

# 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— 20240124）



## 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：          | 总经理兼首席执行官  |
| 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    | 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 |
| 专业责任人类型：  | 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>公司具有良好的公司治理结构，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股指期货业务管理办法》等制度，明确了股指期货业务的管理流程，建立了符合公司要求的股指期货业务管理制度，并授权管理层负责股指期货业务的管理工作。董事会对全面风险管理负有最终责任，董事会下设风险管理委员会，负责全面风险管理工作的总体目标、风险偏好、风险容忍度和风险管理政策以及股指期货投资的各项风险及衍生品交易业务操作制度、内部控制制度和风险管理制度，并从投资决策、资金管理、会计核算、财务处理、审计稽核、信息系统管理、内部控制等方面规范了股指期货业务的操作流程，建立了可执行的业务操作流程和风险管理流程。</p> <p>系统建设方面，公司已建立投资交易、会计核算、风险管理等信息系统，包括恒生投资交易系统V03.2、恒生绩效评估与风险管理系统、赢时胜估值与核算系统，相关系统均通过了可靠性测试。</p> <p>专业队伍方面，公司已配备衍生品交易专业管理人员，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。公司参与股指期货交易的资产配置和投资交易专业人员人数、资质、从业经历均符合监管要求。</p> <p>公司自成立、成立以来未受到监管机构的行政处罚。</p> <p>经自评估，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

整体评估情况:

公司已建立了符合规定、健全有效的治理结构，根据《招商信诺资产管理股份有限公司章程》及《招商信诺资产管理股份有限公司董事会议事规则》等制度，明确股东会、董事会、监事会、经营管理层的职责权限，并制定《招商信诺资产管理股份有限公司投资管理制度》等专项制度，规范了投资管理流程，确保投资决策的科学性和合规性。同时，公司建立了完善的内部控制体系，包括风险管理、合规管理、内部审计等，能够有效防范和控制各类风险。此外，公司还加强了与监管机构的沟通与协作，确保各项业务符合监管要求。总体而言，公司的组织架构和管理制度健全有效，能够有效支持公司的稳健经营和可持续发展。

投资交易部门

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进一步明确公司股票投资管理能力及衍生品运用管理能力相关岗位职责的通知》(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进一步明确公司股票投资管理能力及衍生品运用管理能力相关岗位职责的通知》(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进一步明确公司股票投资管理能力及衍生品运用管理能力相关岗位职责的通知》(招商信诺资管发〔2022〕496号) |
| 岗位设置: | 股票交易岗      |            |   |

风险管理部门

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<br>限公司关于资管能力<br>及产品运用的通知》<br>(招商信诺资管发<br>(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<br>限公司关于资管能力<br>及产品运用的通知》<br>(招商信诺资管发<br>(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:  | 2023-04-08   | 文件名称 (含文号): | 《招商信诺资管有<br>限公司关于调整资产<br>权益投资部门职责<br>(招商信诺资管发<br>(2023) 150号)    |
| 岗位设置:  | 审计岗  |             |  |
| 防火墙机制: | <p>公司通过内部门及岗位设置、股指期货业务操作制度和规范的流程、股指期货风险管理体系、部门职责、岗位分工、信息系统的权限设置等, 确保招商信诺资管运营各环节业务分离, 《招商信诺资管运营管理办法》, 明确各部门岗位职责, 建立清晰的清算核算、投资交易、风险管理、合规、法律、风控等部门, 明确各部门职责, 确保各部门各司其职, 互不干扰。招商信诺资管运营各环节业务分离, 《招商信诺资管运营管理办法》, 明确各部门岗位职责, 建立清晰的清算核算、投资交易、风险管理、合规、法律、风控等部门, 明确各部门职责, 确保各部门各司其职, 互不干扰。</p> <p>股指期货业务操作制度和规范的流程、股指期货风险管理体系、部门职责、岗位分工、信息系统的权限设置等, 确保招商信诺资管运营各环节业务分离, 《招商信诺资管运营管理办法》, 明确各部门岗位职责, 建立清晰的清算核算、投资交易、风险管理、合规、法律、风控等部门, 明确各部门职责, 确保各部门各司其职, 互不干扰。</p> <p>股指期货业务操作制度和规范的流程、股指期货风险管理体系、部门职责、岗位分工、信息系统的权限设置等, 确保招商信诺资管运营各环节业务分离, 《招商信诺资管运营管理办法》, 明确各部门岗位职责, 建立清晰的清算核算、投资交易、风险管理、合规、法律、风控等部门, 明确各部门职责, 确保各部门各司其职, 互不干扰。</p> |             |  |
| 评估结果:  | 符合规定   |             |  |

