

长城财富保险资产管理股份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-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：	刘文鹏	职务：	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	1972-03
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	总经理室	行政责任人入司时间	2019-03-19
行政责任人专业资质	注册会计师	行政责任人专业技术职务	高级会计师
专业责任人：	缴文超	职务：	总经理助理
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	1981-02
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	2020-08-04	专业责任人所在部门	总经理室
专业责任人专业资质	证券、基金、期货从业资格，具备相关投资领域10年以上从业经历	专业责任人专业技术职务	具备10年以上金融行业投研工作经验

二、基本条件

整体评估情况：	公司采用分级授权形式，董事会授权总经理室对股指期货等衍生品进行投资，总经理室下设投资工作委员会设定投资原则、投资目标和投资额度，各业务部门在授权额度范围内，对投资经理进行投资授权。在业务操作方面，公司发布了《股指期货业务操作细则》，对投资、研究、交易、风控、清算结算等相关部门职责进行明确规定。公司投研部门会根据市场变动情况，适时制定和调整多元化的对冲策略。在风控和合规方面，公司下发了《股指期货业务风险控制指引》、《股指期货投资业务风险管理实施细则（试行）》两项制度，对业务操作合规性、内部控制、风险管理等事项进行了规定。公司目前已经搭建了成熟的交易、估值、清算、风控系统，目前衍生品交易人员、资产配置和投资人员、风控人员、运营保障人员等均符合衍生品投资经验的年限要求且都通过期货从业资格考试。公司近两年没有受到监管机构的重大行政处罚，公司衍生品投资管理能力（股指期货）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。
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：	公司衍生品运用管理能力（股指期货）组织架构符合监管要求。根据《长城财富保险资产管理股份有限公司授权管理制度》（长资【2021年】9号），董事会知晓参与股指期货交易的各类风险，并授权公司经营层进行股指期货操作，依据公司《授权管理细则》，授权不同层级管理人员的职责和衍生品决策机制，并进行定期和不定期报告，所有操作满足国内法律法规要求。总经理室下设投资工作委员会，负责股指期货投资的投资原则、投资目标和投资额度的制定，并采用分级授权形式，由相关业务部门完成衍生品投资操作。公司下发了《部门职责及岗位设置》（长资人力【2020】8号），按照相关规定对股指期货部门设置和职责进行了明确。经评估，公司组织架构符合衍生品运用管理能力标准（股指期货）的要求。
投资交易部门	
1	

部门名称：	投资研究部		
发文时间：	2020-12-22	文件名称（含文号）：	关于下发公司《部门职责及岗位设置》的通知（长资人力【2020】8号）
岗位设置：	研究岗		
2			
部门名称：	组合管理部		
发文时间：	2020-12-22	文件名称（含文号）：	关于下发公司《部门职责及岗位设置》的通知（长资人力【2020】8号）
岗位设置：	资产配置岗		
3			
部门名称：	股票投资部		
发文时间：	2020-12-22	文件名称（含文号）：	关于下发公司《部门职责及岗位设置》的通知（长资人力【2020】8号）
岗位设置：	投资经理		
4			
部门名称：	集中交易部		
发文时间：	2021-07-26	文件名称（含文号）：	《关于进一步明确金融市场投资中心、集中交易部部门职责及岗位设置的通知》（长资人力【2021】7号）
岗位设置：	交易员		
风险管理部			
1			
部门名称：	风险合规部		
发文时间：	2020-12-22	文件名称（含文号）：	关于下发公司《部门职责及岗位设置》的通知（长资人力【2020】8号）
岗位设置：	风险管理岗		
清算核算部门			
1			
部门名称：	财务部		
发文时间：	2020-12-22	文件名称（含文号）：	关于下发公司《部门职责及岗位设置》的通知（长资人力【2020】8号）
岗位设置：	估值核算岗		
2			
部门名称：	运营保障部		
发文时间：	2020-12-22	文件名称（含文号）：	关于下发公司《部门职责及岗位设置》的通知（长资人力【2020】8号）
岗位设置：	清算岗		
内部稽核部门			
1			
部门名称：	审计部		
发文时间：	2020-12-31	文件名称（含文号）：	关于下发公司组织架构及审计部职责和岗位设置的通知（长资【2020】11号）
岗位设置：	审计岗		
防火墙机制：	公司通过《全面风险管理制度》和《股指期货投资业务风险管理实施细则（试行）》对部门独立运作和业务分离做了严格的规定，严格分离前、中、后台岗位责任，不相容岗位相互分离、制约和监督。公司防火墙机制建设符合衍生品运用管理能力标准（股指期货）的要求。		

