

安联保险资产管理有限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 20260128）



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:	甄庆哲	职务:	董事长
行政责任人类别:	董事长	是否履行完备的授权程序:	
行政责任人性别:	女	行政责任人出生年月:	1971-06
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:	公司高级管理人员	行政责任人入司时间:	2021-05-01
行政责任人专业资质:	北美精算师, 金融风险分 析师	行政责任人专业技术职务:	无
专业责任人:	谭显英	职务:	组合及量化管理部总经理
专业责任人类别:	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:	1989-11
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:	2021-06-16	专业责任人所在部门:	组合及量化管理部
专业责任人专业资质:	注册金融分析师	专业责任人专业技术职务:	无

二、基本条件

整体评估情况:	<p>公司具有良好的公司治理结构,建立了由股东、监事、董事会及下设专业委员会、管理层等组成的公司治理架构。公司实行董事会领导下的总经理负责制,组建了分工明确、勤勉尽责的高级管理团队。根据监管政策要求,提高总行效率,协助管理层在决策机制、以增强的各类风险,承诺承担参与股指期货交易的情况,制定了授权制度,建立了决策机制,明确管理职责,根据《保险资金参与股指期货交易规定》《保险资金参与股指期货交易规定》《保险机构衍生品运用的管理标准—股指期货》等规定,公司加强团队建设,完善股指期货交易制度,建立股指期货交易系统,加强能力建设。公司的内部控制制度完善有效。根据监管规定,公司建立了一整套股指期货业务制度体系,全面规范了股指期货业务中的授权管理、投资决策、交易执行、资金划拨、清算结算、风险控制等各个环节,明确了股指期货相关业务部门分工及岗位职责,确保业务操作和风险管理流程可执行,关键岗位相互制衡,为业务开展奠定了良好基础。</p> <p>公司的业务操作制度完整有效。公司股指期货业务操作制度涵盖研究、决策、交易、清算与结算等全过程,责任分工明确,业务流程清晰,环节紧密衔接。</p> <p>公司建立了股指期货业务的风险管理体系,涵盖了动态风险管理机制、风险对冲有效性预警机制、激励制度和机制、监督检查机制以及稽核审计机制,并将股指期货业务风险管理纳入公司总体风险管理架构,通过持续推进风险管理体系建设,确保风险管理策略得到有效执行。</p> <p>公司搭建了完备稳定的股指期货业务系统,包括交易结算系统、投资分析系统、资产估值和核算系统以及风险管理信息系统,并已通过可靠性测试。</p> <p>公司组建了一支参与股指期货业务的专业团队,团队人员配备数量、资格考试通过情况及从业经验年限符合监管规定。投资交易、风险控制清算岗位人员不存在相互兼任的情况。</p> <p>公司自成立以来未受到监管机构重大行政处罚。</p> <p>经评估,公司衍生品运用管理能力(股指期货)达到《保险机构衍生品运用管理能力标准—股指期货》中相关要求。</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

<p>整体评估情况： 公司实行董事会领导下的总经理负责制，组建了分工明确、勤勉尽职的高级管理层团队。根据监管政策要求以及总经理授权，公司在管理层设立专门的委员会，对专业、专项工作进行实施集体决策机制，以增强协作类风险，提高了工作效率，协助管理层在日常经营中做出更专业的决策。公司董监会根据监管政策要求，制定了《安联保险资产管理股份有限公司股指期货交易管理办法》和《安联保险资产管理有限公司股指期货交易管理办法》等文件，建立了以信息披露、投资决策、风险控制、清算核算、风险管理、稽核、绩效评估、系统支持等股指期货交易全流程各环节，并明确了各部门、岗位职责、风险管控、人员配置等情况。其中，投资交易部门包括组合及量化管理部、权益投资部、股指期货研究岗、股指期货负责人岗。公司设立了股指期货业务法律合规部，防火墙体系，执行了严格的业务分离制度，确保投资交易、风险管理、清算核算、稽核、绩效评估等部门的独立运作。经评估，公司组织架构符合《保险机构衍生品运用管理能力标准—股指期货》中相关规定。</p>			
投资交易部门			
1			
部门名称：	交易部		
发文时间：	2022-07-06	文件名称（含文号）：	安联保险资产管理有限公司关于明确股指期货交易相关管理部门及岗位职责的通知（安联资管人力〔2022〕41号）
岗位设置：	交易岗		
2			
部门名称：	权益投资部		
发文时间：	2022-07-06	文件名称（含文号）：	安联保险资产管理有限公司关于明确股指期货交易相关管理部门及岗位职责的通知（安联资管人力〔2022〕41号）
岗位设置：	股指期货投资岗		
3			
部门名称：	组合及量化管理部		
发文时间：	2022-07-06	文件名称（含文号）：	安联保险资产管理有限公司关于明确股指期货交易相关管理部门及岗位职责的通知（安联资管人力〔2022〕41号）
岗位设置：	股指期货研究岗, 股指期货负责人岗		
风险管理部			
1			
部门名称：	法律合规部		
发文时间：	2022-07-06	文件名称（含文号）：	安联保险资产管理有限公司关于明确股指期货交易相关管理部门及岗位职责的通知（安联资管人力〔2022〕41号）
岗位设置：	法律合规岗		
2			
部门名称：	风险管理部		
发文时间：	2022-07-06	文件名称（含文号）：	安联保险资产管理有限公司关于明确股指期货交易相关管理部门及岗位职责的通知（安联资管人力〔2022〕41号）
岗位设置：	风险管理岗		
清算核算部门			