#### 四、专业队伍

| 整体评估情况:  |    |     |                        |           |                            |            |
|--|----|-----|------------------------|-----------|----------------------------|------------|
| <p>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。资产配置和投资交易、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, 资产配置和投资交易专业人员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核。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员具有14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。</p> |    |     |                        |           |                            |            |
| 专业队伍人员基本信息:  |    |     |                        |           |                            |            |
| 序号   | 姓名 | 岗位  | 是否为能力<br>标准要求的<br>专职人员 | 相关经验类型    | 是否通过期<br>货从业人<br>员资格考<br>试 | 相关经验年<br>限 |
| 1  | 杨帆 | 审计岗 | 否                      | 期货或证券业务经验 | 未通过                        | 7.48       |

|    |     |           |   |           |     |       |
|----|-----|-----------|---|-----------|-----|-------|
| 2  | 钱漪昕 | 股指期货投资岗   | 否 | 期货或证券业务经验 | 已通过 | 4.53  |
| 3  | 柴若琪 | 股指期货投资岗   | 否 | 期货或证券业务经验 | 已通过 | 6.56  |
| 4  | 詹孝颖 | 股指期货研究岗   | 否 | 期货或证券业务经验 | 已通过 | 4.55  |
| 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 | 14.47 |
| 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 | 11.47 |
| 7  | 谢宜君 | 估值核算岗     | 否 | 期货或证券业务经验 | 已通过 | 4.15  |
| 8  | 王梓静 | 投资清算岗     | 否 | 期货或证券业务经验 | 已通过 | 16.14 |
| 9  | 姜帆  | 股票交易岗     | 否 | 期货或证券业务经验 | 已通过 | 13.03 |
| 10 | 黄翀  | 风险管理岗     | 否 | 期货或证券业务经验 | 已通过 | 12.08 |
| 11 | 由舒  | 风险管理岗     | 否 | 期货或证券业务经验 | 已通过 | 6.42  |
| 12 | 孙文昭 | 风险管理岗     | 否 | 期货或证券业务经验 | 已通过 | 4.40  |

## 五、投资规则与基本制度

|   |      |   |
|---|------|---|
| <p>整体评估情况：</p> <p>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，确保公司在股指期货的投资能够合法、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。</p> <p>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投资和托管业务操作备忘录》，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，明确双方权利义务。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、管理细则》、《招商信诺资产管理有限公司股指期货投资决策管理办法》、《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投资业务估值与会计核算指引》、《招商信诺资产管理有限公司股指期货清算管理细则》、《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》、《招商信诺资产管理有限公司股指期货清算管理细则》等制度，涵盖了研究、决策、交易、清算与结算等全过程，明确了责任分工，保证业务流程清晰，各环节紧密衔接。</p> <p>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》、《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总体风险管理架构，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员工违规违纪行为处理办法》、《招商信诺资产管理有限公司员工违规违纪及责任追究管理办法》、《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日常工作守则。</p> <p>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。</p> |      |   |
| 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，<br>发文字号：招商信诺资管发〔2021〕214号，<br>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，<br>发文字号：无，<br>发文时间：2021-10-18；              |



