

# 中信保诚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—20220129）

## 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：    | 赵小凡              | 职务：          | 副董事长、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    | 1964-03        |
| 行政责任人学历   | 博士研究生            | 行政责任人学位      | 博士             |
| 行政责任人所在部门 | 中信保诚资产管理有限责任公司   | 行政责任人入司时间    | 2020-04-15     |
| 行政责任人专业资质 | 相关投资领域10年以上从业经验  | 行政责任人专业技术职务  | 高级会计师          |
| 专业责任人：    | 原瑞政              | 职务：          | 副总经理           |
| 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    | 1980-08        |
| 专业责任人学历   | 硕士研究生            | 专业责任人学位      | 硕士             |
| 专业责任人入司时间 | 2020-12-07       | 专业责任人所在部门    | 中信保诚资产管理有限责任公司 |
| 专业责任人专业资质 | 10年以上证券从业及相关投资经验 | 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、董事会、监事会和经营管理层组成的现代公司治理架构。根据《中信保诚资产管理有限责任公司章程》的规定，公司的股东为中信保诚人寿保险有限公司，股东可依法行使股东权利，并承担股东义务。公司设董事会，董事会向股东负责，决定公司一切重大事宜。董事会下设审计与风险管理委员会、战略与投资委员会、提名与薪酬委员会、各专业委员会对董事会负责，其各自的议事规则需经董事会审批。监事会是公司监督机构，主要负责对公司的财务、经营、董事会及其会成员和总经理进行监督与检查。公司实行董事会领导下的总经理负责制，总经理对董事会负责，执行董事会的各项决定，负责公司日常经营管理工作，总经理应当在公司章程规定的职责范围内行使总经理的权利和职权。公司董事知晓股指期货交易相关风险并参与衍生品交易的最终责任，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。</p> <p>公司建立了完善、有效的衍生品交易业务操作制度，操作制度涵盖了研究、决策、交易、清算与结算等全过程，并明确了每个部门和岗位的具体职责分工，确保业务流程清晰，环节紧密衔接。</p> <p>公司的内部控制制度完善，通过发布一系列规章制度，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，通过加强权限管理，实现关键岗位之间的相对独立和相互制衡，实现重点环节双人复核。</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、风险预警机制、激励制度和机制、监督检查机制、偏差回溯机制等各个方面，将股指期货的风险管理制度纳入公司总体风险管理架构，能够覆盖股指期货交易前、中、后台，及时做出风险预警。</p> <p>公司建立了股指期货交易信息技术系统，包括股指期货投资交易、风险管理、估值与核算、交易结算等系统，并开展了股指期货投资交易前、中、后台的仿真测试，形成信息系统说明材料及股指期货套期保值测试报告；各系统分别在独立的服务器和操作系统上部署，包括业务处理设备、交易软件等，并配备了充分的冗余资源，且均已通过可靠性测试。</p> <p>公司配备了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。团队的人员配置数量、资格考试通过情况、从业经验年限等均符合监管的要求，投资交易、风险控制和清算岗位人员不存在相互兼任情况。</p> <p>公司近两年没有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）基本条件符合《保险机构衍生品运用管理能力标准》的要求。</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

