

招商信诺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— 20230119）



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:	黄旭锋	职务:	总经理、首席执行官兼审计责任人
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	1979-10
行政责任人学历	研究生	行政责任人学位	博士
行政责任人所在部门	经营管理层	行政责任人入司时间	2021-01-01
行政责任人专业资质	具备相关投资领域10年以上从业经历	行政责任人专业技术职务	无
专业责任人:	段彦飞	职务:	组合投资管理部总经理
专业责任人类别:	授权的相关资产管理部负责人	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	1979-10
专业责任人学历	研究生	专业责任人学位	博士
专业责任人入司时间	2020-12-01	专业责任人所在部门	组合投资管理部
专业责任人专业资质	通过期货从业资格考试，中级经济师，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	无

二、基本条件

整体评估情况:	<p>公司具有良好公司治理结构，根据《招商信诺资产管理有限公司章程》，建立了符合公司治理要求的股东大会、董事会、监事会及经营管理层，根据《招商信诺资产管理有限公司章程》及《招商信诺资产管理有限公司衍生品交易业务操作制度》、《招商信诺资产管理有限公司衍生品交易业务风险管理流程》、《招商信诺资产管理有限公司衍生品交易业务内部控制制度》等制度，规范了股指期货业务开展的各项环节。公司建立了完善的授权管理体系，明确了股东大会、董事会、经营管理层的职责权限，确保了决策的科学性和有效性。公司建立了健全的风险管理制度，涵盖了市场风险、信用风险、操作风险、流动性风险等，并配备了专业的风险管理团队和系统，能够有效识别、评估和控制风险。公司具备充足的专业人员，相关人员均具备相应的从业资格和工作经验，能够满足股指期货业务开展的需要。公司自成立以来，运营规范，未受到监管机构的重大行政处罚。公司自评估认为，公司衍生品运用管理能力（股指期货）的基本条件均符合《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>
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:</p> <p>公司根据《公司法》、《证券法》、《期货管理条例》等相关法律法规，结合公司实际情况，建立健全了公司治理结构、内部控制制度、风险管理机制、合规管理体系、信息披露制度、投资者关系管理制度等各项规章制度。公司建立了规范的决策程序，明确了各部门的职责分工，形成了科学合理的组织架构。公司注重人才队伍建设，不断提升员工的专业素质和业务能力。公司建立了完善的绩效考核体系，有效激发了员工的积极性和创造性。公司具有良好的社会信誉和品牌形象，与监管部门、行业协会、客户等建立了良好的沟通与合作关系。公司整体运营稳健，风险控制有效，符合相关法律法规的要求，具备良好的可持续发展能力。</p>			
<p>投资交易部门</p>			
1			
部门名称:	权益投资部		
发文时间:	2022-11-22	文件名称(含文号):	《招商信诺资产管理股份有限公司关于股票投资品运用的通知》(招商信诺资管发〔2022〕496号)
岗位设置:	股指期货投资岗, 股指期货研究岗, 部门负责人		
2			
部门名称:	组合投资管理部		
发文时间:	2022-11-22	文件名称(含文号):	《招商信诺资产管理股份有限公司关于股票投资品运用的通知》(招商信诺资管发〔2022〕496号)
岗位设置:	股指期货资产配置岗, 部门负责人		
3			
部门名称:	集中交易部		
发文时间:	2022-11-22	文件名称(含文号):	《招商信诺资产管理股份有限公司关于股票投资品运用的通知》(招商信诺资管发〔2022〕496号)
岗位设置:	股票交易岗		
<p>风险管理部</p>			
1			
部门名称:	风险管理部		

