

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—20220126）

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：	张震	职务：	总裁
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	1981-07
行政责任人学历	硕士研究生	行政责任人学位	硕士研究生
行政责任人所在部门	总裁室	行政责任人入司时间	2019-08-19
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：	贺鹏飞	职务：	副总裁
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	1982-12
专业责任人学历	硕士研究生	专业责任人学位	硕士研究生
专业责任人入司时间	2018-04-24	专业责任人所在部门	总裁室
专业责任人专业资质	注册会计师	专业责任人专业技术职务	无

二、基本条件

整体评估情况：	
1、公司具有良好的公司治理结构：公司建立了包括股东会、董事会、董事会专业委员会、监事会、经营管理层、经营管理层下设专业委员会及各职能部门在内的公司治理架构。股东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；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、董事会及专业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》履行职能，经营管理层下设专业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职。 2、公司制定《股指期货投资交易管理办法》《金融衍生品投资交易业务风险管理办法》《金融衍生品投资交易业务问责管理办法》《金融衍生品投资交易业务专业人员工作守则》，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业务各环节要求。该办法同时规定了股指期货投资交易组织架构及职责、授权管理以及在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)《金融衍生品投资交易业务风险管理办法》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。 上述制度均已通过“华保资发〔2021〕4号”《关于调整金融衍生品投资交易相关制度的通知》发布。 3、公司股指期货投资交易通过投资032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、公司权益投资部设置研究员（股指期货）岗、投资经理（股指期货）岗，交易部设置权益交易岗，运营部设置清算岗与核算岗，风险管理部设置风险管理岗，法律合规部设置法律合规岗，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。 公司近两年未受到监管机构重大行政处罚。 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。	
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。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、董事会专业委员会和经营层决策权限及流程》，明确了公司董事会与经营层之前就相关业务的审批权限划分。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《决策授权及审批管理办法（试行）》及各年度业务授权方案进行分级授权、逐级审批。按照上述权限及流程应当进一步提交公司董事会及其专业委员会进行审议的，还需进一步提交。
- 3、公司《金融衍生品业务风险管理办法》中明确了管理人员职责及报告要求，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、运营部作为清算核算部门，以及审计部与母公司稽核人员共同作为内部稽核部门，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。
 - 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〔2020〕59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〔2022〕6号”《关于华安财保资产管理有限责任公司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。
- 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〕6号”《关于华安财保资产管理有限责任公司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》及“华保资发〔2019〕97号”《关于徐梓倩女士聘任的决定》、“华保资发〔2022〕3号”《关于徐梓倩女士聘任的决定》，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。
- 经评估，公司符合《保险机构衍生品运用管理能力——股指期货》的要求。

投资交易部门

1

部门名称：	交易部		
发文时间：	2022-01-26	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〕6号”《关于华安财保资产管理有限责任公司部门及岗位职责调整的通知》
岗位设置：	交易部总经理，权益交易员岗		

2

部门名称：	权益投资部		
发文时间：	2020-10-30	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〔2020〕59号”《华安财保资产管理有限责任公司部门职责及岗位设置》
岗位设置：	投资经理（股指期货）岗，研究员（股指期货）岗		

风险管理部

1

部门名称：	法律合规部		
发文时间：	2020-10-30	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〔2020〕59号”《华安财保资产管理有限责任公司部门职责及岗位设置》