1			
部门名称:	财务运营部		
发文时间:	2022-07-06	文件名称(含文号):	安联保险资产管理有限公司关于明确股指期货交易的通 知(安联资管人力(2022)41号)
岗位设置:	估值核算岗,资金清算岗		
内部稽核部门			
1			
部门名称:	内部审计部		
发文时间:	2022-08-01	文件名称(含文号):	安联保险资产管理有限公司关于成立内部审计部的通知(安联资管人力(2022)54号)
岗位设置:	内部审计岗		
防火墙机制:	<p>公司通过内部部门及岗位设置、股指期货业务操作制度、股指期货风险管理制度的业务分离、信息权限设置等,在不同部门之间设立清晰的防火墙体系,实行严格制业 务分离制度。公司制定了《安联保险资产管理有限公司关于明确股指期货交易相 关部门及岗位职责的通知》和《安联保险资产管理有限公司股指期货投资管理办 法》,明确规定了防火墙体系,实行严格的业务分离制度,明确股指期货业务管 理的资产配置和交易组合及量化管理部、权益投资部和交易部负责,风险管 理由风险管理部和法律合规部负责,清算核算由财务部负责,稽查审计由内 部审计部负责,确保投资交易、风险管理、清算核算、内部稽核等部门独立运 作。</p> <p>经评估,公司衍生品运用管理能力(股指期货)的防火墙机制设置均符合《保险 机构衍生品运用管理能力标准-股指期货》的相关要求。</p>		
评估结果:	符合规定		

四、专业队伍

整体评估情况:						
<p>公司组建了一支参与股指期货业务的专业团队,团队人员配备数量、资格考试通过情况及从业经验年限符合 监管规定。公司配备的股指期货交易管理专业管理人员,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,其中资产配置和交易交易专业人员5名,风险控制专业人员3名,清算和核算专业人员2名 ,均已通过期货从业人员资格考试,另有审计稽核人员1名。投资交易、风险控制和清算岗位人员不存在兼任 情况。负责人员具有5年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,公司专业队伍符合《保险机构衍生品运用管理能力标准-股指期货》中相关规定。</p>						
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 从业资格考试	相关经验年 限
1	张丹	估值核算岗	否	其他	已通过	14.38
2	杜云飞	交易岗	否	期货或证券业务经验	已通过	18.49
3	王鹏宇	股指期货投 资岗	否	期货或证券业务经验	已通过	7.49
4	刘煜洲	法律合规岗	否	其他	已通过	12.34
5	张钊	风险管理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	8.02
6	郭昕昕	资金清算岗	否	其他	已通过	4.50
7	黄光霖	风险管理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	19.50
8	何川	交易岗	否	期货或证券业务经验	已通过	8.48
9	陈成	内部审计岗	否	其他	未通过	9.23
10	刘梦泽	股指期货研 究岗	否	期货或证券业务经验	已通过	8.15
11	谭显英	股指期货研 究岗	否	期货或证券业务经验	已通过	12.50
12	谭显英	股指期货负 责人岗	否	期货或证券业务经验	已通过	12.50