|             |      |   |
|-------------|------|---|
| 衍生品交易业务操作制度 | 符合规定 | <p>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，<br/>         发文文号：招商信诺资管发〔2021〕266号，<br/>         发文时间：2021-10-14；<br/>         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，<br/>         发文文号：招商信诺资管发〔2021〕265号，<br/>         发文时间：2021-10-14；<br/>         文件名称：招商信诺资产管理有限公司异常交易行为管理办法，<br/>         发文文号：招商信诺资管发〔2022〕396号，<br/>         发文时间：2022-09-07；<br/>         文件名称：招商信诺资产管理有限公司股指期货投资管理办法，<br/>         发文文号：招商信诺资管发〔2021〕213号，<br/>         发文时间：2021-10-22；<br/>         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办法，<br/>         发文文号：招商信诺资管发〔2021〕214号，<br/>         发文时间：2021-10-22；<br/>         文件名称：招商信诺资产管理有限公司股指期货研究管理办法，<br/>         发文文号：招商信诺资管发〔2021〕215号，<br/>         发文时间：2021-10-22；<br/>         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，<br/>         发文文号：招商信诺资管发〔2021〕264号，<br/>         发文时间：2021-10-14；<br/>         文件名称：招商信诺资产管理有限公司股指期货投资交易业务细则，<br/>         发文文号：招商信诺资管发〔2023〕611号，<br/>         发文时间：2023-12-29；</p> |
| 内部控制制度      | 符合规定 | <p>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办法，<br/>         发文文号：招商信诺资管发〔2021〕208号，<br/>         发文时间：2021-09-16；<br/>         文件名称：招商信诺资产管理有限公司股指期货投资管理办法，<br/>         发文文号：招商信诺资管发〔2021〕213号，<br/>         发文时间：2021-10-22；<br/>         文件名称：招商信诺资产管理有限公司内部控制管理制度，<br/>         发文文号：招商信诺资管发〔2022〕117号，<br/>         发文时间：2022-04-06；</p>  |
| 风险管理制度      | 符合规定 | <p>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办法，<br/>         发文文号：招商信诺资管发〔2021〕208号，<br/>         发文时间：2021-09-16；<br/>         文件名称：招商信诺资产管理有限公司市场风险管理办法，<br/>         发文文号：招商信诺资管发〔2023〕358号，<br/>         发文时间：2023-08-01；<br/>         文件名称：招商信诺资产管理有限公司压力测试管理办法，<br/>         发文文号：招商信诺资管发〔2023〕307号，<br/>         发文时间：2023-07-12；<br/>         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办法，<br/>         发文文号：招商信诺资管发〔2023〕437号，<br/>         发文时间：2023-09-12；<br/>         文件名称：招商信诺资产管理有限公司全面风险管理制度，<br/>         发文文号：招商信诺资管发〔2023〕428号，<br/>         发文时间：2023-09-04；</p>  |

有  
1304

|      |      |   |
|------|------|---|
| 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<br>办法，<br>发文文号：招商信诺资管发（2021）213号，<br>发文时间：2021-10-22；<br>文件名称：招商信诺资产管理有限公司违规违纪及案<br>件责任追究管理办法，<br>发文文号：招商信诺资管发（2021）202号，<br>发文时间：2021-09-02；<br>文件名称：招商信诺资产管理有限公司问责管理办<br>法，<br>发文文号：招商信诺资管发（2024）17号，<br>发文时间：2024-01-11；<br>文件名称：招商信诺资产管理有限公司员工违规违纪<br>行为处理办法，<br>发文文号：招商信诺资管发（2024）18号，<br>发文时间：2024-01-11； |
|------|------|---|

## 六、托管机制

|   |
|---|
| <p>整体评估情况：</p> <p>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投资托管操作备忘录》，明确了股指期货指令下达方式及应急措施、相关交易费率及划付方式、交易清算密押及授权机制、结算数据内容、股指期货业务运营过程中权利和义务。经评估，公司衍生品运用管理能力（股指期货）的托管机制均符合《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> |
|---|

## 七、系统建设

|  |  |      |      |
|--|--|------|------|
| 整体评估情况：  |  |      |      |
| <p>公司已建立股指期货交易的投资、交易、会计核算和风险管理等信息系统。信息系统包括业务处理设备、交易软件和操作系统等。公司已通过系统可靠性测试，并形成信息说明材料及功能测试报告。</p> <p>公司已配置投资分析系统，采用恒生投资交易系统V03.2，计算对冲资产组合风险所需的衍生品数量，并能根据市场变化，调整衍生品规模，逐步实现动态调整。</p> <p>公司已配置资产估值系统，采用恒生估值与核算系统，配备了股指期货估值与清算模块，会计确认、计量、账务处理及财务报告等功能符合会计准则。经确认，合作期货公司与托管银行的系统对接可靠。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。</p> <p>公司已配置风险管理信息系统，采用恒生投资交易系统V03.2和恒生绩效评估与风险管理系统，能够实现股指期货交易的实时监控，已将各项风险管理指标固化在系统中，并能够及时预警。</p> <p>公司已配置交易清算系统，采用恒生投资交易系统V03.2，支持股指期货交易流程管理、可用头寸及风险控制、保证金管理、清算管理等业务功能，能够满足行情、交易和清算的需要。经评估，该系统功能齐全、运行稳定高效，且能够满足交易需求。公司衍生品运用管理能力（股指期货）的交易清算系统建设情况均符合《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> |  |      |      |
| 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   | <p>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<br/>         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<br/>         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<br/>         算管理等业务功能，可以满足行情、交易和清算的需要。经评估，该系统功能齐<br/>         全、运行稳定高效，且能够满足交易需求。公司衍生品运用管理能力（股指期<br/>         货）的交易清算系统建设情况均符合《保险机构衍生品运用管理能力标准-股指<br/>         期货》的相关要求。</p> |      |      |
| 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，逐步实现系统建设，逐步实现系统建设，逐步实现系统建设，逐步实现系统建设。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，股指期货业务会计确认、计量、财务处理及财务报告等进行对账，清算数据通过系统对接获取，估值核算，并与托管行数据核对、保证金及费用数据等。经确认，系统运行稳定，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 | 符合规定 |
| 主要功能       | 公司已配置风险管理信息系统，采用恒生投资交易系统软件V03.2和恒生风险管理及绩效评估系统，能够实时监控股指期货交易全流程审批管理、可用头寸及风险控制，已将各项风险指标固化在系统中，并能够及时预警。风控人员可针对监管和公司的风控要求进行严格风险控制。经评估，公司衍生品运用管理能力（股指期货）的风险管理符合《保险机构衍生品运用管理能力标准-股指期货》的相关要求。                    |      |      |

