









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证券交易所异常交易行为管理细则，          发文文号：招商信诺资管发（2024）389号，          发文时间：2024-09-14；          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，          发文文号：招商信诺资管发（2023）611号，          发文时间：2023-12-29；          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，          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办法，          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决策管理辦法，          发文文号：招商信诺资管发（2025）279号，          发文时间：2025-06-25；</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，          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；          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（2022）117号，          发文时间：2022-04-06；          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，          发文文号：招商信诺资管发（2021）208号，          发文时间：2021-09-16；</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，          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市场风险管理办法，          发文文号：招商信诺资管发（2024）577号，          发文时间：2024-12-27；          文件名称：招商信诺资产管理有限公司压力测试管理办法，          发文文号：招商信诺资管发（2025）303号，          发文时间：2025-04-29；          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（2025）269号，          发文时间：2025-06-17；          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辦法，          发文文号：招商信诺资管发（2023）437号，          发文时间：2023-09-12；</p>

111  
111  
111

问责制度	符合规定	文件名称：招商信诺资产管理有限公司员工违规违纪行为处理办法， 发文文号：招商信诺资管发（2024）18号， 发文时间：2024-01-11； 文件名称：招商信诺资产管理有限公司问责管理办法， 发文文号：招商信诺资管发（2024）17号， 发文时间：2024-01-11； 文件名称：招商信诺资产管理有限公司股指期货投资管理 管理办法， 发文文号：招商信诺资管发（2021）213号， 发文时间：2021-10-22；
------	------	---

## 六、托管机制

整体评估情况：
公司已和中国建设银行股份有限公司深圳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资金托管操作备忘录》，明确了股指期货交易指令下达方式及风险控制措施、相关交易费率及清算方式、交易清算及授权机制、结算数据传输内容、股指期货业务运营过程中涉及的各方在股指期货业务运营中的权利和义务。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。

## 七、系统建设

整体评估情况：			
公司已建立股指期货交易的投资交易系统、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，且形成信息系统的说明材料及管理动态调整。公司已配置资产估值和核算系统，配备了股指期货估值与清算模块，会计核算、计量、账务处理及财务报告等功能符合规定。公司系统依据清算文件完成估值核算，并与托管行核对、进行对账，清算数据通过合作期货公司专线的信息传输系统获取，包括成交明细、持仓数据、保证金及费用数据等。经确认，合作期货公司能够满足估值需求。公司已配置风险管理信息系统，采用恒生投资管理交易系统045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，可将风险管理指标固化在系统中，实现及时预警。公司已配置交易结算系统，采用恒生投资交易管理系统045，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，能够与合作的交易结算机构信息系统的对接，并建立了相应的备份通道。股指期货交易管理系统运行稳定、高效，且能够满足交易需求。经评估，公司衍生品运用管理能力（股指期货）的系统建设均符合《保险机构衍生品运用管理能力标准-股指期货》的相关要求。			
交易结算系统：			
系统名称	恒生投资交易管理系统045		
上线时间	2024-07-22	评估结果	符合规定
主要功能	公司已配置交易结算系统，采用恒生投资交易管理系统045，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）的交易结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。		
投资分析系统：			
系统名称	恒生投资交易管理系统045		
上线时间	2024-07-22	评估结果	符合规定
主要功能	公司已配置投资分析系统，采用恒生投资交易管理系统045，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，逐步实现担保动态调整。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。		
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清算模块，股指期货业务会计确认、计量、财务处理及财务核算报告等功能实现符合规定。公司系统依据清算文件完成估值核算，并与托管行核算系统进行对账，清算数据通过合作期货公司专线对接获取，包括持仓数据、保证金及费用数据等。经确认，合作期货公司托管银行的信息系统可靠。股指期货衍生品运用和管理能力（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	恒生投资交易管理系统045、恒生绩效评估与风险管理系统		
上线时间	2024-07-22	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，采用恒生投资交易管理系统045和恒生绩效评估与绩效评估系统，能够实现股指期货指令交易全流程审批管理、可用头寸及风险控制、保证金管理、信息查询、基础数据维护、股指期货交易的实时监控等功能，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指标和公司风控要求进行风险控制指标的设置，系统下达指令和执行指令均进行风控指标的审核，严格控制风险。经评估，公司衍生品运用和管理能力（股指期货）的风险管理信息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。		