岗位设置:	法律合规岗		
2			
部门名称:	风险管理部		
发文时间:	2020-10-30	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(2020)59号”《华安财保资产管理有限责任公司部门职责及岗位设置》
岗位设置:	风险管理岗,风险管理部总经理		
清算核算部门			
1			
部门名称:	运营部		
发文时间:	2022-01-26	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(2020)59号”《华安财保资产管理有限责任公司部门职责及岗位设置》
岗位设置:	核算岗,清算岗,运营部副总经理(主持工作)		
内部稽核部门			
1			
部门名称:	董事会办公室/审计部		
发文时间:	2020-10-30	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(2022)6号”《关于华安财保资产管理有限责任公司部门及岗位职责调整的通知》
岗位设置:	审计岗		
防火墙机制:	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、风险管理部及法律合规部作为风险管理部门、运营部作为清算核算部门,以及审计部与母公司稽核人员(母公司稽核调查部依据母公司“华保发[2006]302号”文件,于2006年9月21日设立,稽核调查部职能为:是公司内部经营管理的监督部门。为了降低公司经营风险和经营成本,确保公司经营业绩的真实性和管理的规范性,根据监管的法律法规以及公司内部管理制度,健全公司内部经营风险监督机制,监督公司经营业务的全过程,包括对经营业务活动、财务管理、两核管理等进行事前、事中、事后的监督、检查、评价。)共同作为内部稽核部门,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。 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。		
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,其中资产配置专业人员1人,投资交易专业人员4人,分析研究专业人员1人,财务处理专业人员1人,风险控制专业人员3人,清算和核算专业人员2人,审计稽核专业人员1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。 经评估,公司符合《保险机构衍生品运用管理能力——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	吴双	交易部总经 理	否	期货或证券业务经验	已通过	8.39

2	廖乐一	投资经理 (股指期货) 岗	否	期货或证券业务经验	已通过	6.57
3	房晓	投资经理 (股指期货) 岗	否	期货或证券业务经验	已通过	8.39
4	李权葆	投资经理 (股指期货) 岗	否	期货或证券业务经验	已通过	4.54
5	张文浩	投资经理 (股指期货) 岗	否	期货或证券业务经验	未通过	5.53
6	李泉霖	投资经理 (股指期货) 岗	否	期货或证券业务经验	已通过	10.48
7	李郢	法律合规岗	否	其他	已通过	9.94
8	王娜	审计岗	否	其他	未通过	6.24
9	岳慧宏	核算岗	否	其他	已通过	3.57
10	韩亚萌	清算岗	否	其他	未通过	1.56
11	朱云	运营部副总 经理(主持 工作)	否	其他	已通过	4.95
12	卫西文	风险管理岗	否	其他	已通过	10.32
13	徐梓倩	风险管理部 总经理	否	其他	已通过	7.73

五、投资规则与基本制度

整体评估情况：		
公司通过《股指期货投资交易管理办法》《金融衍生品投资交易业务风险管理办法》《金融衍生品投资交易业务问责管理办法》《金融衍生品投资交易业务专业人员工作守则》等制度构建公司股指期货交易管理制度体系。公司股指期货交易管理制度体系涵盖对风险对冲方案、交易结算机构协议签署、业务操作、内部控制、风险管理和问责制度。 相关制度已经过公司总裁办公会审议批准，并通过“华保资发〔2021〕4号”《关于调整金融衍生品投资交易相关制度的通知》下发。 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。		
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专业人员工作守则， 发文文号：华保资发〔2021〕4号， 发文时间：2021-01-21； 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〔2021〕4号， 发文时间：2021-01-21；
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投资交易业务风险管理办法， 发文文号：华保资发〔2021〕4号， 发文时间：2021-01-21；
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投资交易业务风险管理办法， 发文文号：华保资发〔2021〕4号， 发文时间：2021-01-21；
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投资交易业务风险管理办法， 发文文号：华保资发〔2021〕4号， 发文时间：2021-01-21； 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〔2021〕4号， 发文时间：2021-01-21；

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股指期货投资交易管理办法， 发文文号：华保资发（2021）4号， 发文时间：2021-01-21； 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（试行）， 发文文号：华保资发（2018）72号， 发文时间：2018-12-14；
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（2021）4号， 发文时间：2021-01-21；

六、托管机制

整体评估情况：
《股指期货投资交易管理办法》明确运营部负责与托管行签署协议文件。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调拨，核算估值等事项。 经评估，公司符合《保险机构衍生品运用管理能力——股指期货》的要求。

