

中意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— 20220127）

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：	贡磊	职务：	公司总经理
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	1973-03
行政责任人学历	研究生	行政责任人学位	硕士
行政责任人所在部门	管理层	行政责任人入司时间	2013-12-02
行政责任人专业资质	具备相关领域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：	DANNINGER MARKUS	职务：	公司总经理助理
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	1977-02
专业责任人学历	研究生	专业责任人学位	硕士
专业责任人入司时间	2013-08-01	专业责任人所在部门	管理层
专业责任人专业资质	具备相关领域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>公司建立了职责明确、分工合理的股指期货交易组织架构，董事会知晓参与股指期货交易各类风险并承诺承担参与股指期货交易的最终责任。董事会授权经营管理层开展股指期货交易业务并定期向董事会报告，由经营管理层下设的投资管理委员会负责股指期货交易业务的具体开展，并按照分级管理、明确授权、规范操作、严格监管的原则形成了规范的投资决策体系。衍生品交易业务操作、内部控制和风险管理方面，公司发布了《中意资产管理有限责任公司股指期货投资管理制度》《中意资产管理有限责任公司股指期货保证金管理和结算管理办法》《中意资产管理有限责任公司股指期货交易管理办法》《中意资产管理有限责任公司股指期货业务风险管理办法》等制度，对衍生品交易业务操作、内部控制和风险管理做出了规定。信息系统方面，公司通过金仕达研发的资产管理交易系统、金仕达内置的风控系统、恒生公司的资产估值核算系统与会计核算V2.6系统及自建的FDA系统等，实现了股指期货的投资交易、会计核算和风险管理。人员方面，公司配备了股指期货交易专业管理人员，包括但不限于分析研究、投资交易、财务处理、风险控制和审计稽核等。公司近两年未受到监管机构重大行政处罚。经评估，公司衍生品运用（股指期货）管理能力达到《中国银保监会关于优化保险机构投资管理能力监管有关事项的通知》的要求。</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：	
---------	--

公司建立了职责明确、分工合理的股指期货交易组织架构，董事会知晓参与股指期货交易并承诺由操作期货并承诺承担参与股指期货交易最终责任。董事会授权经营层开展股指期货交易业务，并下发《关于中意资产管理有限责任公司设立股指期货投资相关部门的通知》设立了股指期货交易相关部门（包括组合管理部、权益投资部、投资部、清算部、财务部及内部审计稽核岗位，并建立了防火墙机制，部门岗位职责、部门负责岗位及部门负责岗位均无同一人兼职情况并建立了防火墙机制，实行严格的业务分离制度并保证岗位独立性。公司股指期货交易相关人员均具有期货或证券从业资格。

投资交易部门

1			
部门名称:	交易部		
发文时间:	2021-01-20	文件名称 (含文号):	《关于中意资产管理有限责任公司设立股指期货投资相关部门的通知》(中意资管[2021]人力10号)
岗位设置:	交易		

2			
部门名称:	权益投资部		
发文时间:	2021-01-20	文件名称 (含文号):	《关于中意资产管理有限责任公司设立股票投资部门的通知》(中意资管[2021]人力11号)
岗位设置:	投资		

3			
部门名称:	组合管理部		
发文时间:	2021-01-20	文件名称 (含文号):	《关于中意资产管理有限责任公司设立股指期货投资相关部门的通知》(中意资管[2021]人力10号)
岗位设置:	分析研究,股指期货投资负责人,资产配置		

风险管理部门

1			
部门名称:	法律合规部		
发文时间:	2021-01-20	文件名称 (含文号):	《关于中意资产管理有限责任公司设立股指期货投资相关部门的通知》(中意资管[2021]人力10号)
岗位设置:	法律合规岗		

2			
部门名称:	综合风控部风控中心		
发文时间:	2021-01-20	文件名称 (含文号):	《关于中意资产管理有限责任公司设立股指期货投资相关部门的通知》(中意资管[2021]人力10号)
岗位设置:	风险控制岗		

清算核算部门

1			
部门名称:	财务及清算部		
发文时间:	2021-01-20	文件名称 (含文号):	《关于中意资产管理有限责任公司设立股指期货投资相关部门的通知》(中意资管[2021]人力10号)
岗位设置:	清算岗		

2			
部门名称:	运营管理部		

发文时间：	2021-01-20	文件名称（含文号）：	《关于中意资产管理有限责任公司设立股指期货投资相关部门的通知》（中意资管[2021]人力10号）
岗位设置：	核算岗		
内部稽核部门			
1			
部门名称：	审计部		
发文时间：	2021-01-20	文件名称（含文号）：	《关于中意资产管理有限责任公司设立股指期货投资相关部门的通知》（中意资管[2021]人力10号）
岗位设置：	审计岗		
防火墙机制：	公司在不同部门之间设立了防火墙机制，实行严格的业务分离制度并明确公司应保持前中后台的相对独立性。股指期货交易相关的投资交易、财务处理、风险控制 and 审计稽核等人员均无同一人员兼职情况，确保岗位、账户及股指期货交易各项工作的独立性和客观性。		
评估结果：	符合规定		