## 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统，公司建立了动态风险管理机制，制定了《招商信诺资产管理股份有限公司股指期货业务风险管理、办法》、《招商信诺资产管理股份有限公司股指期货业务风险管理、办法》、《招商信诺资产管理股份有限公司股指期货业务风险管理、办法》等，并建立了完善的股指期货业务风险管理、办法。同时，公司在实际员工考核中严格按照上述要求执行。 |
| 在监督检查机制方面，公司在开展股指期货业务后，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。  |
| 在偏差回溯机制方面，公司在开展股指期货业务后，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纳入每半年及年度稽核审计报告，并按规定向国家金融监督管理总局报告。  |
| 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。  |

|                       |  |
|-----------------------|--|
| <p>动态风险管理机制评估：</p>    | <p>公司建立了《招商信诺资产管理机制》，明确了《招商信诺资产管理机制》的适用范围、管理流程、风险控制措施等，并定期进行评估和更新。公司建立了《招商信诺资产管理机制》的评估体系，包括对制度、流程、执行情况的全面评估。公司建立了《招商信诺资产管理机制》的评估体系，包括对制度、流程、执行情况的全面评估。公司建立了《招商信诺资产管理机制》的评估体系，包括对制度、流程、执行情况的全面评估。</p> |
| <p>风险对冲有效性预警机制评估：</p> | <p>在交易风险对冲方面，公司建立了《招商信诺资产管理机制》的预警机制，对风险对冲的有效性进行实时监控和预警。公司建立了《招商信诺资产管理机制》的预警机制，对风险对冲的有效性进行实时监控和预警。公司建立了《招商信诺资产管理机制》的预警机制，对风险对冲的有效性进行实时监控和预警。</p>  |
| <p>激励制度和机制评估：</p>     | <p>在激励制度和机制方面，公司制定了《招商信诺资产管理机制》的激励制度，将员工的薪酬与业绩挂钩，并定期进行考核和激励。公司建立了《招商信诺资产管理机制》的激励制度，将员工的薪酬与业绩挂钩，并定期进行考核和激励。公司建立了《招商信诺资产管理机制》的激励制度，将员工的薪酬与业绩挂钩，并定期进行考核和激励。</p>   |
| <p>定期监督检查情况评估：</p>    | <p>在监督检查机制方面，公司制定了《招商信诺资产管理机制》的监督检查制度，定期对各项业务进行监督检查，确保制度的有效执行。公司建立了《招商信诺资产管理机制》的监督检查制度，定期对各项业务进行监督检查，确保制度的有效执行。公司建立了《招商信诺资产管理机制》的监督检查制度，定期对各项业务进行监督检查，确保制度的有效执行。</p>                                 |
| <p>回溯分析情况评估：</p>      | <p>在偏差回溯方面，公司制定了《招商信诺资产管理机制》的回溯分析制度，定期对业务执行情况进行回溯分析，找出偏差原因并采取措施改进。公司建立了《招商信诺资产管理机制》的回溯分析制度，定期对业务执行情况进行回溯分析，找出偏差原因并采取措施改进。公司建立了《招商信诺资产管理机制》的回溯分析制度，定期对业务执行情况进行回溯分析，找出偏差原因并采取措施改进。</p>                 |

## 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，我达到了该项能力的基本要求，现按规定披露相关信息。

我承诺对本公告披露的及时性、内容的真实性、完整性负责。