

华安财保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-20250121）

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：	徐军	职务：	副董事长（代行董事长职责）
行政责任人类型：	董事长	是否履行完备的授权程序：	
行政责任人性别	男	行政责任人出生年月	1976-04
行政责任人学历	本科	行政责任人学位	学士
行政责任人所在部门	董事会	行政责任人入司时间	2019-02-11
行政责任人专业资质	无	行政责任人专业技术职务	无
专业责任人：	程学志	职务：	投资总监兼权益投资部总经理
专业责任人类型：	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	1971-02
专业责任人学历	研究生学历	专业责任人学位	博士学位
专业责任人入司时间	2024-04-02	专业责任人所在部门	权益投资部
专业责任人专业资质	10年以上金融工作经历	专业责任人专业技术职务	无

二、基本条件

整体评估情况：	
1. 公司治理结构：公司具有良好的治理结构，按照法律法规和《公司章程》的规定，公司已经建立了包括股东大会、董事会、监事会、经营管理层、经营管理层下设专门委员会及各职能部门在内的完备的公司治理架构，各层级能够各司其职、规范运作，且能保持相互制衡；建立了一系列完备规范的议事规则和工作细则，合理有效的决策机制以及系统完整的决策评估机制。股东大会是公司最高权力机构；董事会是公司经营决策的常设机构，对股东会负责，根据章程规定及董事会议事规则履行公司管理职能；公司董事会下设战略发展与投资管理委员会、风险管理委员会、关联交易控制委员会共五个专门委员会。董事会各专门委员会在董事会授权下按照各自工作细则规定的职责权限和工作程序开展工作，并坚持诚信、尽职、勤勉的执业精神，完成董事会赋予的任务，有效运作；公司监事会和专门委员会及经营管理层履行监督、经营管理层在章程规定以及董事会授权范围内履行公司管理职能；股东会、董事会及专门委员会按照其议事规则或工作细则履行职责，经营管理层按照《总裁工作细则》《总裁办公会议事规则》履行职责，经营管理层下设专门委员会分别按照其议事规则履行职责。公司制定并发布各职能部门部门职责，各部门按照相关要求履责。	2. 衍生品交易业务操作、内部控制、风险管理制度：公司制定《股指期货投资交易管理办法》《金融衍生品业务管理办法》《金融衍生品交易业务问管理理办法》，相关情况如下：1）《股指期货投资交易管理办法》明确了股指期货投资交易各环节要求。该办法同时规定了股指期货投资组织架构及职责、授权管理以及在期货三方协议签署、期货开户、期货交易账号配置、资金调拨、套保额度申请、期货风控指标设置等重要环节实行双人复核制的要求，体现内部控制要求。2）《金融衍生品业务风险管理办法》规定了公司衍生品业务风险管理方面的组织架构和职责，投资和交易流程控制，体现风险管理相关内控要求，并规定了合作机构及交易对手管理、风险分析、评估和应对以及监管报告等风险管理要求。3）《金融衍生品投资交易业务问管理理办法》中包括股指期货交易主管人员和专业人员的工作守则。
3. 系统建设：公司股指期货投资交易通过投资O32系统实现，并通过投资估值管理系统对股指期货投资交易业务进行会计核算，风险管理信息系统包括恒生投资管理系统以及恒生绩效评估与风险管理系统，对公司衍生品投资风险进行控制、评估。	4. 衍生品交易专业管理人员：公司配备衍生品交易专业管理人员，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：公司权益投资部设置研究员岗、投资经理岗，交易部设置权益交易员岗，运营部设置清算岗与核算岗，风险管理部设置风险管理岗，审计部设置审计岗，相关岗位配备相应人员负责股指期货交易相关工作，涵盖了分析研究、投资交易、财务处理、风险控制和审计稽核等具体方面。
5. 公司近两年未受到监管机构重大行政处罚	
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：			
