

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（首次披露— 20220805）



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：	曹蕾	职务：	总经理临时负责人
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	女	行政责任人出生年月	1973-08
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	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	15年以上金融行业工作经验	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	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：	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、勤勉尽职的高级管理层团队。根据中国银保监会的监管政策要求以及总经理授权，公司在管理层设立专业委员会，对专业、专项工作实施集体协商决策机制，以增强协作，提高工作效率，协助管理层在日常的经营中做出更专业的决策。公司董事会知晓参与股指期货交易的各类风险，承诺承担参与股指期货交易的最终责任，并授权管理层开展股指期货业务。董事会根据公司管理情况，制定了授权制度，建立了决策机制，明确管理人员职责及报告要求。根据《保险资金参与金融衍生产品交易办法》《保险资金参与股指期货交易规定》《保险机构衍生品运用管理能力标准—股指期货》等监管规定，公司加强团队建设，完善股指期货交易制度，建立股指期货交易的系统，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、风险控制等各个业务环节，明确了股指期货相关业务的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。 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。 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。 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。 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、风险控制和清算岗位人员不存在相互兼任的情况。 公司自成立以来未受到监管机构重大行政处罚。 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。
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。根据中国银保监会的监管政策要求以及总经理授权，公司在管理层设立专业委员会，对专业的专项工作实施集体决策机制，以增强协作，提高工作效率，协助管理层在日常经营中做出专业的决策。公司董事会知晓参与股指期货交易的各类风险，承诺承担参与股指期货交易的最终责任，并授权管理层开展股指期货业务。董事会根据公司管理情况，制定了授权制度，建立了决策机制，明确管理人员职责及报告要求。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》等文件，建立了以投资委员会为中心，组合及量化管理部、权益投资部、交易部、风险管理部、法律合规部、财务部、运营部、信息科技部、内部审计部等前中后台部门相互分离、相互制约、各司其职、协调配合的组织体系，覆盖了投资决策、交易执行、清算核算、风险管理、内部稽核、绩效评估、系统支持等股指期货交易全流程的各个环节，并明确了部门职责、岗位职责、部门负责人及人员配置情况。其中，投资交易部门包括组合及量化管理部、权益投资部和交易部，风险管理部包括风险管理部和法律合规部，清算核算部门包括财务运营部，内部审计部负责对股指期货业务进行稽查审计。公司设立了股指期货业务防火墙体系，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、内部稽核等部门的独立运作。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。

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相关部门及岗位职责的通知(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:	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、信息系统权限设置等,在不同部门之间设立清晰的防火墙体系,实行严格的业务分离制度。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,明确股指期货业务的资产配置和投资交易由组合及量化管理部、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,清算核算由财务运营部负责,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。 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。		
评估结果:	符合规定		

四、专业队伍

整体评估情况:						
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,其中资产配置和投资交易专业人员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。						
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	颜茹云	交易岗	否	期货或证券业务经验	已通过	3.84
2	林卉	交易岗	否	期货或证券业务经验	已通过	11.37
3	何川	交易岗	否	期货或证券业务经验	已通过	5.06
4	陈成	内部审计岗	否	其他	未通过	5.81
5	汪鹏	股指期货投资岗	否	期货或证券业务经验	已通过	5.06
6	刘煜洲	法律合规岗	否	其他	已通过	9.06
7	谭显英	股指期货研究岗	否	期货或证券业务经验	已通过	9.09
8	谭显英	股指期货负责人岗	否	期货或证券业务经验	已通过	9.09
9	曹懿	估值核算岗	否	其他	已通过	12.08
10	司梦	资金清算岗	否	其他	已通过	8.60
11	刘梦泽	风险管理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	4.73
12	张钊	风险管理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	4.62

五、投资规则与基本制度

整体评估情况：

公司建立了完善、有效的股指期货交易管理制度，相关制度已经过董事会、经营管理层或其他授权机构批准，以公司正式文件形式下发。

在风险对冲方面，公司制定了《安联保险资产管理有限公司股指期货风险对冲方案》，经公司风险管理部门及有关决策机构审批，要求在开展风险对冲前，需明确对冲的目标、工具、对象、规模、期限、风险对冲比例、保证金管理、风险敞口限额，对冲有效性的相关指标、标准和评估频度以及可能导致无法对冲的情景等内容，且风险管理部门应进行独立的风险评估，出具独立的风险审核意见。

在与交易结算机构签署协议文件方面，公司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签署了《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市分行-上海东证期货有限公司期货投资托管操作三方备忘录》，确定了股指期货业务交易、保证金管理结算、风险控制及数据传输等事项，明确双方权利义务。