七、系统建设

整体评估情况：			
投资032系统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恒生估值系统，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，为我司投资运营提供了保障。 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。 公司通过中信期货和银河期货两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。 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。			
交易结算系统：			
系统名称	恒生投资交易03.2		
上线时间	2014-11-10	评估结果	符合规定
主要功能	公司通过中信期货和银河期货两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03.2		
上线时间	2014-11-10	评估结果	符合规定
主要功能	投资032系统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	2014-11-10	评估结果	符合规定
主要功能	投资估值管理系统引入目前行业主流的恒生估值系统，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；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。 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	风险管理与绩效评估系统		
上线时间	2014-11-10	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, 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进行分析, 同时也支持多种数据统计分析和报表生成等功能。		

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《金融衍生品投资交易业务风险管理办法》中明确衍生品投资风险的监测、评估与处置管理流程, 同时明确公司建立的符合监管规定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; 明确了衍生品交易发生重大风险事件时应按照公司《资产管理重大风险事件应急预案及管理辦法》进行应急响应和处置, 具有完善的应急机制和管理预案。公司的风险管理信息系统包括恒生投资管理信息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控制与评估。 (二) 风险对冲有效性预警机制 公司《金融衍生品投资交易业务风险管理办法》中明确了风险管理部应对衍生品风险对冲方案的有效性和执行情况独立评估, 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、执行偏离情况对投资经理作出风险预警或提示。公司基于市场走势、市场的流动性、各合约价差变化、展期成本等因素, 谨慎选择合适的品种和合约进行投资, 定期评估套期保值效果, 并在交易过程中通过投资管理系统进行保证金监控和预警。体现了衍生品相关风险指标的动态监测及预警机制。 (四) 定期监督检查 公司《金融衍生品投资交易业务风险管理办法》已明确公司审计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; 并应编制半年和年度稽核审计报告。 (五) 稽核审计报告 公司《金融衍生品投资交易业务风险管理办法》已明确公司审计部门对于衍生品交易的风险管理情况的检查报告和报告内容包含回溯衍生品买入计划与实际执行的偏差。审计部门将根据监管规定及公司制度要求, 每半年和回溯公司股指期货交易买入计划与实际执行的偏差, 并将该内容纳入每半年及年度稽核审计报告, 按规定向银保监会报告。	
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《金融衍生品投资交易业务风险管理办法》中明确公司应建立符合监管规定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; 明确了衍生品交易发生重大风险事件时应按照公司《资产管理重大风险事件应急预案及管理辦法》进行应急响应和处置, 具有完善的应急机制和管理预案。公司的风险管理信息系统包括恒生投资管理信息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控制与评估。
风险对冲有效性预警机制评估:	公司《金融衍生品投资交易业务风险管理办法》中明确了风险管理部应对衍生品风险对冲方案的有效性和执行情况独立评估, 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, 及时根据市场的变化、执行偏离情况对投资经理作出风险预警或提示。公司基于市场走势、市场的流动性、各合约价差变化、展期成本等因素, 谨慎选择合适的品种和合约进行投资, 定期评估套期保值效果, 并在交易过程中通过投资管理系统进行保证金监控和预警。体现了衍生品相关风险指标的动态监测及预警机制。
激励制度和机制评估:	根据公司《员工绩效考核管理办法》, 公司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; 公司对股指期货交易盈亏相挂钩。
定期监督检查情况评估:	公司《金融衍生品投资交易业务风险管理办法》已明确公司审计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; 并应编制半年和年度稽核审计报告, 报送银保监会。
回溯分析情况评估:	公司《金融衍生品投资交易业务风险管理办法》已明确公司审计部门对于衍生品交易的风险管理情况的检查报告和报告内容包含回溯衍生品买入计划与实际执行的偏差。公司审计部将根据监管规定及公司制度要求, 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, 并将该内容纳入每半年及年度稽核审计报告, 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能力监管有关事项的通知》及相关监管规定，我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。