（一）董事会层面 1、公司第一届第二次董事会审议通过了《关于批准开展股指期货交易等新业务的议案》，明确批准开展包括股指期货交易在内的投资交易业务，并明确知晓各项业务的风险。 同时，公司《全面风险管理办法》明确开展衍生品投资等可能存在较大风险的业务，应确保董事会知晓业务风险。同时，公司《金融衍生品业务风险管理办法》明确董事会承担公司参与衍生品交易的最终责任。 2、董事会制定了《董事会、董事会专门委员会和经营层决策权限及流程》，明确了公司董事会、董事会各专门委员会与经营层之间就相关业务的审批权限划分以及经营层的职责及报审要求。董事会对股东会负责并组织实施股东会决议。经营层对董事会负责，组织实施董事会决议，并负责日常经营管理工作。董事会对经营层的工作予以监督和考核。董事会专门委员会是董事会的辅助决策机构，为董事会决策提供专业意见，就董理事会的专项授权事项作出决策。根据权限设置的规定，经营层需提交董事会审批的议题或方案，涉及专门委员会的，由相关专门委员会在董事会授权范围内做出决议，并报董事会备案；超出专门委员会授权范围的，由相关专门委员会审议通过后再交由董事会审批；其他议题或方案则直接报董事会审批。公司《股指期货投资交易管理办法》明确公司总裁办公会负责在权限范围内审议确定公司股指期货投资交易业务相关的制度；投资管理委员会对股指期货投资交易业务进行投资决策，审议确定各受托账户和资管产品允许开展的股指期货投资交易业务范围、对冲目的及其他重要事项。同时，根据《股指期货投资交易管理办法》，股指期货授权纳入公司投资授权管理体系规定，按照公司年度投资授权方案进行分级审批。按照上述权限及流程应当进一步提交公司董事会及其专门委员会进行审议的，还需进一步提交。 3、公司《金融衍生品业务风险管理办法》进一步明确了管理人员职责及报告要求，明确了总裁办公会、投资管理委员会及各部门的主要职责并规定公司股指期货交易年度风险评估报告应由公司首席风险管理执行官向董事会进行报告。 （二）部门设置层面 1、公司设立权益投资部作为股指期货交易的投资部门、交易部作为交易部门、风险管理部、法律合规部作为风险管理部门、运营部作为清算核算部门，以及审计部作为内部稽核部门，上述各部门分别负责股指期货交易的投资、交易、风险管理、清算核算、内部稽核等工作。以上所有部门均为独立的一级部门，部门职责及岗位设置无交叉重叠，具备防火墙体系，实行严格的业务分离制度，确保了投资交易、风险管理、清算核算、内部稽核等部门独立运作。 2、上述各部门均为独立的一级职能部门，且其中前中后台部门在人员及职责、权限上相互分离、相互制约、各司其职、协调配合。上述投资交易、风险管理、清算核算、内部稽核等部门独立运作。 3、公司发布“华保资发〔2013〕号003号”《关于公司部门设置的决定》、“华保资发〔2018〕28号”《关于公司组织架构调整的决定》、“华保资发〔2019〕74号”《关于公司组织架构调整的决定》分别设立权益投资部、交易部、风险管理部、法律合规部、运营部和审计部。 公司发布“华保资发〔2022〕44号”《关于下发<华安财保资产管理有限责任公司部门职责及岗位设置>的通知》“华保资发〔2023〕30号”《关于华安财保资产管理有限责任公司岗位及职责调整的通知》“华保资发〔2023〕74号”《关于华安财保资产管理有限责任公司岗位及职责调整的通知》“华保资发〔2024〕89号”《关于华安财保资产管理有限责任公司审计部部门及岗位职责调整的通知》，明确了权益投资部、交易部、风险管理部、法律合规部、运营部、审计部相应的部门职责及岗位设置。 公司发布“华保资发〔2021〕3号”《关于下发<华安财保资产管理有限责任公司各部门岗位职责及人员配置情况>的通知》“华保资发〔2022〕43号”《关于下发<华安财保资产管理有限责任公司各部门岗位职责>的通知》“华保资发〔2023〕30号”《关于华安财保资产管理有限责任公司岗位及职责调整的通知》“华保资发〔2023〕74号”《关于华安财保资产管理有限责任公司岗位及职责调整的通知》“华保资发〔2024〕89号”《关于华安财保资产管理有限责任公司审计部部门及岗位职责调整的通知》，明确了权益投资部、交易部、风险管理部、法律合规部、运营部和审计部相应的岗位职责和人员配置要求。 公司发布“华保资发〔2019〕77号”《关于公司各部门主要负责人聘任的决定》、“华保资发〔2019〕97号”《关于徐梓倩女士聘任的决定》、“华保资发〔2020〕002号”《关于部分中层干部职务任免的决定》、“华保资发〔2022〕3号”《关于徐梓倩女士聘任的决定》、“华保资发〔2024〕77号”《关于丁世华等同志任免的通知》等文件，明确了权益投资部、交易部、风险管理部、法律合规部、运营部和审计部的部门负责人人员。			
投资交易部门			
1			
部门名称：		交易部	
发文时间：		2022-08-01	文件名称（含文号）：“华保资发〔2013〕号003号”《关于公司部门设置的决定》、“华保资发〔2022〕44号”《关于下发<华安财保资产管理有限责任公司部门职责及岗位设置>的通知》
岗位设置：		交易员岗,交易部副总经理岗（总经理助理岗）,交易部总经理（副总经理主持工作）,权益交易员岗	
2			
部门名称：		权益投资部	