发文时间:	2022-11-22	文件名称 (含文号):	《招商信诺资产管理有限公 司关于进一步明确公衍生位 置及管理能力相关岗位职 责的通知》(招商信诺发 (2022) 496号)
岗位设置:	部门负责人,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:	2022-11-22	文件名称 (含文号):	《招商信诺资产管理有限公 司关于进一步明确公衍生位 置及管理能力相关岗位职 责的通知》(招商信诺发 (2022) 496号)
岗位设置:	估值核算岗,投资清算岗		
内部稽核部门	1		
部门名称:	审计部		
发文时间:	2022-12-28	文件名称 (含文号):	《招商信诺资产管理有限公 司关于稽核部门更名为审 计部并调整部门职责的通 知》(招商信诺资管发 (2022) 546号)
岗位设置:	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和规范的防火墙机制,确保投资、交易、风险管理、清算核算、风险控制、系统支持、绩效评估、审计稽核等岗位人员,资产配置和交易、风险控制、清算核算、研究分析、审计稽核等专业管理人员共12人。其中,资产配置和交易专业人员5人、风险控制专业人员3人、清算和核算专业人员2人,以上10名专业人员均已通过期货从业资格考试。投资交易、风险控制、清算核算岗位人员不存在相互兼任的情况。此外,公司配备了股指期货业务分析研究人员1人,审计稽核人员1人。公司无参与其他衍生品交易的情况。公司股指期货业务负责人具有13年期货或证券业务从业经验,5名业务经理均具有3年以上期货或证券业务从业经验。经评估,公司衍生品运用管理能力(股指期货)的专业队伍建设均符合《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:						
公司已配备股指期货交易专业管理人员,包括资产配置、分析研究、投资交易、清算核算、风险控制、系统支持、绩效评估、审计稽核等岗位人员。资产配置和交易、风险控制、清算核算、研究分析、审计稽核等专业管理人员共12人。其中,资产配置和交易专业人员5人、风险控制专业人员3人、清算和核算专业人员2人,以上10名专业人员均已通过期货从业资格考试。投资交易、风险控制、清算核算岗位人员不存在相互兼任的情况。此外,公司配备了股指期货业务分析研究人员1人,审计稽核人员1人。公司无参与其他衍生品交易的情况。公司股指期货业务负责人具有13年期货或证券业务从业经验,5名业务经理均具有3年以上期货或证券业务从业经验。经评估,公司衍生品运用管理能力(股指期货)的专业队伍建设均符合《保险机构衍生品运用管理能力标准-股指期货》的相关要求。						
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 从业资格考 试	相关经验年 限
1	杨帆	审计岗	否	期货或证券业务经验	未通过	6.46
2	钱漪昕	股指期货投 资岗	否	期货或证券业务经验	已通过	3.51

3	柴若琪	股指期货投资岗	否	期货或证券业务经验	已通过	5.54
4	詹孝颖	股指期货研究岗	否	期货或证券业务经验	已通过	3.55
5	段彦飞	股指期货资产配置岗	否	期货或证券业务经验	已通过	13.45
6	刘春辉	股指期货资产配置岗	是	期货或证券业务经验	已通过	10.45
7	张家璿	估值核算岗	否	期货或证券业务经验	已通过	6.33
8	王梓静	投资清算岗	否	期货或证券业务经验	已通过	15.13
9	姜帆	股票交易岗	否	期货或证券业务经验	已通过	12.01
10	由舒	风险管理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	5.40
11	黄翀	风险管理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	11.06
12	刘震	风险管理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	6.80

五、投资规则与基本制度

整体评估情况：

公司已建立完善、有效的股指期货交易管理制度，所有相关制度均经公司董事会、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。

公司制定了《招商信诺资产管理有限公司股指期货投资决策管理办法》，其附件《招商信诺资产管理有限公司股指期货套期保值方案》作为公司风险对冲方案，明确了套保主体及规模、套保目的、套保额度需求测算、套保策略、套保比率、套保效果评价标准、套保系统准备等，明确了股指期货各部门人员配置与职责，确保套保在合法、合规、诚信、高效运作，并由公司风险管理部、管理层投资决策委员会审批后下发执行。