评估结果：	符合规定
-------	------

四、专业队伍

整体评估情况：						
我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6人，分析研究人员1名，风险控制专业人员3人，清算和核算专业人员2人，均已通过期货从业人员资格考试，投资交易、风险控制和清算岗位人员不存在相互兼任情况，负责人具有5年以上期货或证券业务经验，业务经理具有3年以上期货或证券从业经验。经评估，公司专业队伍符合衍生品运用管理能力标准（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	孟晓林	研究岗	否	期货或证券业务经验	未通过	5.50
2	王文海	审计岗	否	其他	未通过	19.80
3	张译从	研究岗	是	期货或证券业务经验	已通过	5.31
4	缴文超	研究岗	否	期货或证券业务经验	已通过	11.75
5	乔雪	资产配置岗	是	期货或证券业务经验	已通过	6.34
6	李青青	资产配置岗	是	期货或证券业务经验	已通过	5.34
7	杨海达	投资经理	是	期货或证券业务经验	已通过	10.67
8	王璋	估值核算岗	是	期货或证券业务经验	已通过	4.75
9	斯勤夫	清算岗	否	期货或证券业务经验	已通过	9.76
10	程明	交易员	是	期货或证券业务经验	已通过	3.42
11	张春雪	风险管理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	6.65
12	侯文杰	风险管理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	2.68
13	张维娜	风险管理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	8.01

五、投资规则与基本制度

整体评估情况：		
公司已经按照《保险机构衍生品运用管理能力标准》建立了股指期货投资规则和基本制度，包括制定了风险对冲方案、与交易结算机构签署了协议文件、发布了《股指期货业务操作细则》，对投资、研究、交易、风控、清算结算等相关部门职责进行明确规定。在风控和合规方面，公司制定了《内部控制管理制度》、《全面风险管理制度》、《股指期货业务风险控制指引》、《股指期货投资业务风险管理实施细则（试行）》，以及《员工行为问责管理办法》，以上制度均已完成正式发布，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
风险管理制度	符合规定	文件名称：《股指期货投资业务风险管理实施细则（试行）》， 发文文号：长资风险【2021】11号， 发文时间：2021-10-15； 文件名称：《全面风险管理制度》， 发文文号：长资【2020】4号， 发文时间：2020-03-26；
衍生品交易业务操作制度	符合规定	文件名称：《股指期货业务操作细则》， 发文文号：长资研究【2020】2号， 发文时间：2020-12-31；
问责制度	符合规定	文件名称：《员工行为问责管理办法》， 发文文号：长资风险【2019】29号， 发文时间：2019-12-31；

内部控制制度	符合规定	文件名称：《内部控制管理制度》， 发文文号：长资【2019】11号， 发文时间：2019-12-31； 文件名称：《股指期货业务风险控制指引》， 发文文号：长资风险【2021】12号， 发文时间：2021-10-15； 文件名称：《授权管理制度》， 发文文号：长资【2021】9号， 发文时间：2021-10-14； 文件名称：《授权管理细则（2021版）》， 发文文号：长资【2021】6号， 发文时间：2021-04-06；
与交易结算机构签署协议文件	符合规定	文件名称：《期货经纪合同》， 发文文号：无， 发文时间：2020-11-25；
风险对冲方案	符合规定	文件名称：《股指期货风险对冲方案》， 发文文号：无， 发文时间：2020-12-31；

六、托管机制

整体评估情况：
公司托管机制符合《保险机构衍生品运用管理能力标准》的规定，公司已经与资产托管机构签署了托管协议，明确了股指期货业务的资金划拨、清算、估值等事项，双方权利和义务明确。