发文时间：	2023-10-24	文件名称（含文号）：	“华保资发（2018）28号”《关于公司组织架构调整的决定》、“华保资发（2023）74号”《关于华安财保资产管理有限责任公司岗位及职责调整的通知》
岗位设置：	投后管理岗（基金），投资经理助理，投资经理（基金），投资经理（股指期货），投资经理（股票），投资经理（量化），权益投资部副总经理岗（总经理助理岗），权益投资部总经理（副总经理主持工作），研究员（基金），研究员（股指期货），研究员（股票），研究员（量化）		
风险管理部			
1			
部门名称：	法律合规部		
发文时间：	2023-10-24	文件名称（含文号）：	“华保资发（2018）28号”《关于公司组织架构调整的决定》、“华保资发（2023）74号”《关于华安财保资产管理有限责任公司岗位及职责调整的通知》
岗位设置：	关联交易岗，反洗钱岗，法律合规岗，法律合规部副总经理岗/总经理助理岗，法律合规部总经理（副总经理主持工作）		
2			
部门名称：	风险管理部		
发文时间：	2022-08-01	文件名称（含文号）：	“华保资发（2013）号003号”《关于公司部门设置的决定》、“华保资发（2022）44号”《关于下发<华安财保资产管理有限责任公司部门职责及岗位设置>的通知》
岗位设置：	风险管理岗，风险管理部副总经理岗（总经理助理岗），风险管理部总经理（副总经理主持工作）		
清算核算部门			
1			
部门名称：	运营部		
发文时间：	2022-08-01	文件名称（含文号）：	“华保资发（2018）28号”《关于公司组织架构调整的决定》、“华保资发（2022）44号”《关于下发<华安财保资产管理有限责任公司部门职责及岗位设置>的通知》
岗位设置：	核算岗，清算岗，运营部副总经理岗（总经理助理岗），运营部总经理（副总经理主持工作）		
内部稽核部门			
1			
部门名称：	审计部		
发文时间：	2024-08-21	文件名称（含文号）：	“华保资发（2019）74号”《关于公司组织架构调整的决定》、“华保资发（2024）89号”《关于华安财保资产管理有限责任公司审计部部门及岗位职责调整的通知》
岗位设置：	审计岗，审计部副总经理岗（总经理助理岗），审计部总经理（副总经理主持工作）		

防火墙机制：	1、公司设立权益投资部作为股指期货交易的投资部门、交易部作为交易部门、风险管理部、法律合规部作为风险管理部门、运营部作为清算核算部门，以及审计部作为内部稽核部门，上述各部门分别负责股指期货交易的投资、交易、风险管理、清算核算、内部稽核等工作。以上所有部门均为独立的一级部门，部门职责及岗位设置无交叉重叠，具备防火墙体系，实行严格的业务分离制度，确保了投资交易、风险管理、清算核算、内部稽核等部门独立运作。 2、上述各部门均为独立的一级职能部门，且其中前中后台部门在人员及职责、权限上相互分离、相互制约、各司其职、协调配合。上述投资交易、风险管理、清算核算、内部稽核等部门独立运作。 3、公司发布“华保资发〔2013〕号003号”《关于公司部门设置的决定》、“华保资发〔2018〕28号”《关于公司组织架构调整的决定》、“华保资发〔2019〕74号”《关于公司组织架构调整的决定》分别设立权益投资部、交易部、风险管理部、法律合规部、运营部和审计部。 公司发布“华保资发〔2022〕44号”《关于下发〈华安财保资产管理有限责任公司部门职责及岗位设置〉的通知》“华保资发〔2023〕30号”《关于华安财保资产管理有限责任公司岗位及职责调整的通知》“华保资发〔2023〕74号”《关于华安财保资产管理有限责任公司岗位及职责调整的通知》“华保资发〔2024〕89号”《关于华安财保资产管理有限责任公司审计部部门及岗位职责调整的通知》，明确了权益投资部、交易部、风险管理部、法律合规部、运营部、审计部相应的部门职责及岗位设置。 公司发布“华保资发〔2021〕3号”《关于下发〈华安财保资产管理有限责任公司各部门岗位职责及人员配置情况〉的通知》“华保资发〔2022〕43号”《关于下发〈华安财保资产管理有限责任公司各部门岗位职责〉的通知》“华保资发〔2023〕30号”《关于华安财保资产管理有限责任公司岗位及职责调整的通知》“华保资发〔2023〕74号”《关于华安财保资产管理有限责任公司岗位及职责调整的通知》“华保资发〔2024〕89号”《关于华安财保资产管理有限责任公司审计部部门及岗位职责调整的通知》，明确了权益投资部、交易部、风险管理部、法律合规部、运营部和审计部相应的岗位职责和人员配置要求。 公司发布“华保资发〔2019〕77号”《关于公司各部门主要负责人聘任的决定》、“华保资发〔2019〕97号”《关于徐梓倩女士聘任的决定》、“华保资发〔2020〕002号”《关于部分中层干部职务任免的决定》、“华保资发〔2022〕3号”《关于徐梓倩女士聘任的决定》、“华保资发〔2022〕56号”《关于张雅硕等任免的决定》、“华保资发〔2024〕49号：《关于程学志等同志任免的通知》、“华保资发〔2024〕77号”《关于丁世华等同志任免的通知》，明确了权益投资部、交易部、风险管理部、法律合规部、运营部和审计部的部门负责人。
评估结果：	符合规定