公司已和中国建设银行股份有限公司深圳市分行及银河期货有限公司签署了《招商信诺资产管理有限公司股指期货和股指期货托管操作备忘录》，确定了股指期货业务交易、保证金管理、风险控制及数据传输等事项，明确双方权利和义务。

公司已建立健全股指期货交易业务操作、内部控制和风险管理制度。在业务操作制度方面，公司制定了《招商信诺资产管理有限公司股指期货投资管理细则》、《招商信诺资产管理有限公司股指期货研究管理办法》、《招商信诺资产管理有限公司股指期货业务操作细则》、《招商信诺资产管理有限公司股指期货投资管理细则》、《招商信诺资产管理有限公司股指期货业务操作细则》、《招商信诺资产管理有限公司股指期货投资管理细则》等制度，涵盖了研究、决策、交易、清算、结算等全过程，明确了岗位职责分工，保证了业务流畅、环节紧密衔接。

在风险管理方面，公司制定了《招商信诺资产管理有限公司全面风险管理制度》、《招商信诺资产管理有限公司市场风险管理细则》、《招商信诺资产管理有限公司股指期货业务风险管理细则》、《招商信诺资产管理有限公司股指期货业务风险管理细则》等制度，将股指期货风险管理纳入公司整体风险管理体系，形成了能够覆盖股指期货交易业务的前、中、后台的风险管理职责，形成了前、中、后台各相关部门相互独立、相互制约、权责明确的风险控制体系。

在问责制度方面，公司制定了《招商信诺资产管理有限公司股指期货投资管理细则》等制度，其中包含了股指期货交易主管人员和专业人员的责任追究管理办法。

经评估，公司衍生品运用管理能力（股指期货）的投资规则与基本制度建设均符合《保险机构衍生品运用管理能力标准-股指期货》的相关要求。

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：招商信诺资产管理有限公司股指期货套期保值方案， 发文文号：招商信诺资管发（2021）214号， 发文时间：2021-10-22；
与交易结算机构签署协议文件	符合规定	文件名称：招商信诺资产管理有限公司股指期货投资托管操作备忘录， 发文文号：无， 发文时间：2021-10-18；

衍生品交易业务操作制度	符合规定	文件名称：招商信诺资产管理有限公司股指期货投资业务账户管理细则， 发文文号：招商信诺资管发〔2021〕266号， 发文时间：2021-10-14； 文件名称：招商信诺资产管理有限公司股指期货投资管理辦法， 发文文号：招商信诺资管发〔2021〕213号， 发文时间：2021-10-22； 文件名称：招商信诺资产管理有限公司股指期货投资业务估值与会计核算指引， 发文文号：招商信诺资管发〔2021〕265号， 发文时间：2021-10-14； 文件名称：招商信诺资产管理有限公司股指期货投资决策管理辦法， 发文文号：招商信诺资管发〔2021〕214号， 发文时间：2021-10-22； 文件名称：招商信诺资产管理有限公司股指期货交易管理辦法， 发文文号：招商信诺资管发〔2021〕216号， 发文时间：2021-10-25； 文件名称：招商信诺资产管理有限公司股指期货研究管理辦法， 发文文号：招商信诺资管发〔2021〕215号， 发文时间：2021-10-22； 文件名称：招商信诺资产管理有限公司股指期货保证金结算交割管理细则， 发文文号：招商信诺资管发〔2021〕264号， 发文时间：2021-10-14； 文件名称：招商信诺资产管理有限公司异常交易行为管理辦法， 发文文号：招商信诺资管发〔2022〕396号， 发文时间：2022-09-07；
内部控制制度	符合规定	文件名称：招商信诺资产管理有限公司内部控制管理制度， 发文文号：招商信诺资管发〔2021〕160号， 发文时间：2021-07-22； 文件名称：招商信诺资产管理有限公司股指期货业务风险管理辦法， 发文文号：招商信诺资管发〔2021〕208号， 发文时间：2021-09-16； 文件名称：招商信诺资产管理有限公司股指期货投资管理辦法， 发文文号：招商信诺资管发〔2021〕213号， 发文时间：2021-10-22；
风险管理制度	符合规定	文件名称：招商信诺资产管理有限公司全面风险管理制度， 发文文号：招商信诺资管发〔2022〕169号， 发文时间：2022-04-28； 文件名称：招商信诺资产管理有限公司压力测试管理辦法， 发文文号：招商信诺资管发〔2021〕180号， 发文时间：2021-08-20； 文件名称：招商信诺资产管理有限公司市场风险管理辦法， 发文文号：招商信诺资管发〔2021〕352号， 发文时间：2021-12-13； 文件名称：招商信诺资产管理有限公司股指期货业务风险管理辦法， 发文文号：招商信诺资管发〔2021〕208号， 发文时间：2021-09-16； 文件名称：招商信诺资产管理有限公司重大突发事件应急管理制度， 发文文号：招商信诺资管发〔2021〕269号， 发文时间：2021-10-16；
问责制度	符合规定	文件名称：招商信诺资产管理有限公司股指期货投资管理辦法， 发文文号：招商信诺资管发〔2021〕213号， 发文时间：2021-10-22； 文件名称：招商信诺资产管理有限公司违规违纪及案件责任追究管理辦法， 发文文号：招商信诺资管发〔2021〕202号， 发文时间：2021-09-02；