## 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全面风险管理制度》、《招商信诺资产管理股份有限公司市场风险管理制度》、《招商信诺资产管理股份有限公司股指期货业务风险管理制度》、《招商信诺资产管理股份有限公司股指期货投资管理制度》和《招商信诺资产管理股份有限公司股指期货投资决策制度》等股指期货交易的全流程管理制度与业务操作流程，覆盖事前控制、事中监督、事后评价全风险管理制度；建立了完善的风险管理制度，包括风险预警与测试管理制度和《招商信诺资产管理股份有限公司重大突发事件应急管理制度》，制定了完善的应急管理制度和管理预案。其中，《招商信诺资产管理股份有限公司市场风险管理制度》和《招商信诺资产管理股份有限公司股指期货业务风险管理制度》规范了股指期货的风险管理原则、风险识别和管理、市场风险限额、风险计量、风险监测与预警、风险报告、绩效评估、压力测试、应急管理制度和重大突发事件应急管理制度等；《招商信诺资产管理股份有限公司重大突发事件应急管理制度》明确了应急管理制度、应急预案和演练内容；《招商信诺资产管理股份有限公司压力测试管理制度》明确了压力测试工作流程。公司将风险管理指标固化在系统中，可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。</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全面风险管理制度》、《招商信诺资产管理股份有限公司市场风险管理制度》、《招商信诺资产管理股份有限公司股指期货业务风险管理制度》、《招商信诺资产管理股份有限公司股指期货投资管理制度》和《招商信诺资产管理股份有限公司股指期货投资决策制度》等股指期货交易的全流程管理制度与业务操作流程，覆盖事前控制、事中监督、事后评价全风险管理制度；建立了完善的风险管理制度，包括风险预警与测试管理制度和《招商信诺资产管理股份有限公司重大突发事件应急管理制度》，制定了完善的应急管理制度和管理预案。其中，《招商信诺资产管理股份有限公司市场风险管理制度》和《招商信诺资产管理股份有限公司股指期货业务风险管理制度》规范了股指期货的风险管理原则、风险识别和管理、市场风险限额、风险计量、风险监测与预警、风险报告、绩效评估、压力测试、应急管理制度和重大突发事件应急管理制度等；《招商信诺资产管理股份有限公司重大突发事件应急管理制度》明确了应急管理制度、应急预案和演练内容；《招商信诺资产管理股份有限公司压力测试管理制度》明确了压力测试工作流程。公司将风险管理指标固化在系统中，可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。</p>

<p>风险对冲有效性预警机制评估：</p>	<p>在风险预警机制方面，公司设置了股指期货对冲有效性监测指标，建立了完善的风险管理信息系统，可实现对股指期货交易和期货业务风险对冲有效性执行情况的动态监控和预警。《招商信诺资产管理股份有限公司股指期货业务指标体系》规定，公司建立股指期货业务指标体系，并对指标体系运行情况进行持续监测和预警，及时化解风险隐患。公司已建立实时监测、评估与处置股指期货业务风险的信息系统，能将风险指标固化在系统中，并能够根据公司资产组合实际情况，动态监测相关风险控制指标和在风险对冲有效性执行情况的动态监控和预警。</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《招商信诺资产管理有限公司股指期货投资管理暂行办法》，制定了有效的激励制度和机制，明确规定不得简单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人员薪酬独立于交易盈亏情况。同时，公司在实际员工考核中严格按照上述要求执行。</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《招商信诺资产管理有限公司股指期货投资管理暂行办法》，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。</p>
<p>回溯分析情况评估：</p>	<p>在偏差回溯方面，公司制定了《招商信诺资产管理有限公司股指期货投资管理暂行办法》，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，并按规定向国家金融监督管理总局报告。</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。