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |                        |            |                                                  |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------|------------|--------------------------------------------------|
| 整体评估情况：                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                        |            |                                                  |
| 中信保诚资产管理有限责任公司开展衍生品（股指期货）投资业务，建立了由董事会负最终责任、管理层直接领导，以及相关业务部门、专业委员会、专业工作小组共同参与组成的投资管理体系。公司董事会已知晓相关风险并承担参与衍生品（股指期货）交易的最终责任，董事会根据公司管理情况，制定授权制度，建立决策机制，明确了《中信保诚资产管理有限责任公司股指期货投资管理办法v1.0》、《衍生品运用管理能力（股指期货）相关部门、岗位职责及人员配置情况》等文件，明确了参与股指期货交易的机构或部门包括董事会战略与投资委员会、管理层投资委员会、管理层风险管理委员会、资产配置小组、宏观策略与资产配置部、股票投资部、风险控制部、法律合规部、交易室、财务部、信息技术部和审计部等，覆盖投资研究、投资决策、交易执行、清算核算、风险管理、内部稽核、绩效评估、系统支持等全流程的各个环节。发文中明确了各机构或部门的工作职责、岗位职责、部门负责人及人员配置情况，其中董事会战略与投资委员会是公司股指期货投资业务的最高决策机构，管理层根据授权负责对股指期货投资业务进行实施。公司实行了严格的防火墙机制和严格的业务分离制度，确保投资交易、风险管理、清算核算、内部稽核等部门独立运作。 |                        |            |                                                  |
| 经评估，公司衍生品运用管理能力（股指期货）组织架构符合《保险机构衍生品运用管理能力标准》的要求。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                        |            |                                                  |
| 投资交易部门                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |                        |            |                                                  |
| 1                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |                        |            |                                                  |
| 部门名称：                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 交易室                    |            |                                                  |
| 发文时间：                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 2021-11-22             | 文件名称（含文号）： | 衍生品运用管理能力（股指期货）相关部门、岗位职责及人员配置情况（中信保诚资办（2021）12号） |
| 岗位设置：                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 交易岗                    |            |                                                  |
| 2                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |                        |            |                                                  |
| 部门名称：                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 宏观策略与资产配置部             |            |                                                  |
| 发文时间：                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 2021-11-22             | 文件名称（含文号）： | 衍生品运用管理能力（股指期货）相关部门、岗位职责及人员配置情况（中信保诚资办（2021）12号） |
| 岗位设置：                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 股指期货投资岗，股指期货研究岗，部门总经理岗 |            |                                                  |
| 风险管理部                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                        |            |                                                  |
| 1                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |                        |            |                                                  |
| 部门名称：                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 法律合规部                  |            |                                                  |
| 发文时间：                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 2021-11-22             | 文件名称（含文号）： | 衍生品运用管理能力（股指期货）相关部门、岗位职责及人员配置情况（中信保诚资办（2021）12号） |
| 岗位设置：                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 法律合规岗                  |            |                                                  |
| 2                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |                        |            |                                                  |
| 部门名称：                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 风险控制部                  |            |                                                  |
| 发文时间：                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 2021-11-22             | 文件名称（含文号）： | 衍生品运用管理能力（股指期货）相关部门、岗位职责及人员配置情况（中信保诚资办（2021）12号） |
| 岗位设置：                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 风险技术岗，风险管理岗            |            |                                                  |
| 清算核算部门                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |                        |            |                                                  |
| 1                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |                        |            |                                                  |
| 部门名称：                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 财务部                    |            |                                                  |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |            |                                                  |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|--------------------------------------------------|
| 发文时间：  | 2021-11-22                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 文件名称（含文号）： | 衍生品运用管理能力（股指期货）相关部门、岗位职责及人员配置情况（中信保诚资办〔2021〕12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：  | 审计部                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |            |                                                  |
| 发文时间：  | 2021-11-22                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 文件名称（含文号）： | 衍生品运用管理能力（股指期货）相关部门、岗位职责及人员配置情况（中信保诚资办〔2021〕12号） |
| 岗位设置：  | 审计岗                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |            |                                                  |
| 防火墙机制： | 公司衍生品（股指期货）投资业务实行严格的防火墙机制和集中交易制度，通过不同部门之间设置防火墙体系，严格分离投资前、中、后台岗位责任，并严格隔离投资决策与交易执行，以确保衍生品（股指期货）投资业务不相容岗位相互分离、制约和监督，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。具体如下：（1）衍生品（股指期货）投资的不相容岗位至少应当包括：投资指令下达与交易执行；投资前台与中台风控、组合管理以及后台清算、核算。（2）所有交易指令须由交易员执行，其他人员不得兼任交易员，股指期货交易岗与固收交易岗严格分离；（3）设立集中交易室，实行门禁管理，未经批准其他人不得随意进入。安装集中交易监测系统、预警系统和反馈系统，对交易室固定电话、网络通信等实施交易时间内监控，交易机设置交易密码并定期更换，以隔离投资决策与执行。经评估，公司衍生品运用管理能力（股指期货）防火墙机制建设符合《保险机构衍生品运用管理能力标准》的要求。 |            |                                                  |
| 评估结果：  | 符合规定                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |            |                                                  |