四、专业队伍

整体评估情况：						
公司配备的股指期货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，其中资产配置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；从事资产配置和投资交易、风险控制、清算和核算等业务的专业人员均已通过期货从业人员资格考试，投资交易、风险控制和清算核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。 另有分析研究专业人员1人，财务处理专业人员1人，审计稽核专业人员1人。 经评估，公司符合《保险机构衍生品运用管理能力标准——股指期货》的要求。						
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	张雅硕	交易部总经理	否	期货或证券业务经验	已通过	12.90
2	王子轩	权益交易员岗	否	期货或证券业务经验	已通过	7.81
3	沙娅	审计岗	否	其他	未通过	2.92
4	廖乐一	投资经理（股指期货）	否	期货或证券业务经验	已通过	9.56
5	张世良	投资经理（股指期货）	否	期货或证券业务经验	已通过	6.56
6	房晓	投资经理（股指期货）	否	期货或证券业务经验	已通过	11.60
7	张远江	投资经理（股指期货）	否	期货或证券业务经验	已通过	14.56

8	李 郢	法律合规岗	否	其他	已通过	13. 14
9	岳慧宏	核算岗	否	其他	已通过	7. 56
10	王欣宇	清算岗	否	期货或证券业务经验	已通过	3. 24
11	朱 云	运营部总经理（副经理主持工作）	否	其他	已通过	12. 81
12	卫西文	风险管理岗	否	其他	已通过	13. 28
13	徐梓倩	风险管理部总经理（副经理主持工作）	否	其他	已通过	12. 43