在衍生品交易业务操作制度方面，公司发布了《安联保险资产管理有限公司股指期货投资管理办法》《安联保险资产管理有限公司股指期货业务风险管理办法》《安联保险资产管理有限公司股指期货交易管理办法》《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》等制度，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、风险控制等各个业务环节。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。

在内部控制制度方面，公司发布了《安联保险资产管理有限公司股指期货投资管理办法》《安联保险资产管理有限公司股指期货业务风险管理办法》《安联保险资产管理有限公司股指期货交易管理办法》《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》等制度，明确了股指期货投资业务各环节的部门及岗位职责，确保业务操作和风险管理流程可执行，实现关键岗位之间的相对独立和相互制衡，明确关键环节和重要岗位应建立双人复核机制。

在风险管理方面，公司发布了《安联保险资产管理有限公司股指期货投资管理办法》《安联保险资产管理有限公司股指期货业务风险管理办法》《安联保险资产管理有限公司投资授权管理办法》等制度，建立了包括风险识别、风险评估、风险控制、风险处置和内部审计在内的股指期货投资全程风险管理体系，明确将股指期货风险管理制度纳入公司总体风险管理架构，切实防范投资风险，并形成了前、中、后台各相关部门相对独立、相互制约、权责明确的风险控制体系。

在问责制度方面，公司发布了《安联保险资产管理有限公司案件追究管理办法》《安联保险资产管理有限公司股指期货从业人员守则》等制度，包括股指期货交易主管人员和专业人员的工作守则。

经评估，公司投资制度符合《保险机构衍生品运用管理能力标准—股指期货》中相关规定。

衍生品交易管理制度：

制度内容	评估结果	制度明细
风险对冲方案	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风险对冲方案， 发文文号：安联资管组合[2022]36号， 发文时间：2022-07-01； 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， 发文文号：安联资管风控[2022]24号， 发文时间：2022-05-27；
与交易结算机构签署协议文件	符合规定	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；
衍生品交易业务操作制度	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交易管理办法， 发文文号：安联资管交易[2022]20号， 发文时间：2022-05-13； 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[2022]18号， 发文时间：2022-04-27； 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， 发文文号：安联资管风控[2022]24号， 发文时间：2022-05-27；

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股指期货投资管理办法， 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交易管理办法， 发文文号：安联资管交易[2022]20号， 发文时间：2022-05-13； 文件名称：安联保险资产管理有限公司内部审计管理制度， 发文文号：安联资管综合[2021]11号， 发文时间：2021-08-24； 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， 发文文号：安联资管风控[2022]24号， 发文时间：2022-05-27；
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全面风险管理制度， 发文文号：安联资管综合[2021]3号， 发文时间：2021-08-24； 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， 发文文号：安联资管风控[2022]24号， 发文时间：2022-05-27；
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及上海东证期货有限公司签署了《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市分行-上海东证期货有限公司期货投资托管操作三方备忘录》，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。公司使用恒生投资交易系统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	恒生投资交易管理系统03.2		
上线时间	2022-07-06	评估结果	符合规定
主要功能	公司使用恒生投资交易系统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。		

投资分析系统：			
系统名称	恒生投资交易系统03.2		
上线时间	2022-07-06	评估结果	符合规定
主要功能	公司通过恒生投资交易系统03.2的股指期货套保模块实现投资分析功能，能够计算对冲资产组合风险所需的衍生品数量，并根据市场变化，调整衍生品规模，逐步实现担保品动态调整。具体包括：套保方案设计及管理、回归分析、风险监控以及信息查询等功能。经评估与测试，能够满足监管对于股指期货投资分析系统的要求。		
资产估值和核算系统：			
系统名称	恒生资产估值与会计核算系统		
上线时间	2022-07-06	评估结果	符合规定
主要功能	公司使用恒生资产估值与会计核算系统的股指期货估值与清算模块实现资产估值和核算功能，其会计确认、计量、账务处理及财务报告符合规定，系统稳定高效，且能够满足估值需求。相关功能主要包括：保证金费率设置、公共数据处理、期货交易清算、交易凭证处理、估值表生成的期货交易清算文件进行日终清算，完监管规定。系统会根据期货公司每天发送的期货交易清算数据核对，经确认，合作期货公司运营人员及时与托管行同事进行清算数据核对，对账。经确认，合作期货公司与托管银行的信息系统合规可靠。经评估与测试，能够满足监管对于股指期货资产估值和核算系统相关要求。		
风险管理信息系统：			
系统名称	恒生投资交易系统03.2		
上线时间	2022-07-06	评估结果	符合规定
主要功能	公司使用恒生投资交易系统03.2的风险管理模块实现风险管理功能。系统能够实时实现股指期货交易的实时监控，各项风险管理指标固化在系统中，并能够及时预警。系统可以对持有买入合约价值、合约交易额、多空持仓比例等股指期货交易风控规则进行灵活地设置并固化在系统中，在投资经理下单指令或在交易员下单时，系统会对其相关指标进行严格检验。系统的风险模块实现了预警、审批和禁止三个层级的风险控制功能。经评估与测试，能够满足监管对于股指期货风险管理信息系统相关要求。		