四、专业队伍

整体评估情况：						
经评估，公司股指期货专业队伍建设达到《关于优化保险机构投资管理能力监管有关事项的通知》的相关要求。公司股指期货交易专业管理人员中，包括分析研究、投资交易、财务处理、风险控制和审计稽核等人员，其中资产配置和投资交易专业人员5人，分析研究人员1人，风险控制专业人员3人，清算和核算专业人员2人，审计稽核人员1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	苗清	交易	否	期货或证券业务经验	已通过	8.53
2	陈清爽	交易	否	期货或证券业务经验	已通过	8.45
3	王天一	审计岗	否	期货或证券业务经验	已通过	1.67
4	余浩	投资交易	否	期货或证券业务经验	已通过	6.19
5	汪欣	法律合规岗	否	期货或证券业务经验	已通过	6.64
6	聂小军	分析研究	否	期货或证券业务经验	已通过	8.45
7	聂小军	股指期货投资 负责人	否	期货或证券业务经验	已通过	8.45
8	张晗粟	资产配置	否	期货或证券业务经验	已通过	7.35
9	张敏生	风险控制岗	否	期货或证券业务经验	已通过	6.12
10	李少亨	风险控制岗	否	期货或证券业务经验	已通过	4.39
11	徐竞	清算岗	否	期货或证券业务经验	已通过	8.45
12	张玉亮	核算岗	否	期货或证券业务经验	已通过	4.70

五、投资规则与基本制度

整体评估情况：

整体评估情况：

公司与期货经纪商、资产托管机构签署的三方协议《股指期货投资托管运营备忘录》，主要内容包括账户开立（结算账户、保证金账户、交易编码、保证金账户余额、资金安全等）、资金划拨（划拨方式、划拨额度、预留印鉴和授权、指令时间）、结算数据传输（交易数据、结算数据、估值数据、传输时间及途径）、风险控制及监督（合规监管规定、保证金比例、持仓及期货账户风险度）等事项，明确了三方在各环节的权利和义务。

七、系统建设

整体评估情况：

公司综合运用金仕达公司研发的资产管理交易系统、金仕达内置的风控系统、恒生公司的资产估值核算系统与会计核算V2.6系统及自建的FDA系统等，建立了股指期货交易的投资交易、风险管理和会计核算等信息系统。公司股指期货交易的信息系统已包括业务处理设备、交易软件和操作系统等，股指期货交易管理系统稳定高效，均能满足交易需求。公司通过金仕达资产管理交易系统及其内置的风控系统作为风险管理信息系统，能够实现股指期货交易的实时监控，动态监测相关风险控制指标，各项风险管理指标固化在系统中，能够及时根据市场变化对交易作出风险预警。公司通过自建的FDA系统，可计算对冲资产组合风险所需的衍生品数量，能够根据市场变化，调整衍生品规模，逐步实现担保品动态调整。公司配备了恒生公司的资产估值核算系统与会计核算V2.6系统作为资产估值和核算系统，具备相应的股指期货股指与清算模块，会计确认、计量、账务处理及财务报告符合规定。公司交易结算系统能够与合作的交易结算机构信息系统对接，并建立相应的备份通道。以上系统均通过可靠性测试。经评估，公司股指期货交易的信息系统建设符合《保险机构衍生品运用管理能力标准》等有关要求。

交易结算系统：

系统名称	金仕达资产管理系统		
上线时间	2016-09-30	评估结果	符合规定
主要功能	交易结算通过金仕达系统进行，目前通过深圳通专线对接了中信、华泰等多家期货柜台，并配备多条备份通道。为了保证系统的稳定，高效，期货交易管理系统设计了双机互备架构，并通过深圳通专线交易，保证了期货交易的安全稳定。		

投资分析系统：

系统名称	FDA系统（内部开发）		
上线时间	2016-01-31	评估结果	符合规定
主要功能	FDA系统是我司自主研发的投资分析平台，其子模块能够根据资产配置和风险约束，计算对冲需要的衍生品数量，能够在盘中和盘后对衍生品规模、担保品数量和保证金风险度进行及时监控，并依此进行动态调整，确保对冲有效和担保品充足，实现担保品的动态调整。		

资产估值和核算系统：

系统名称	资产估值与会计核算系统		
上线时间	2013-05-31	评估结果	符合规定
主要功能	资产估值和核算系统采购恒生公司的资产估值与会计核算系统。配备了相应的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均遵循相应的会计准则，估值系统运行稳定，能够满足运营人员日常的估值需求。产品托管均选取工行、农行、招行等合规可靠的银行，运营人员会及时与对方进行清算数据核算，对账。		

风险管理信息系统：

系统名称	金仕达资产管理系统		
上线时间	2016-09-30	评估结果	符合规定
主要功能	公司以金仕达系统作为交易系统和风控系统，并配以自主开发，实时监控股指期货交易，对持仓头寸、比例、保证金等风险管理指标进行监控，并能及时预警。		

八、风险管理

整体评估情况：