五、投资规则与基本制度

整体评估情况：		
【衍生品交易管理制度】公司通过《股指期货投资交易管理办法》（华保资发〔2023〕79号）《金融衍生品业务风险管理办法》（华保资发〔2024〕125号）《金融衍生品投资交易业务问责管理办法》（华保资发〔2023〕104号）等制度构建公司完善、有效的衍生品交易管理制度体系，相关制度已经过公司总裁办公会审议批准并已下发执行。 【风险对冲方案】《金融衍生品业务风险管理办法》明确投资组合首次进行衍生品交易前，投资经理应制定风险对冲方案，提交投资部门负责人、投资部门分管领导及风险管理部门负责人审核通过后执行。目前，公司实际业务操作中根据账户/组合的规模、投资目标和股票现货资产的特征拟定风险对冲方案，并经公司风险管理部门审核确认，按公司制度要求完成投资部门负责人、投资部门分管领导及风险管理部门负责人审核通过后实施执行。具体审批流程通过公司OA系统实现。 【与交易结算机构签署协议】《股指期货投资交易管理办法》明确运营部负责与交易结算机构签署协议文件。公司当前合作的交易结算机构为中信期货、银河期货、东证期货三家期货公司，公司已经按照监管要求与之分别签署了相应协议文件，并在协议中明确了双方的权利和义务，约定了包括但不限于股指期货业务的账户管理、保证金划拨、保证金管理和结算、期货交易及费用、风险控制、结算数据传输与接收、资金划拨、清算、估值等事项，明确双方的权利和义务。 【交易业务操作制度】公司制定《股指期货投资交易管理办法》，就包括投资研究、投资决策、投资交易、保证金管理、清算与结算处理等环节的股指期货投资交易业务全流程作出规定，流程清晰且各环节紧密衔接，并明确了各环节中相关部门及人员的分工及责任。投资决策方面，股指期货投资交易纳入公司整体投资决策体系，按照公司《决策授权及审批管理办法》及各年度业务授权方案进行分级授权、逐级审批。 【内部控制制度】公司制定《股指期货投资交易管理办法》及《金融衍生品业务风险管理办法》。《股指期货投资交易管理办法》明确了股指期货投资业务组织架构和部门职责，明确相关部门对应岗位具体履行相关职责，以及业务全流程，确保业务操作和管理流程可执行。并规定期货三方协议签署、期货开户、期货交易账户配置、资金调拨、套保额度申请、期货风控指标设置等重要环节实行双人复核制。股指期货投、资交易指令由投资经理下达，交易员对交易指令的合规性和合理性进行检查，并相应执行交易指令，如遇差错及异常行为，及时反馈投资经理及风险管理部门；此外，运营部门负责每日核对交易数据，如发现存在相位交易数据差异，也需要向投资经理反馈并妥善处理，据此，股指期货相关的投资、交易、运营等关键岗位实现了相互制衡。《金融衍生品业务风险管理办法》明确了各部门在衍生品投资等业务、风险管理方面的职责。 【风险管理制度】公司建立了《金融衍生品业务风险管理办法》，明确开展衍生品投资等可能存在较大风险的业务，确保董事会知晓业务风险。公司建立《金融衍生品业务风险管理办法》，明确了衍生品业务风险管理三道防线（即权益投资部门、固定收益投资部门、交易部门等股指期货交易前台部门作为风险管理第一道防线，风险管理部门、法律合规部门、信用评估部门等股指期货交易中台部门作为风险管理第二道防线，审计部门等后台部门作为风险管理的第三道防线）及相关风险责任。董事会承担公司参与衍生品交易的最终责任，审议年度风险评估报告或衍生品业务专项风险报告。其中年度风险评估报告应由公司首席风险管理执行官向董事会进行报告。 【问责制度】公司建立《问责管理办法》，全面规范公司问责工作规范；公司专门制定《金融衍生品投资交易业务问责管理办法》，明确了金融衍生品投资交易业务中的问责情形和问责方式，制度中包括股指期货交易主管人员和专业人员的工作行为守则。相关制度均已正式发文。 公司符合《保险机构衍生品运用管理能力——股指期货》的要求。		
衍生品交易管理制度：		
制度内容	评估结果	制度明细
问责制度	符合规定	文件名称：华安财保资产管理有限责任公司金融衍生品投资交易业务问责管理办法， 发文文号：华保资发〔2023〕104号， 发文时间：2023-12-19；
风险对冲方案	符合规定	文件名称：华安财保资产管理有限责任公司金融衍生品业务风险管理办法， 发文文号：华保资发〔2024〕125号， 发文时间：2024-09-27；

风险管理制度	符合规定	文件名称：华安财保资产管理有限责任公司金融衍生品业务风险管理办法， 发文文号：华保资发〔2024〕125号， 发文时间：2024-09-27；
内部控制制度	符合规定	文件名称：华安财保资产管理有限责任公司金融衍生品业务风险管理办法， 发文文号：华保资发〔2024〕125号， 发文时间：2024-09-27； 文件名称：华安财保资产管理有限责任公司股指期货投资交易管理办法， 发文文号：华保资发〔2023〕79号， 发文时间：2023-11-09；
衍生品交易业务操作制度	符合规定	文件名称：华安财保资产管理有限责任公司自有资金投资业务授权方案， 发文文号：华保资发〔2023〕63号， 发文时间：2023-10-09； 文件名称：华安财保资产管理有限责任公司决策授权及审批管理办法， 发文文号：华保资发〔2023〕80号， 发文时间：2023-11-14； 文件名称：华安财保资产管理有限责任公司股指期货投资交易管理办法， 发文文号：华保资发〔2023〕79号， 发文时间：2023-11-09； 文件名称：华安财保资产管理有限责任公司第三方资金投资业务授权方案， 发文文号：华保资发〔2025〕6号， 发文时间：2025-01-17； 文件名称：华安财保资产管理有限责任公司华安保险专户资金投资业务基础授权方案， 发文文号：华保资发〔2024〕129号， 发文时间：2024-10-09；
与交易结算机构签署协议文件	符合规定	文件名称：华安财保资产管理有限责任公司股指期货投资交易管理办法， 发文文号：华保资发〔2023〕79号， 发文时间：2023-11-09；