#### 四、专业队伍

| 整体评估情况：                                                                                                                                                                                                                         |     |         |                    |           |                    |        |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|---------|--------------------|-----------|--------------------|--------|
| <p>公司配备了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4人，清算和核算专业人员2人，均已通过期货从业资格考试，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。经评估，公司衍生品运用管理能力（股指期货）专业队伍符合《保险机构衍生品运用管理能力标准》的要求。</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<br>的专职人员 | 相关经验类型    | 是否通过期货从业<br>人员资格考试 | 相关经验年限 |
| 1                                                                                                                                                                                                                               | 钟志兴 | 交易岗     | 否                  | 期货或证券业务经验 | 已通过                | 9.89   |
| 2                                                                                                                                                                                                                               | 李天宇 | 交易岗     | 否                  | 期货或证券业务经验 | 已通过                | 3.36   |
| 3                                                                                                                                                                                                                               | 许晓光 | 交易岗     | 否                  | 期货或证券业务经验 | 已通过                | 9.42   |
| 4                                                                                                                                                                                                                               | 王滔  | 股指期货投资岗 | 是                  | 期货或证券业务经验 | 已通过                | 10.81  |
| 5                                                                                                                                                                                                                               | 李方岩 | 股指期货投资岗 | 是                  | 期货或证券业务经验 | 已通过                | 9.58   |
| 6                                                                                                                                                                                                                               | 王达  | 部门总经理岗  | 否                  | 期货或证券业务经验 | 未通过                | 9.02   |
| 7                                                                                                                                                                                                                               | 任丽明 | 内部审计岗   | 否                  | 期货或证券业务经验 | 未通过                | 7.35   |
| 8                                                                                                                                                                                                                               | 唐广应 | 法律合规岗   | 否                  | 期货或证券业务经验 | 已通过                | 2.07   |
| 9                                                                                                                                                                                                                               | 王丽源 | 估值核算岗   | 否                  | 期货或证券业务经验 | 已通过                | 1.13   |
| 10                                                                                                                                                                                                                              | 殷玥  | 资金清算岗   | 否                  | 期货或证券业务经验 | 已通过                | 2.34   |
| 11                                                                                                                                                                                                                              | 侯鹏  | 风险技术岗   | 否                  | 期货或证券业务经验 | 已通过                | 8.48   |
| 12                                                                                                                                                                                                                              | 陈倩  | 风险管理岗   | 否                  | 期货或证券业务经验 | 已通过                | 4.96   |
| 13                                                                                                                                                                                                                              | 李敬然 | 风险管理岗   | 否                  | 期货或证券业务经验 | 已通过                | 4.72   |

## 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，相关制度均经过董事会、经营管理层或其授权机构批准，以公司正式文件形式下发执行。

在风险对冲方面，公司制定了《中信保诚资产管理有限责任公司股指期货风险管理办法v2.0》、《中信保诚资产管理有限责任公司股指期货套期保值交易及风险对冲方案 V1.0》等文件，并经公司风险管理部门及有关决策人员审批。

在与交易结算机构签署协议文件方面，公司与中信银行股份有限公司和中信期货有限公司签署《中信保诚资管-中信银行-中信期货 期货投资托管操作备忘录》，确定股指期货业务交易、保证金管理结算、风险控制及数据传输等事项，明确双方的权利和义务。

在业务操作制度方面，公司制定了《中信保诚资产管理有限责任公司股指期货投资管理办法v1.0》、《中信保诚资产管理有限责任公司股指期货交易管理细则（试行）》、《中信保诚资产管理有限责任公司清算管理制度V1.2》、《中信保诚资产管理有限责任公司投资业务估值管理制度V1.2》、《中信保诚资产管理有限责任公司投资账户管理制度V1.2》、《中信保诚资产管理有限责任公司投资资金划拨细则V1.1》等文件，涵盖研究、决策、交易、清算与结算等全过程，明确责任分工，确保业务流程清晰，环节紧密衔接。

在内部控制制度方面，公司制定了《中信保诚资产管理有限责任公司内部控制管理细则》、《中信保诚资产管理有限责任公司内部审计制度V1.1》、《中信保诚资产管理有限责任公司股指期货投资管理办法v1.0》、《中信保诚资产管理有限责任公司股指期货风险管理办法v2.0》、《中信保诚资产管理有限责任公司股指期货交易管理细则（试行）》、《中信保诚资产管理有限责任公司清算管理制度V2.0》、《中信保诚资产管理有限责任公司投资业务估值管理制度V1.2》等文件，明确岗位职责，确保业务操作和风险管理流程可执行，关键岗位相互制衡，重点环节双人复核。

在风险管理制度方面，公司制定了《中信保诚资产管理有限责任公司股指期货风险管理办法v2.0》、《中信保诚资产管理有限责任公司风险报告管理制度V1.1》、《中信保诚资产管理有限责任公司全面风险管理政策V2.0》、《中信保诚资产管理有限责任公司风险预警管理制度V1.2》、《中信保诚资产管理有限责任公司业务应急预案》、《中信保诚资产管理有限责任公司运营应急预案V1.1》等文件，将风险管理制度纳入公司总体风险管理架构，能够覆盖股指期货交易前、中、后台。

