

华夏久盈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—20240108）

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：	王晓辉	职务：	公司党委书记、总经理
行政责任人类别：	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	1976-12
行政责任人学历	硕士研究生	行政责任人学位	硕士
行政责任人所在部门	总经理室	行政责任人入司时间	2022-08-01
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：	王永	职务：	公司党委委员、总经理助理兼金融工程部总经理
专业责任人类别：	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	1974-01
专业责任人学历	博士研究生	专业责任人学位	博士
专业责任人入司时间	2015-09-01	专业责任人所在部门	金融工程部
专业责任人专业资质	具备相关投资领域10年经验	专业责任人专业技术职务	无

二、基本条件

整体评估情况：	公司满足《保险机构衍生品运用管理能力标准（股指期货）》要求的基本条件，公司具有良好的公司治理结构，以及健全的衍生品交易业务操作、内部控制和风险管理制度；建立了投资交易、会计核算和风险管理等信息系统；配备了符合要求的衍生品交易专业管理人员队伍；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：	公司组织架构完善，董事会和部门设置符合规定。董事会知晓股指期货投资相关风险并承担参与衍生品交易的最终责任；董事会制定、建立了授权制度和决策机制，明确了管理人员职责及报告要求。公司设立了负责股指期货交易的投资交易、风险管理、清算核算、内部稽核等相关部门，部门之间设立了防火墙体系，实行了严格的业务分离制度，确保独立运作。部门设置及相关职责已履行发文程序。		
投资交易部门	1		
部门名称：	资产配置部		
发文时间：	2021-01-12	文件名称（含文号）：	关于明确公司股指期货投资管理相关部门组织架构及负责人员的通知（华夏久盈发[2021]7号）
岗位设置：	权益策略研究岗		
2			

部门名称:	金融工程部		
发文时间:	2021-01-12	文件名称 (含文号):	关于明确公司股指期货投资管理能力相关部门组织架构及负责人员的通知 (华夏久盈发[2021]7号)
岗位设置:	股指期货投资岗		
3			
部门名称:	集中交易部		
发文时间:	2021-01-12	文件名称 (含文号):	关于明确公司股指期货投资管理能力相关部门组织架构及负责人员的通知 (华夏久盈发[2021]7号)
岗位设置:	权益投资交易岗		
风险管理部			
1			
部门名称:	合规法律部		
发文时间:	2021-01-12	文件名称 (含文号):	关于明确公司股指期货投资管理能力相关部门组织架构及负责人员的通知 (华夏久盈发[2021]7号)
岗位设置:	合规管理岗		
2			
部门名称:	风险管理部		
发文时间:	2021-01-12	文件名称 (含文号):	关于明确公司股指期货投资管理能力相关部门组织架构及负责人员的通知 (华夏久盈发[2021]7号)
岗位设置:	风险管理岗		
清算核算部			
1			
部门名称:	财务管理部		
发文时间:	2021-01-12	文件名称 (含文号):	关于明确公司股指期货投资管理能力相关部门组织架构及负责人员的通知 (华夏久盈发[2021]7号)
岗位设置:	估值核算岗		
2			
部门名称:	运营保障部		
发文时间:	2021-01-12	文件名称 (含文号):	关于明确公司股指期货投资管理能力相关部门组织架构及负责人员的通知 (华夏久盈发[2021]7号)
岗位设置:	证券管理岗,资金管理岗		
内部稽核部			
1			
部门名称:	稽核审计部		
发文时间:	2021-01-12	文件名称 (含文号):	关于明确公司股指期货投资管理能力相关部门组织架构及负责人员的通知 (华夏久盈发[2021]7号)
岗位设置:	稽核审计岗		
防火墙机制:	公司在不同部门之间设立防火墙体系,实行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。		
评估结果:	符合规定		

四、专业队伍

整体评估情况：

公司股指期货交易专业管理人员中，资产配置和投资交易专业人员有5名，清算和核算专业人员有3名，风险控制专业人员有3名，分析研究人员有1名，审计稽核专业人员有1名，均已通过了期货从业人员资格考试，投资交易、风险控制和清算岗位人员不存在相互兼任的情况。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。专业队伍建设符合规定。

专业队伍人员基本信息：

序号	姓名	岗位	是否为能力的标准要求 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	张艳峰	合规管理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	11.30
2	王一雪	合规管理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	8.22
3	林文茸	稽核审计岗	否	期货或证券业务经验	已通过	14.58
4	路雨	估值核算岗	否	期货或证券业务经验	已通过	14.28
5	张申	权益策略研究岗	否	期货或证券业务经验	已通过	14.09
6	田志达	证券管理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	9.15
7	刘馨远	资金管理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	9.20
8	王永	股指期货投资岗	否	期货或证券业务经验	已通过	18.14
9	邵明亭	股指期货投资岗	否	期货或证券业务经验	已通过	16.64
10	李翔	股指期货投资岗	否	期货或证券业务经验	已通过	8.17
11	阳卫平	股指期货投资岗	否	期货或证券业务经验	已通过	12.30
12	冯知己	权益投资交易岗	否	期货或证券业务经验	已通过	7.45
13	闫璟鸿	风险管理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	8.49

