

# 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— 20260126）

## 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
行政责任人类型:	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
专业责任人类型:	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:	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，明确了管理人员职责及报告要求。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及结算管理办法》、《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》、《中意资产管理有限责任公司股指期货从业人员守则》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和会计核算系统及自建的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。
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。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》《关于中意资产管理有限责任公司组织架构调整的通知》《关于进一步明确股指期货投资相关事项的通知》《关于中意资产管理有限责任公司部门名称变更的通知》设立了股指期货交易相关职能部门（包括组合管理部、权益投资部、交易部、运营管理部、风险管理部、法律合规部、财务部、审计部等），设置了股指期货业务的投资交易、风险管理、清算核算、内部审计稽核等岗位，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，实行严格的业务分离制度并保证岗位、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：	2023-01-16	文件名称（含文号）：	《关于进一步明确股指期货投资相关事项的通知》 (中意资管[2023]人力4号)

岗位设置：交易

2

部门名称：	权益投资部		
发文时间：	2023-01-16	文件名称（含文号）：	《关于进一步明确股指期货投资相关事项的通知》 (中意资管[2023]人力4号)

岗位设置：分析研究, 投资

3

部门名称：	组合管理部		
发文时间：	2023-01-16	文件名称（含文号）：	《关于进一步明确股指期货投资相关事项的通知》 (中意资管[2023]人力4号)

岗位设置：股指期货投资负责人, 资产配置, 量化投资研究

### 风险管理部门

1

部门名称：	法律合规部		
发文时间：	2023-01-16	文件名称（含文号）：	《关于进一步明确股指期货投资相关事项的通知》 (中意资管[2023]人力4号)

岗位设置：法律合规岗

2

部门名称：	风险管理部		
发文时间：	2023-01-16	文件名称（含文号）：	《关于进一步明确股指期货投资相关事项的通知》 (中意资管[2023]人力4号)

岗位设置：风险控制岗

### 清算核算部门

1

部门名称：	运营管理部		
发文时间：	2023-01-16	文件名称（含文号）：	《关于进一步明确股指期货投资相关事项的通知》 (中意资管[2023]人力4号)

岗位设置：核算岗, 清算岗

### 内部稽核部门

1

部门名称：	审计部		
-------	-----	--	--

发文时间:	2023-01-16	文件名称(含文号):	《关于进一步明确股指期货投资相关事项的通知》 (中意资管[2023]人力4号)
岗位设置:	审计岗		
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項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	陈清夷	交易	否	期货或证券业务经验	已通过	12.42
2	王天一	审计岗	否	期货或证券业务经验	已通过	5.64
3	谷风	分析研究	否	期货或证券业务经验	已通过	14.50
4	臧怡	投资	否	期货或证券业务经验	已通过	20.13
5	汪欣	法律合规岗	否	期货或证券业务经验	已通过	10.61
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	12.42
7	聂小军	资产配置	否	期货或证券业务经验	已通过	12.42
8	李香蓉	量化投资研究	否	期货或证券业务经验	已通过	5.46
9	李香蓉	量化投资研究	否	期货或证券业务经验	已通过	5.46
10	张玉亮	核算岗	否	期货或证券业务经验	已通过	8.67
11	王润	清算岗	否	期货或证券业务经验	已通过	4.49
12	张繁超	风险控制岗	否	期货或证券业务经验	已通过	8.71
13	张敏生	风险控制岗	否	期货或证券业务经验	已通过	10.09