在问责制度方面，公司制定了《中信保诚资产管理有限责任公司股指期货交易相关人员工作守则（试行）V1.1》，包括了股指期货交易主管人员和专业人员的工作守则。

经评估，公司衍生品运用管理能力（股指期货）相关投资规则与基本制度建设情况符合《保险机构衍生品运用管理能力标准》的要求。

### 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：中信保诚资产管理有限责任公司股指期货风险管理办法v2.0，<br>发文文号：中信保诚资发（2021）155号，<br>发文时间：2021-06-30；<br>文件名称：中信保诚资产管理有限责任公司股指期货套期保值交易及风险对冲方案 V1.0，<br>发文文号：中信保诚资发（2021）117号，<br>发文时间：2021-11-18；                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 与交易结算机构签署协议文件 | 符合规定 | 文件名称：中信保诚资管-中信银行-中信期货 期货投资托管操作备忘录，<br>发文文号：无，<br>发文时间：2021-04-30；                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 衍生品交易业务操作制度   | 符合规定 | 文件名称：中信保诚资产管理有限责任公司投资业务估值管理制度V1.2，<br>发文文号：中信保诚资发（2021）6号，<br>发文时间：2021-02-22；<br>文件名称：中信保诚资产管理有限责任公司投资账户管理制度V1.2，<br>发文文号：中信保诚资发（2021）13号，<br>发文时间：2021-04-01；<br>文件名称：中信保诚资产管理有限责任公司清算结算管理制度V2.0，<br>发文文号：中信保诚资发（2021）103号，<br>发文时间：2021-11-02；<br>文件名称：中信保诚资产管理有限责任公司股指期货投资交易管理细则（试行），<br>发文文号：中信保诚资发（2021）38号，<br>发文时间：2021-08-02；<br>文件名称：中信保诚资产管理有限责任公司股指期货投资管理办法v1.0，<br>发文文号：中信保诚资发（2021）30号，<br>发文时间：2021-06-30；<br>文件名称：中信保诚资产管理有限责任公司投资资金划拨细则V1.1，<br>发文文号：中信保诚资发（2021）12号，<br>发文时间：2021-03-31； |

|        |      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|--------|------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 内部控制制度 | 符合规定 | <p>文件名称：中信保诚资产管理有限责任公司内部控制管理细则，<br/>发文文号：中信保诚资发〔2020〕29号，<br/>发文时间：2020-12-31；</p> <p>文件名称：中信保诚资产管理有限责任公司投资业务估值管理制度V1.2，<br/>发文文号：中信保诚资发〔2021〕6号，<br/>发文时间：2021-02-22；</p> <p>文件名称：中信保诚资产管理有限责任公司清算结算管理制度V2.0，<br/>发文文号：中信保诚资发〔2021〕103号，<br/>发文时间：2021-11-02；</p> <p>文件名称：中信保诚资产管理有限责任公司股指期货投资交易管理细则（试行），<br/>发文文号：中信保诚资发〔2021〕38号，<br/>发文时间：2021-08-02；</p> <p>文件名称：中信保诚资产管理有限责任公司股指期货投资管理暂行办法v1.0，<br/>发文文号：中信保诚资发〔2021〕30号，<br/>发文时间：2021-06-30；</p> <p>文件名称：中信保诚资产管理有限责任公司股指期货风险管理暂行办法v2.0，<br/>发文文号：中信保诚资发〔2021〕155号，<br/>发文时间：2021-06-30；</p> <p>文件名称：中信保诚资产管理有限责任公司内部审计制度V1.1，<br/>发文文号：中信保诚资发〔2020〕16号，<br/>发文时间：2020-12-10；</p> |
| 风险管理制度 | 符合规定 | <p>文件名称：中信保诚资产管理有限责任公司风险预警管理制度V1.2，<br/>发文文号：中信保诚资发〔2021〕23号，<br/>发文时间：2021-06-18；</p> <p>文件名称：中信保诚资产管理有限责任公司业务应急预案，<br/>发文文号：中信保诚资发〔2020〕8号，<br/>发文时间：2020-11-16；</p> <p>文件名称：中信保诚资产管理有限责任公司风险报告管理制度V1.1，<br/>发文文号：中信保诚资发〔2020〕8号，<br/>发文时间：2020-11-16；</p> <p>文件名称：中信保诚资产管理有限责任公司全面风险管理政策V2.0，<br/>发文文号：中信保诚资发〔2020〕20号，<br/>发文时间：2020-12-25；</p> <p>文件名称：中信保诚资产管理有限责任公司股指期货风险管理暂行办法v2.0，<br/>发文文号：中信保诚资发〔2021〕155号，<br/>发文时间：2021-06-30；</p> <p>文件名称：中信保诚资产管理有限责任公司运营应急预案V1.1，<br/>发文文号：中信保诚资发〔2021〕12号，<br/>发文时间：2021-03-31；</p>                                                                                                      |
| 问责制度   | 符合规定 | <p>文件名称：中信保诚资产管理有限责任公司股指期货交易相关人员工作守则（试行）V1.1，<br/>发文文号：中信保诚资发〔2021〕154号，<br/>发文时间：2021-11-18；</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |

## 六、托管机制

### 整体评估情况：

公司与中信银行股份有限公司和中信期货有限公司签署了《中信保诚资管-中信银行-中信期货 期货投资托管操作备忘录》，确定了股指期货业务的资金划拨、清算、估值等事项，明确双方的权利和义务。经评估，公司衍生品运用管理能力（股指期货）托管机制符合《保险机构衍生品运用管理能力标准》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信息技术系统，包括股指期货投资交易、风险管理、估值与核算、交易结算等系统，并开展了股指期货投资交易前、中、后台的仿真测试，形成信息系统说明材料及股指期货套期保值测试报告；各系统分别在独立服务器和操作系统上部署，包括业务处理设备、交易软件等，并配备了充分的冗余资源，且均已通过可靠性测试。

投资分析系统采用恒生投资交易系统管理软件V03.2，支持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。资产估值和核算系统采用恒生资产估值与会计核算系统V2.6，配备了股指期货估值与清算模块，实现会计确认、计量、账务处理及财务报告，系统运行稳定高效，满足估值需求。风险管理信息系统采用恒生投资交易系统管理软件V03.2和恒生风险管理与绩效评估系统V3.0，各项风险管理指标固化在系统中，能够实现股指期货交易的实时监控，并能够及时预警。交易结算系统采用恒生投资交易系统管理软件V03.2，支持股指期货交易流程管理，实现了与合作的交易结算机构信息系统的对接，建立了相应的备份通道。系统运行稳定高效，能够满足交易结算需求。

经评估，公司衍生品运用管理能力（股指期货）系统建设符合《保险机构衍生品运用管理能力标准》的要求。

|            |                                                                                             |      |      |
|------------|---------------------------------------------------------------------------------------------|------|------|
| 交易结算系统：    |                                                                                             |      |      |
| 系统名称       | 恒生投资交易系统管理软件V03.2                                                                           |      |      |
| 上线时间       | 2021-05-21                                                                                  | 评估结果 | 符合规定 |
| 主要功能       | 交易结算系统采用恒生投资交易系统管理软件V03.2，支持股指期货交易流程管理，实现了与合作的交易结算机构信息系统的对接，建立了相应的备份通道。系统运行稳定高效，能够满足交易结算需求。 |      |      |
| 投资分析系统：    |                                                                                             |      |      |
| 系统名称       | 恒生投资交易系统管理软件V03.2                                                                           |      |      |
| 上线时间       | 2021-05-21                                                                                  | 评估结果 | 符合规定 |
| 主要功能       | 投资分析系统采用恒生投资交易系统管理软件V03.2，支持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。                 |      |      |
| 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V2.6                                                                           |      |      |
| 上线时间       | 2021-05-21                                                                                  | 评估结果 | 符合规定 |
| 主要功能       | 资产估值和核算系统采用恒生资产估值与会计核算系统V2.6，配备了股指期货估值与清算模块，实现会计确认、计量、账务处理及财务报告，系统运行稳定高效，满足估值需求。            |      |      |
| 风险管理信息系统：  |                                                                                             |      |      |
| 系统名称       | 恒生投资交易系统管理软件V03.2                                                                           |      |      |
| 上线时间       | 2021-05-21                                                                                  | 评估结果 | 符合规定 |
| 主要功能       | 风险管理信息系统采用恒生投资交易系统管理软件V03.2和恒生风险管理与绩效评估系统V3.0，各项风险管理指标固化在系统中，能够实现股指期货交易的实时监控，并能够及时预警。       |      |      |
| 系统名称       | 恒生风险管理与绩效评估系统V3.0                                                                           |      |      |
| 上线时间       | 2021-06-04                                                                                  | 评估结果 | 符合规定 |
| 主要功能       | 风险管理信息系统采用恒生投资交易系统管理软件V03.2和恒生风险管理与绩效评估系统V3.0，各项风险管理指标固化在系统中，能够实现股指期货交易的实时监控，并能够及时预警。       |      |      |

八、风险管理

|         |
|---------|
| 整体评估情况： |
|---------|



回溯分析情况评估：

公司建立了股指期货业务的回溯分析机制。公司发布了《衍生品运用管理能力（股指期货）相关部门、岗位职责及人员配置情况》，明确规定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。经评估，公司衍生品运用管理能力（股指期货）稽核审计报告情况符合《保险机构衍生品运用管理能力标准》的要求。

## 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。