与交易结算机构签署协议文件	符合规定	<p>文件名称：安联保险资产管理有限公司-中国建设银行股份有限公司-上海东证期货有限公司期货投资托管操作三方备忘录， 发文文号：无， 发文时间：2022-07-01； 文件名称：期货投资三方协议备忘录， 发文文号：无， 发文时间：2022-12-31； 文件名称：安联保险资管-工行北分-国泰君安保险资产管理产品期货投资托管运营备忘录， 发文文号：无， 发文时间：2023-08-29； 文件名称：安联保险资产管理有限公司-兴业银行股份有限公司-国元期货有限公司期货及期权投资操作备忘录， 发文文号：无， 发文时间：2023-08-16； 文件名称：保险资产管理产品期货投资托管运营备忘录， 发文文号：无， 发文时间：2023-07-05； 文件名称：安联资产-工行北分-申万期货保险资产管理产品期货投资托管运营备忘录， 发文文号：无， 发文时间：2023-08-28； 文件名称：安联保险资产管理有限公司-兴业银行股份有限公司-银河期货有限公司期货及期权投资操作备忘录， 发文文号：无， 发文时间：2023-07-12； 文件名称：保险资产管理产品期货投资托管运营备忘录， 发文文号：无， 发文时间：2022-06-22； 文件名称：安联保险资产管理有限公司-兴业银行股份有限公司-上海东证期货有限公司期货及期权投资操作备忘录， 发文文号：无， 发文时间：2023-11-28； 文件名称：安联保险资产管理有限公司-中国工商银行股份有限公司北京市分行-中信期货有限公司期货投资托管运营备忘录， 发文文号：无， 发文时间：2023-07-03；</p>
衍生品交易业务操作制度	符合规定	<p>文件名称：安联保险资产管理有限公司股指期货资金结算及估值核算管理办法， 发文文号：安联资管财务[2024]46号， 发文时间：2024-11-26； 文件名称：安联保险资产管理有限公司股指期货投资管理辦法， 发文文号：安联资管组合[2022]19号， 发文时间：2022-05-12； 文件名称：安联保险资产管理有限公司股指期货业务风险管理辦法， 发文文号：安联资管风控[2022]24号， 发文时间：2022-05-27； 文件名称：安联保险资产管理有限公司股指期货交易管理辦法， 发文文号：安联资管交易[2022]20号， 发文时间：2022-05-13；</p>

内部控制制度	符合规定	文件名称：安联保险资产管理有限公司内部审计管理制度， 发文号：安联资管内部审计（2025）49号， 发文时间：2025-12-12； 文件名称：安联保险资产管理有限公司股指期货投资管理 管理办法， 发文号：安联资管组合[2022]19号， 发文时间：2022-05-12； 文件名称：安联保险资产管理有限公司股指期货业务 风险管理办法， 发文号：安联资管风控[2022]24号， 发文时间：2022-05-27； 文件名称：安联保险资产管理有限公司股指期货交易 管理办法， 发文号：安联资管交易[2022]20号， 发文时间：2022-05-13；
风险管理制度	符合规定	文件名称：安联保险资产管理有限公司股指期货投资 管理办法， 发文号：安联资管组合[2022]19号， 发文时间：2022-05-12； 文件名称：安联保险资产管理有限公司投资授权管理 办法， 发文号：安联资管风控[2021]81号， 发文时间：2021-12-29； 文件名称：安联保险资产管理有限公司股指期货业务 风险管理办法， 发文号：安联资管风控[2022]24号， 发文时间：2022-05-27； 文件名称：安联保险资产管理有限公司全面风险管理 政策， 发文号：安联资管风控（2025）16号， 发文时间：2025-03-20；
问责制度	符合规定	文件名称：安联保险资产管理有限公司案件追究管理 办法， 发文号：安联资管人力[2022]26号， 发文时间：2022-05-27； 文件名称：安联保险资产管理有限公司股指期货从业 人员守则， 发文号：安联资管人力[2022]25号， 发文时间：2022-05-27；

六、托管机制

整体评估情况：
公司已与中国建设银行股份有限公司上海市分行、上海东证期货有限公司、招商银行股份有限公司北京分行等机构签署三方协议，协议确定了股指期货业务的资金划拨、清算、估值等事项，明确了各方权利义务。经评估，公司托管机制符合《保险机构衍生品运用管理能力标准—股指期货》中相关规定。

七、系统建设

整体评估情况：			
公司在股指期货的投资交易、会计核算和风险管理等环节都进行了系统化建设。公司使用投资管理系统03.2作为股指期货交易系统，结合03.2内置的套保以及风控模块，能计算对冲资产组合风险所需的衍生品数量，并实现股指期货交易的实时监控、告警。另外，公司使用恒生的资产估值与会计核算系统，实现了股指期货交易的清算与估值，其账务处理、清算逻辑都遵循了相应的会计准则。公司股指期货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	投资管理系统03.2		
上线时间	2022-07-06	评估结果	符合规定
主要功能	公司使用投资管理系统03.2作为股指期货交易结算系统，通过联通为主线以及电信为备份专线通道的方式连接深圳通对接了合作的交易结算机构信息系统。03.2作为行业成熟的交易系统，系统功能齐全、运行稳定高效，具备股指期货交易的流程管理、风险控制、保证金管理、日终清算等功能。经评估与测试，满足监管对于股指期货交易结算系统相关要求。		