六、托管机制

整体评估情况：
公司按照监管要求，与托管行均签署了相应协议文件，明确了双方的职责和义务，约定了包括但不限于股指期货业务的资金划拨，清算、核算估值等事项，明确双方的权利和义务。 经评估，符合《保险机构衍生品运用管理能力标准—股指期货》的要求。

七、系统建设

整体评估情况：
公司建立了股指期货交易相关的信息系统，具体包括： 恒生投资交易管理系统V03.2支持对指定组合创建套保方案，通过回归分析、时变分析、头寸计算进行合约选择，并通过情景分析、保证金分析、历史重现分析风险，确定用于套保的股指期货情况；可以在该方案运行期方案的各项指标作实时监控，让投资者更加准确的关注自己的方案的运行情况并适时调整现货、期货持仓。 投资估值管理系统引入目前行业主流的资产估值与会计核算系统，该系统可无缝对接恒生交易系统，处理国内各交易市场的股指期货在内的全部交易品种和不同产品形式的估值核算业务。系统完整的覆盖了投资组合估值核算的所有价值链，系统运行稳定高效，且能够满足我司估值需求，为我司投资运营提供了保障。 通过恒生估值核算系统我司股指期货业务会计确认、计量、账务处理及财务报告符合相关规定。 风险管理与绩效评估系统采用恒生投资绩效评估与风险管理系统，主要包括风险监控与预警、绩效评估体系、风险分析体系三大模块，支持多种金融模型，能够及时为公司提供多种风险及时有效的风险分析和绩效分析。该系统多角度查询账户信息、账户资产、分类资产、持仓查询、历史交易查询，能够进行股指期货数据分析，同时也支持多种数据统计分析和报表生成等功能。 公司通过中信期货、银河期货和东证期货三家期货商进行股指期货交易，并且与每家期货公司都同时配备主线与备线，并定时开展灾备演练。系统上线以来，各项业务稳定运行，满足交易要求。 经评估，公司已建立股指期货交易的投资交易、会计核算和风险管理等信息系统。信息系统包括业务处理设备、交易软件和操作系统等，并通过可靠性测试。公司符合《保险机构衍生品运用管理能力标准——股指期货》的要求。
交易结算系统：

系统名称	恒生投资交易管理系统V03.2		
上线时间	2014-11-11	评估结果	符合规定
主要功能	交易结算系统采用的是恒生投资交易管理系统V03.2，系统可以支持对股指期货交易清算，通过日终接收期货公司对账单、交易流水等清算数据进行系统自动对账。公司通过中信期货、银河期货、东证期货三家券商进行股指期货交易，并且与每家期货公司都同时配备主线与备线，并定时开展灾备演练。系统上线以来，各项业务稳定运行，满足交易要求。		
投资分析系统：			
系统名称	恒生投资交易管理系统V03.2		
上线时间	2014-11-11	评估结果	符合规定
主要功能	恒生投资交易管理系统V03.2支持对指定组合创建套保方案，通过回归分析、时变分析、头寸计算对冲资产组合风险所需的衍生品数量以进行合约选择，并通过情景分析、保证金分析、历史重现分析风险，确定用于套保的股指期货情况；可以在相应的套保方案的运行期对方案的各项指标作实时监控，根据市场变化，更加准确的关注套保方案的运行情况并适时调整现货、期货等衍生品持仓规模，逐步实现担保品动态调整。		
资产估值和核算系统：			
系统名称	恒生估值核算系统		
上线时间	2014-11-11	评估结果	符合规定
主要功能	资产估值和核算系统采用的是恒生资产估值与会计核算系统，该系统可无缝对接恒生投资交易系统，处理国内各交易市场包括股指期货在内的全部交易品种和不同产品形式的估值核算业务，系统完整的覆盖了投资组合估值核算的所有价值链；该系统具备股指期货模块，能够满足会计确认、计量、账务处理及财务报告相关功能并符合相关规定。系统运行稳定高效，能够满足估值需求，为我司投资运营提供了保障。 经评估，符合《保险机构衍生品运用管理能力标准—股指期货》的要求。		
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		
上线时间	2014-11-11	评估结果	符合规定
主要功能	风险管理与绩效评估系统采用恒生投资绩效评估与风险管理系统和恒生恒生投资交易管理系统V03.2风控模块。主要包括风险监控与预警、绩效评估体系、风险分析体系三大模块，支持多种金融模型，能够及时为公司提供多种风险及时有效的风险分析和绩效分析。该系统多角度查询账户信息、账户资产、衍生品分析、绩效查询、分类资产、持仓查询、历史交易查询，能够进行股指期货的数据分析和股指期货交易的实时风险监控。同时也支持多种数据统计分析和报表生成等功能。 经评估，符合《保险机构衍生品运用管理能力标准—股指期货》的要求。		