七、系统建设

整体评估情况：			
公司已经按照《保险机构衍生品运用管理能力标准》相关要求完成股指期货交易的系统建设，包括投资交易系统、会计核算系统、风险管理系统等模块建设，系统建设涵盖股指期货业务的处理设备、交易软件、操作系统，并经过公司多轮测试，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	HUNDSUN投资交易管理系统软件V03.2		
上线时间	2015-03-31	评估结果	符合规定
主要功能	公司目前上线的恒生投资交易管理系统V03.2，该系统目前是行业内比较成熟的交易管理系统，该交易系统与合作期货公司交易结算信息系统对接，并且已经通过内部穿行测试和交易测试，所有交易数据均在公司本地服务器进行备份。现有交易系统能够支持公司股指期货交易和结算稳定运行，符合监管要求。		
投资分析系统：			
系统名称	IfinD投研知识管理系统		
上线时间	2020-09-30	评估结果	符合规定
主要功能	公司目前上线IfinD投研知识管理系统，该系统主要用于衍生品投资分析、衍生品交易和对冲策略的搭建、套保资产组合所需的衍生品数量计算、担保品或保证金动态跟踪和调整。同时用于交易策略的文档的保存和留痕。该系统符合《保险机构衍生品运用管理能力标准》相关要求。		
资产估值和核算系统：			
系统名称	HUNDSUN资产估值与会计核算系统软件V2.6		
上线时间	2015-03-31	评估结果	符合规定
主要功能	公司目前上线恒生资产估值与会计核算系统软件V2.6，该系统配备了估值和清算模块，系统包含会计确认、计量、账务处理及财务报告等功能均符合标准要求，公司股指期货托管方为工商银行，该系统能够与托管行系统进行对接，系统信息合规可靠，且满足公司估值需求，资产估值和核算系统符合监管要求。		
风险管理信息系统：			
系统名称	HUNDSUN投资绩效评估与风险管理系统软件V3.0		
上线时间	2015-03-31	评估结果	符合规定
主要功能	公司目前上线恒生投资绩效评估与风险管理系统软件V3.0，该风险管理信息系统能够实时跟踪和监控股指期货交易，通过在系统设定各类风控阈值，系统可以对交易异常行为、保证金追加等进行实时监测和预警，风险管理信息系统符合监管要求。		

八、风险管理

整体评估情况：	
公司建立了相对完备的风险管理体系。经董事会决议，公司制定了《全面风险管理制度》（长资【2020】4号），全面风险管理制度对风险管理的目标和原则、组织架构和职责、风险管理制度体系、风险偏好体系、风险管理工具、风险管理流程、报告和沟通机制都做了明确的规定。为实现经营目标，防范和化解经营管理过程中的各种风险，保证保险资金运用符合公司的发展规划，在充分考虑内外部环境的基础上，发布了《内部控制管理制度》（长资【2019】11号），在此基础上，按照《保险机构衍生品运用管理能力标准》，公司制定了《股指期货业务风险控制指引》（长资风险【2020】17号）、《股指期货投资业务风险管理实施细则（试行）》（长资风险【2020】18号），针对股指期货业务进行专门的风险管理体系的搭建。整体看公司建立了完善的风险管理体系，包括针对股指期货的风险管理制度、动态风险管理机制、风险预警机制、激励制度和奖惩机制、内部审计和监督检查机制，偏差回溯机制等，各项风险管理指标固化在系统中，部分阈值在公司信息技术系统中进行设置，对风险实时追踪，公司风险管理体系符合《保险机构衍生品运用管理能力标准-股指期货》的规定。	
动态风险管理机制评估：	公司按照监管要求建立了动态风险管理机制，制定了股指期货交易的全面风险管理制度与业务操作流程，并建立了应急机制和管理预案，对市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规风险进行事前、事中和事后动态风险管理，将各项风险管理指标固化在信息系统中，建立实时监测、评估与处置风险的信息系统，实行投资业务风险管理报告制度，动态风险管理机制符合监管规定。
风险对冲有效性预警机制评估：	公司按照监管要求，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，制定了风险对冲有效性预警机制，并及时根据市场变化对交易作出风险预警。风险对冲有效性预警机制符合监管规定。
激励制度和机制评估：	公司股指期货交易仅限于套期保值和风险对冲，因此公司未简单将股指期货交易的盈亏与业务人员收入挂钩，还包含风险合规类等综合性考量指标。后台及风险管理部门执行隔离墙制度，其人员薪酬独立于股指期货交易的盈亏情况。公司激励制度和机制符合监管规定。
定期监督检查情况评估：	公司内部审计部门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。检查包括人员资质、业务合规情况、制度执行情况、避险政策及有效性评估等。定期监督检查机制符合监管规定。
回溯分析情况评估：	公司每半年会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。

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。