险管理要求，并建立了完善的内部控制体系，确保股指期货交易业务的合规性和风险可控。公司建立了完善的股指期货交易管理制度，相关制度均经过董事会、经营管理层或其授权机构批准，并以正式文件形式下发执行。公司制定了《股指期货交易管理办法》和《股指期货交易实施细则》，明确了股指期货交易各环节的风险管理要求，并建立了完善的内部控制体系，确保股指期货交易业务的合规性和风险可控。		
衍生品交易管理制度：		
制度内容	评估结果	制度明细

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：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：中意资产管理有限责任公司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；
与交易结算机构签署协议文件	符合规定	文件名称：中意资产管理有限责任公司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：期货投资托管营运备忘录， 发文文号：无， 发文时间：2017-03-01； 文件名称：中意资产管理有限责任公司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：中意资产管理有限责任公司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；
风险管理制度	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：中意资产管理有限责任公司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；
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：中意资产管理有限责任公司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；

六、托管机制

整体评估情况：

公司与期货经纪商、资产托管机构签署的三方协议《股指期货投资托管营运备忘录》，主要内容包括账户开立（结算账户、保证金账户、交易编码、保证金账户余额、资金安全等）、资金划拨（划拨方式、划拨额度、预留印鉴和授权、指令时间）、结算数据传输（交易数据、结算数据、估值数据、传输时间及途径）、风险控制及监督（合规监管规定、保证金比例、持仓及期货账户风险度）等事项，明确了三方在各环节的权利和义务。

七、系统建设

整体评估情况：

动态风险管理机制评估：	<p>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。</p> <p>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。</p>
风险对冲有效性预警机制评估：	<p>根据《中意资产管理有限责任公司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仓位、展期风险等进行压力测试，分析不同情景假设下的公司净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，动态监测相关风险控制指标、制定风险对冲有效预警机制。以上符合《保险机构衍生品运用管理能力标准》相关要求。</p>
激励制度和机制评估：	<p>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。</p>
定期监督检查情况评估：	<p>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。</p>
回溯分析情况评估：	<p>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。</p>

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。