五、投资规则与基本制度

整体评估情况：

公司建立了完善、有效的衍生品交易管理制度。《金融衍生品投资业务管理办法》（〔2016〕5号）、《衍生品交易相关人员工作守则》（〔2016〕6号）、《股指期货投资交易管理办法》（〔2020〕19号）、《股指期货交易风险管理制度》（〔2020〕88号）等股指期货业务相关制度构成了公司股指期货业务的制度体系。公司在做套期保值之前均会制定风险对冲方案，并经公司合规法律部等风险管理部门审批。公司目前的交易结算机构是中泰期货股份有限公司和国泰君安期货有限公司，两家期货公司都在监管机构做了“期货公司提供保险资金股指期货交易服务报告表”的备案。公司分别与中泰期货、国泰君安期货签署了股指期货投资协议文件。

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：衍生品交易相关人员工作守则， 发文文号：〔2016〕6号， 发文时间：2016-01-07；
衍生品交易业务操作制度	符合规定	文件名称：股指期货投资交易管理办法， 发文文号：〔2020〕19号， 发文时间：2020-02-11；
内部控制制度	符合规定	文件名称：金融衍生品投资业务管理办法， 发文文号：〔2016〕5号， 发文时间：2016-01-07；
与交易结算机构签署协议文件	符合规定	文件名称：期货投资托管运营备忘录， 发文文号：无， 发文时间：2016-10-17； 文件名称：期货投资操作备忘录， 发文文号：无， 发文时间：2019-06-25；
风险管理制度	符合规定	文件名称：股指期货交易风险管理制度， 发文文号：〔2020〕88号， 发文时间：2020-05-25；
风险对冲方案	符合规定	文件名称：股指期货套期保值交易方案， 发文文号：〔2020〕18号， 发文时间：2020-02-11；

六、托管机制

整体评估情况：

公司分别与中国工商银行、中国建设银行签署了股指期货托管协议文件，确定了股指期货业务的资金划拨、清算、估值等事项，明确了双方的权利和义务。

七、系统建设

整体评估情况：

公司金融工程部和合规法律部使用恒生O3投资管理系统的套期保值模块和风险控制模块分别进行股指期货的投资交易和风险管理等工作。公司运营保障部和财务管理部使用恒生资产估值与会计核算系统，对股指期货业务进行会计确认、计量、账务处理和清算等工作。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。

交易结算系统：

系统名称	恒生投资O3系统-套保模块		
上线时间	2016-11-14	评估结果	符合规定
主要功能	套保模块能够实现期货业务交易，系统将实时指令，发送至期货公司柜台，由期货公司将实时指令转发至交易所实现指令全流程管理。公司目前已实现对多个期货柜台，建立相应的备份通道。股指期货交易管理系统稳定高效，能够满足交易需求。系统功能及各项指标均符合《保险机构衍生品运用管理能力标准》相关规定。		

投资分析系统：

系统名称	恒生投资O3系统-套保模块		
上线时间	2016-11-14	评估结果	符合规定
主要功能	恒生投资O3系统套保模块中，套保事前分析模块可以针对套保前进行套保对象选择、回归分析、时变分析、头寸计算、合约选择、情景分析、保证金分析、历史重现。套保方案维护模块可以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。系统功能及各项指标均符合《保险机构衍生品运用管理能力标准》相关规定。		

资产估值和核算系统：

系统名称	恒生估值系统-股指期货模块		
上线时间	2016-11-14	评估结果	符合规定
主要功能	恒生估值系统股指期货模块，可以实现股指期货的会计确认、计量、账务处理及清算等功能，能够满足估值需求，系统功能及各项指标均符合《保险机构衍生品运用管理能力标准》相关规定。		

风险管理信息系统：

系统名称	恒生投资O3系统-套保模块-套保风险监控		
上线时间	2016-11-14	评估结果	符合规定
主要功能	套保风险监控允许业务人员根据自身情况，设置各类风险监控指标，如：套保效率、风险敞口等；通过该模块能够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。系统功能及各项指标均符合《保险机构衍生品运用管理能力标准》相关规定。		

八、风险管理

整体评估情况：

公司建立了完善的风险管理制度，符合监管规定。建立动态风险管理机制，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。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。公司的激励制度没有将股指期货交易盈亏与业务人员收入挂钩。后台及风险管理部门的人员报酬独立于交易盈亏情况。公司稽核审计部定期对股指期货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报告。

动态风险管理机制评估：	建立了动态风险管理机制，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：	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：	制定了有效的激励制度和机制，股指期货交易盈亏与业务人员收入不挂钩。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：	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。
回溯分析情况评估：	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，并按规定向监管机构报告。

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。