八、风险管理

整体评估情况：

(一) 动态风险管理机制
公司将衍生品风险纳入公司全面风险管理框架。公司制定《股指期货投资交易管理办法》对股指期货投资交易业务全流程作出规定。公司《金融衍生品业务风险管理办法》中明确衍生品投资风险的识别、评估和预警流程，同时明确公司建立符合监管规定的投资管理系统和风险管理系统，支持将核心风险指标固化在系统中，并实现对衍生品交易的实时监控和预警；同时明确衍生品投资风险的识别、评估与预警管理流程；明确了衍生品发生重大风险或出现性质严重、影响重大的交易违规行为、异常情况，投资管理部门和合规部门应同时采取法律措施降低风险，并立即向分管领导、风险管理部报告；违规事项应及时向法律合规部和合规部报告。报告内容应包括事件的简要经过和影响评估、已采取和拟采取的应对措施、需要有关部门协调和处理的相关事宜等，不得瞒报、缓报、漏报、谎报。重大风险界定标准及后续应对处置流程，按照公司风险应对及重大风险应急管理相关规定执行。在重大风险、交易违规行为、异常情况应对结束后，相关部门应对相关事件的发生原因进行分析，制定整改措施并实施整改，防范类似事件的再次发生。

《金融衍生品业务风险管理办法》具体执行情况：1) 风险管理部通过事前控制（主要包括审核股指期货对冲方案，并根据监管及内部制度要求在032中设置股指期货风控阈值）和事中控制（包括在盘中通过032阈值对股指期货交易比例进行控制，对保证金情况进行预警）将核心风险指标固化在系统中，并实现对衍生品交易的实时监控和预警（指标阈值设置情况见附件）；2) 风险管理部独立分析套保有效性并将异常情况告知投资部门；季度编制衍生品交易报告，内容包括投资交易情况、对冲有效性情况等。3) 2024年全年，公司股指期货投资未发生符合《资产管理重大风险事件应急预案及管理办法》的风险事件。

公司的风险管理信息系统包括恒生投资管理系统以及恒生绩效评估与风险管理系统，对公司衍生品投资风险进行控制与评估。恒生投资管理系统可通过阈值设置实现事前控制和实时预警，恒生绩效评估与风险管理系统可以协助实现衍生品交易的定期监测、评估。

(二) 风险对冲有效性预警机制
公司《金融衍生品业务风险管理办法》中明确了投资组合首次进行衍生品交易前，投资经理应根据资产配置要求和风险管理要求，制定合理的交易策略，经投资部门负责人及分管领导审批后执行。交易策略应符合监管规定及经审批的风险对冲方案。投资经理应至少每月评估风险对冲方案的有效性，并及时调整交易策略或对冲方案以保障对冲有效性的合理水平。交易策略或对冲方案变更，应重新履行审批流程。投资经理应至少每月分析衍生品风险对冲方案的执行情况，如偏差较大，应及时调整交易行为。风险管理部通过投资管理系统风控阈值等方式，动态监测相关风险控制指标。风险管理部应对衍生品风险对冲的有效性进行独立评估，对对冲有效性不足的情形，以邮件形式对投资经理作出风险预警或提示。

(四) 定期监督检查
公司《金融衍生品业务风险管理办法》已明确审计部门应定期对衍生品交易的风险管理情况进行监督检查，编制半年和年度稽核审计报告。检查和报告内容应至少包括衍生品交易活动合规情况；业务操作、内部控制及风险管理制度执行情况；专业人员资质情况；回溯衍生品买入计划与实际执行的偏差；避险政策及其有效性评估等。

(五) 稽核审计报告
公司根据监管规定及公司制度要求，编制半年及年度稽核审计报告，按规定向监管机构报告。2024年度（并截至本次披露日），公司已经按要求完成《华安财保资产管理有限责任公司2023年度衍生品交易专项审计报告》（华保资发〔2024〕46号）、《华安财保资产管理有限责任公司2024年上半年衍生品交易专项审计报告》（华保资发〔2024〕160号）。