六、托管机制

<p>整体评估情况:</p> <p>公司已建立股指期货交易系统，并通过了系统测试和验收。系统采用恒生交易系统V03.2，支持股指期货交易流程管理、可用头寸及风险控制等功能。系统运行稳定，能够满足估值需求。经评估，公司衍生品运用管理能力（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。</p>

七、系统建设

<p>整体评估情况:</p> <p>公司已建立股指期货交易系统，并通过了系统测试和验收。系统采用恒生交易系统V03.2，支持股指期货交易流程管理、可用头寸及风险控制等功能。系统运行稳定，能够满足估值需求。经评估，公司衍生品运用管理能力（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。</p>

交易结算系统:			
系统名称	恒生投资交易系统V03.2		
上线时间	2021-10-23	评估结果	符合规定
主要功能	公司已配置交易结算系统，采用恒生投资交易系统V03.2，通过深证通FDEP路由网关对接合作交易结算机构信息系统，并建立了相应的备份通道。系统为业内成熟功能模块，具备股指期货交易流程管理、可用头寸及风险控制、保证金管理、清算管理等功能，且能够满足交易需求。经评估，该系统功能齐全、运行稳定，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。		

投资分析系统:			
系统名称	恒生投资交易系统V03.2		
上线时间	2021-10-23	评估结果	符合规定
主要功能	公司已配置投资分析系统，采用恒生投资交易系统V03.2，系统包括套保额度管理、套保事前分析、套保方案审批、套保方案维护、套保风险监控、套保信息查询等功能，具备回归分析、时变分析、情景分析、保证金分析等能力。系统支持计算对冲资产组合风险所需衍生品数量，并能根据市场变化，调整衍生品规模，逐步实现担保品动态调整。经评估，公司衍生品运用管理能力（股指期货）的投资分析系统建设情况符合《保险机构衍生品运用管理能力标准-股指期货》的相关要求。		

资产估值和核算系统:			
系统名称	赢时胜资产估值与核算系统		
上线时间	2021-10-23	评估结果	符合规定
主要功能	公司已配置资产估值和核算系统，采用赢时胜资产估值与核算系统，系统配备了股指期货估值与清算模块，股指期货业务核算会计确认、计量、财务处理及财务报告等功能，符合规定。系统依据清算文件完成估值核算，并与托管行核算系统对接，清算数据通过合作期货公司专线获取，包括成交明细、持仓数据、保证金及费用数据等。经确认，合作期货公司与托管银行的信息系统合规可靠。股指期货资产估值和核算系统运行稳定高效，且能够满足估值需求。经评估，公司衍生品运用管理能力（股指期货）的资产估值和核算系统建设情况符合《保险机构衍生品运用管理能力标准-股指期货》的相关要求。		