## 五、投资规则与基本制度

整体评估情况:
---------

准风险期，对货明有限。货事权内双全险险产股  
批风指项管办衡指司和合环包、务意确  
机定《等资管紧司，制调重原原货《  
授权制议输意易节公则务协，的明期了则，业中明  
授均协传中交环任原业、衡制透指定守则，  
其，方据《货各责的货职制控范股制工作  
层化了及度指晰，有经指司相风、明公的  
经略纪风资任务资理会制关法追理、专业  
理变署制股清理健股各位确则，员  
管生签控理司程管稳定、岗明原构台人员  
营发商险管公流产、制约键》究架后专业  
事交期结期有确《统理、执管、风前人  
董或、理指理，和、管离可险则、司易管  
过易人管股管工》权资分程风原公交主  
易货算货限保中一委相行理责任  
制指司、责任意理分公门管货时理指货  
经交管金司产分度授投互流务用入货易  
均货托证公资任制级司相理业适纳期交  
度期与保任意责任分公门管货时理指货  
制指司、责中确管循权部险期适管股期交  
相关股公拨限《明资遵授各风指、险盖股指期交  
参与。划有和，投需会司和股则风、履盖股指期交  
批金理》程、货务事公作司原货  
制度户审资管法过期业董，操公墙期  
制账户的产办全指货司心、务任火指  
理个人务理等股期公中业责防股  
管每策业意管算司指，为保限、将  
易司决货中算结公股构会确有则，  
制指司、责中确管循权部险期适管股期交  
公关期《结与任展机员，理原则，控员度。  
交易公司。有指了和算责开策委责管性原险人制  
品。有指了和算责开策委责管性原险人制  
的有效下管，公证交管明的投了中则要的期则  
行及股定理清限司决理职产立大风业责  
衍执行部定制管、有公高管位资独八要从问  
的发理确司金易理确最资岗意、的主货及  
式险》。保、产，务以确《原重门指守  
建立正，并营权司研了管期制织公、务的责业  
公司，管的公盖定险指机组。则业及限从  
立公司，托方任涵制风股策制核原与涉有货  
公司以方资三责，司务是决控复性制制理期

## 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交易管理办法, 发文文号: 中意资管【2025】组合管理77号, 发文时间: 2025-07-14; 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【2025】组合管理78号, 发文时间: 2025-07-14; 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【2025】组合管理79号, 发文时间: 2025-07-14;
与交易结算机构签署协议文件	符合规定	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【2025】组合管理77号, 发文时间: 2025-07-14; 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【2025】组合管理78号, 发文时间: 2025-07-14;
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业务风险管理办法, 发文文号: 中意资管【2025】组合管理76号, 发文时间: 2025-07-14; 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【2025】组合管理79号, 发文时间: 2025-07-14;
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投资重大突发事件专项应急预案, 发文文号: 中意资管【2022】组合管理1号, 发文时间: 2022-01-06; 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【2025】组合管理76号, 发文时间: 2025-07-14;
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从业人员守则, 发文文号: 中意资管【2025】组合管理75号, 发文时间: 2025-07-14;
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业务风险管理办法, 发文文号: 中意资管【2025】组合管理76号, 发文时间: 2025-07-14; 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【2025】组合管理79号, 发文时间: 2025-07-14;

## 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:

公司综合运用金仕达公司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和会计核算系统及自建的FDA系统等，建立了股指期货交易的投资交易、风险管理及会计核算等信息系统。公司股指期货交易的信息系统已包括业务处理设备、交易软件和操作系统等，股指期货交易管理系统稳定高效，均能满足交易需求。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，能够实现股指期货交易的实时监控，动态监测相关风险控制指标，各项风险管理指标固化在系统中，能够及时根据市场变化对交易作出风险预警。公司通过自建的FDA系统，可计算对冲资产组合风险所需的衍生品数量，能够根据市场变化，调整衍生品规模，逐步实现担保品动态调整。公司配备了恒生公司的资产估值和会计核算系统作为资产估值和核算系统，具备相应的股指期货估值与清算模块，会计确认、计量、账务处理及财务报告符合规定。公司交易结算系统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。以上系统均通过可靠性测试。经评估，公司股指期货交易的信息系统建设符合《保险机构衍生品运用管理能力标准》等有关要求。

### 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、光大等多家期货柜台，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，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、担保品数量和保证金风险度进行及时监控，并依此进行动态调整，确保对冲有效和担保品充足，实现担保品的动态调整。		

### 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。系统配备了相应的股指期货估值与清算模块，会计确认、计量、账务处理及财务报告均遵循相应的会计准则，估值系统运行稳定，能够满足运营人员日常的估值需求。产品托管均选取合规可靠的银行，运营人员每日与托管行进行清算数据核算，对账，确保估值数据的准确。		

### 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:

## 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，我公司对保险资管公司衍生品运用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。