八、风险管理

整体评估情况：	
公司已建立股指期货业务风险管理体系。动态风险管理机制方面，公司通过《安联保险资产管理有限公司股指期货投资管理办法》《安联保险资产管理有限公司股指期货业务风险管理办法》《安联保险资产管理有限公司股指期货资金管理及估值核算管理办法》等规范了股指期货交易的业务流程；通过《安联保险资产管理有限公司全面风险管理制度》《安联保险资产管理有限公司股指期货业务风险管理办法》等制定了股指期货交易全面风险管理制度；公司采用恒生03.2系统作为股指期货信息管理系统，能够实时监测、评估与处置股指期货交易风险；通过《安联保险资产管理有限公司重大投资与资产风险管理制度》《安联保险资产管理有限公司股指期货业务风险管理办法》对股指期货交易业务的应急机制和管理预案进行了完善。 风险预警机制方面，公司通过《安联保险资产管理有限公司股指期货业务风险管理办法》明确了公司应根据公司资产组合实际情况，建立涵盖股指期货风险对冲有效性相关的股指期货业务风险监控指标体系，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。公司采用恒生03.2系统作为股指期货信息管理系统，能够将各项风险管理指标固化在系统中，实时监测、评估与处置股指期货交易风险，动态监测相关风险控制指标和风险对冲有效性执行情况，及时根据市场变化对交易作出风险预警。 激励制度和机制方面，公司通过《安联保险资产管理有限公司绩效管理暂行办法》《安联保险资产管理有限公司股指期货投资管理办法》建立了股指期货业务的激励制度和机制，明确投研业务人员薪酬水平不与股指期货交易盈亏简单挂钩，后台及风险管理部的人员报酬独立管理，盈亏情况。 定期监督检查机制方面，公司通过《安联保险资产管理有限公司股指期货业务风险管理办法》规定了公司至少包括业务合规情况、制度执行情况、人员资质情况、政策及有效性评估等。 回溯分析机制方面，公司发布了《安联保险资产管理有限公司股指期货业务风险管理办法》，明确内部审计部负责每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。 经评估，公司衍生品运用管理能力（股指期货）的风险管理均符合《保险机构衍生品运用管理能力标准-股指期货》的相关要求。	

动态风险管理机制评估:	公司建立了股指期货业务的风险对冲有效性预警机制。公司通过下发《安联保险资产管理有限公司股指期货业务风险管理暂行办法》，明确了公司应根据股指期货业务风险预警指标体系，制定风险对冲有效性预警机制，及时根据市场变化对交易部门应及处置股指期货行情变化的动态监控和预警。以上符合《保险机构衍生品运用管理能力标准—股指期货》中相关规定。
风险对冲有效性预警机制评估:	公司建立了股指期货业务的激励制度和机制。公司通过下发《安联保险资产管理有限公司绩效管理办法》建立了统一有效的激励制度和机制，在《安联保险资产管理有限公司股指期货投资管理办法》中，明确投研业务人员薪酬水平不与股指期货交易盈亏简单挂钩，后台及风险管理等部门的人员报酬独立于交易盈亏情况，以上符合《保险机构衍生品运用管理能力标准—股指期货》中相关规定。
激励制度和机制评估:	公司建立了股指期货业务的风险监督检查机制。公司通过下发《安联保险资产管理有限公司股指期货业务风险管理暂行办法》规定了公司内部审计部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审计报告。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，以上符合《保险机构衍生品运用管理能力标准—股指期货》中相关规定。
定期监督检查情况评估:	公司建立了股指期货业务的回溯分析机制。公司发布了《安联保险资产管理有限公司股指期货业务风险管理暂行办法》，明确内部审计部负责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。以上符合《保险机构衍生品运用管理能力标准—股指期货》的要求。
回溯分析情况评估:	公司建立了股指期货业务的动态风险管理机制。公司通过下发《安联保险资产管理有限公司股指期货业务风险管理暂行办法》，明确了公司应根据股指期货业务风险预警指标体系，制定风险对冲有效性预警机制，及时根据市场变化对交易部门应及处置股指期货行情变化的动态监控和预警。以上符合《保险机构衍生品运用管理能力标准—股指期货》中相关规定。

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。我公司确认，应当至少在首次开展本投资管理业务前10日已完成并公开披露本投资管理能力建设及自评估情况。