动态风险管理机制评估：	公司将衍生品风险纳入公司全面风险管理框架。公司制定《股指期货投资交易管理办法》对股指期货投资交易业务全流程作出规定。公司《金融衍生品业务风险管理办法》中明确公司应建立符合监管规定的投资管理系统和风险管理系统，支持将核心风险指标固化在系统中，并实现对衍生品交易的实时监控和预警；同时明确衍生品投资风险的识别、评估与预警管理流程；明确了衍生品发生重大风险或出现性质严重、影响重大的交易违规行为、异常情况，投资管理部门和合规部门应同时采取法律措施降低风险，并立即向分管领导、风险管理部报告；违规事项应及时向法律合规部和合规部报告。报告内容应包括事件的简要经过和影响评估、已采取和拟采取的应对措施、需要有关部门协调和处理的有关事宜等，不得瞒报、缓报、漏报、谎报。重大风险界定标准及后续应对处置流程，按照公司风险应对及重大风险应急管理相关规定执行。在重大风险、交易违规行为、异常情况应对结束后，相关部门应对相关事件的发生原因进行分析，制定整改措施并实施整改，防范类似事件的再次发生。 《金融衍生品业务风险管理办法》具体执行情况：1) 风险管理部通过事前控制（主要包括审核股指期货对冲方案，并根据监管及内部制度要求在032中设置股指期货风控阈值）和事中控制（包括在盘中通过032阈值对股指期货交易比例进行控制，对保证金情况进行预警）将核心风险指标固化在系统中，并实现对衍生品交易的实时监控和预警（指标阈值设置情况见附件）；2) 风险管理部独立分析套保有效性并将异常情况告知投资部门；季度编制衍生品交易报告，内容包括投资交易情况、对冲有效性情况等。3) 2024年全年，公司股指期货投资未发生符合《资产管理重大风险事件应急预案及管理办法》的风险事件。 公司的风险管理信息系统包括恒生投资管理系统以及恒生绩效评估与风险管理系统，对公司衍生品投资风险进行控制与评估。恒生投资管理系统可通过阈值设置实现事前控制和实时预警，恒生绩效评估与风险管理系统可以协助实现衍生品交易的定期监测、评估。 综上，公司已建立动态风险管理机制，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：	公司《金融衍生品业务风险管理办法》中明确了风险管理部通过投资管理系统风控阈值等方式，动态监测相关风险控制指标；风险管理部每月对衍生品风险对冲的有效性进行独立评估，对对冲有效性不足的情形，以邮件形式对投资经理作出风险预警或提示。 综上，公司根据公司及资产组合实际情况，动态监测相关风险控制指标，制定风险对冲有效性预警机制，及时根据市场变化对交易作出风险预警。

激励制度和机制评估：	根据公司《员工绩效考核管理办法》，员工绩效考核指标由关键业绩指标、关键任务指标、风险合规指标、评议指标等构成。因此，并未简单地将股指期货交易盈亏与业务人员收入挂钩。 同时，根据员工绩效考核表，公司对股指期货业务人员考核指标未设置股指期货盈亏指标；后台及风险管理部门的考核指标中不涉及业绩指标，上述部门员工的薪酬与交易盈亏情况不挂钩，后台及风险管理部门的人员报酬，独立于交易盈亏情况。
定期监督检查情况评估：	公司《金融衍生品业务风险管理办法》已明确内部审计与稽核部门应当定期对衍生品交易的风险管理情况进行监督检查，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。 公司定期对衍生品交易的风险管理情况进行监督检查，检查包括交易活动合规情况、制度执行情况、人员资质情况、回溯衍生品买入计划与实际执行的偏差、避险政策及有效性评估等，根据检查结果编制半年和年度审计报告。 2024年度，公司按要求完成《华安财保资产管理有限责任公司2023年度衍生品交易专项审计报告》（华保资发〔2024〕46号）、《华安财保资产管理有限责任公司2024年上半年衍生品交易专项审计报告》（华保资发〔2024〕160号）。
回溯分析情况评估：	公司《金融衍生品业务风险管理办法》已明确对于衍生品交易的风险管理情况的检查和报告内容包含回溯衍生品买入计划与实际执行的偏差。公司每半年回溯公司股指期货交易买入计划与实际执行的偏差，将该内容纳入每半年及年度稽核检查报告，按规定向监管机构报告。 公司每半年回溯买入计划与实际执行的偏差并将相关检查结果纳入半年和年度审计报告中，按规定向监管报告。 2024年度（截至本次披露），公司按要求完成《华安财保资产管理有限责任公司2023年度衍生品交易专项审计报告》（华保资发〔2024〕46号）、《华安财保资产管理有限责任公司2024年上半年衍生品交易专项审计报告》（华保资发〔2024〕160号）。 上述审计报告已经向监管报送，报文号：华保资报〔2024〕141号、华保资报〔2024〕374号。

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。