风险管理信息系统:			
-----------	--	--	--

系统名称	恒生投资交易系统V03.2、恒生绩效评估与风险管理系统	
上线时间	2021-10-23	评估结果
主要功能	符合规定	
	<p>公司已建立股指期货业务风险管理信息系统，配置了股指期货业务风险管理信息系统，能够实现股指期货业务风险管理信息系统的各项功能，并能实时监控股指期货业务的风险状况。系统采用恒生投资交易系统V03.2和恒生风险管理系统，能够实现股指期货业务的风险管理功能，并能实时监控股指期货业务的风险状况。系统采用恒生投资交易系统V03.2和恒生风险管理系统，能够实现股指期货业务的风险管理功能，并能实时监控股指期货业务的风险状况。</p>	

八、风险管理

整体评估情况：	<p>公司已建立股指期货业务风险管理信息系统，配置了股指期货业务风险管理信息系统，能够实现股指期货业务风险管理信息系统的各项功能，并能实时监控股指期货业务的风险状况。系统采用恒生投资交易系统V03.2和恒生风险管理系统，能够实现股指期货业务的风险管理功能，并能实时监控股指期货业务的风险状况。系统采用恒生投资交易系统V03.2和恒生风险管理系统，能够实现股指期货业务的风险管理功能，并能实时监控股指期货业务的风险状况。</p>
动态风险管理机制评估：	<p>公司已建立股指期货业务风险管理信息系统，配置了股指期货业务风险管理信息系统，能够实现股指期货业务风险管理信息系统的各项功能，并能实时监控股指期货业务的风险状况。系统采用恒生投资交易系统V03.2和恒生风险管理系统，能够实现股指期货业务的风险管理功能，并能实时监控股指期货业务的风险状况。系统采用恒生投资交易系统V03.2和恒生风险管理系统，能够实现股指期货业务的风险管理功能，并能实时监控股指期货业务的风险状况。</p>
风险对冲有效性预警机制评估：	<p>公司已建立股指期货业务风险管理信息系统，配置了股指期货业务风险管理信息系统，能够实现股指期货业务风险管理信息系统的各项功能，并能实时监控股指期货业务的风险状况。系统采用恒生投资交易系统V03.2和恒生风险管理系统，能够实现股指期货业务的风险管理功能，并能实时监控股指期货业务的风险状况。系统采用恒生投资交易系统V03.2和恒生风险管理系统，能够实现股指期货业务的风险管理功能，并能实时监控股指期货业务的风险状况。</p>
激励制度和机制评估：	<p>公司已建立股指期货业务风险管理信息系统，配置了股指期货业务风险管理信息系统，能够实现股指期货业务风险管理信息系统的各项功能，并能实时监控股指期货业务的风险状况。系统采用恒生投资交易系统V03.2和恒生风险管理系统，能够实现股指期货业务的风险管理功能，并能实时监控股指期货业务的风险状况。系统采用恒生投资交易系统V03.2和恒生风险管理系统，能够实现股指期货业务的风险管理功能，并能实时监控股指期货业务的风险状况。</p>

定期监督检查情况评估：	在监督检查机制方面，公司制定了《招商信诺资产管理有限公股指期货投资管理理办法》，规定了公司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审计报告。检查范围包括业务合规情况、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：	在偏差回溯方面，公司制定了《招商信诺资产管理有限公股指期货投资管理理办法》，规定了公司审计部定期对股指期货交易进行监督检查，每半年度回溯买入计划与实际执行的偏差情况，并将回溯情况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。