

中国人保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—国债期货（年度披露— 20230105）



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:	曾北川	职务:	总裁
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:	1963-03
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:	总裁室	行政责任人入司时间:	2019-11-02
行政责任人专业资质:	具有金融工作5年以上或者经济工作10年以上工作经历	行政责任人专业技术职务:	高级工程师
专业责任人:	王小虎	职务:	量化与衍生品投资部副总经理（主持工作）
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:	1982-02
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:	2010-07-01	专业责任人所在部门:	量化与衍生品投资部
专业责任人专业资质:	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，各层级管理机构、业务部门职责明确。公司专门制定了与国债期货交易相关的制度，从投资决策、风险管理、交易执行、资金清算、交割业务、信息系统管理等方面规范了国债期货业务的操作流程、复核流程、投后管理、清算核算、风险控制等各个环节，确保投资全流程合理规范。公司配备了包括分析研究、投资交易、清算核算、风险控制、估值核算、信息系统的国债期货交易专业管理人员，其人数、资质、从业经历均符合监管要求。所选交易、风控、估值核算信息系统的国债期货交易系统均能与现有业务妥善衔接，均是市场认可的主流系统，各子系统以及系统间的国债期货交易全景仿真测试均已顺利完成，各系统已在交易中实际使用。公司近两年未受到监管机构重大行政处罚。经评估，公司衍生品运用管理能力（国债期货）基本条件符合监管规定。</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:	<p>公司具有良好的公司治理结构，各层级管理机构、业务部门职责明确。国债期货交易业务由组合管理部或固定收益投资部门提出套期保值需求，由量化衍生品投资部负责套期保值方案的制定与实施，由交易部负责交易指令的执行，由运营管理部负责套期保值与清算核算，由风险管理部/法律合规部负责风险预警与合规性审核。董事会知晓相关风险并承担责任。公司设立了负责衍生品交易的董事会投资决策、风险管理、清算核算、内部稽核等部门。公司在不同部门之间设立了防火墙体系，实行严格的业务分离制度，确保投资交易、风险管理、清算核算、内部稽核等部门独立运作。公司已下发正式文件，在发文中明确部门职责、岗位职责、部门负责人及人员配置等。经评估，公司衍生品（国债期货）运用管理组织架构设置符合监管规定。</p>
投资交易部门	

1			
部门名称:	交易部		
发文时间:	2021-06-29	文件名称(含文号):	《关于印发《中国人保资产管理有限公司机构设置职能配置方案》的通知》(人保资产党发[2021]59号)
岗位设置:	现券交易岗		
2			
部门名称:	固定收益投资部		
发文时间:	2021-06-29	文件名称(含文号):	《关于印发《中国人保资产管理有限公司机构设置职能配置方案》的通知》(人保资产党发[2021]59号)
岗位设置:	一方投资经理岗		
3			
部门名称:	组合管理部		
发文时间:	2021-06-29	文件名称(含文号):	《关于印发《中国人保资产管理有限公司机构设置职能配置方案》的通知》(人保资产党发[2021]59号)
岗位设置:	一方组合经理岗		
4			
部门名称:	量化与衍生品投资部		
发文时间:	2021-06-29	文件名称(含文号):	《关于印发《中国人保资产管理有限公司机构设置职能配置方案》的通知》(人保资产党发[2021]59号)
岗位设置:	衍生品投资岗(国债期货方向)		
风险管理部			
1			
部门名称:	风险管理部/法律合规部		
发文时间:	2022-09-27	文件名称(含文号):	《关于公司组织架构与职能优化的通知》(人保资产党发[2022]609号)
岗位设置:	内控合规管理岗,绩效评估岗,金融风险岗		
清算核算部门			
1			
部门名称:	运营管理部		
发文时间:	2021-06-29	文件名称(含文号):	《关于印发《中国人保资产管理有限公司机构设置职能配置方案》的通知》(人保资产党发[2021]59号)
岗位设置:	核算管理岗,清算管理岗		
内部稽核部门			
1			
部门名称:	审计部		
发文时间:	2022-09-27	文件名称(含文号):	《关于公司组织架构与职能优化的通知》(人保资产党发[2022]609号)
岗位设置:	审计作业岗		
防火墙机制:	公司在不同部门之间设立防火墙体系,实行严格的业务分离制度,确保投资交易、风险管理、清算核算、内部稽核等部门独立运作。经评估,公司防火墙机制建设情况符合监管规定。		
评估结果:	符合规定		

四、专业队伍

整体评估情况： 公司配备了分析研究、投资交易、财务处理、风险控制、内部稽核等国债期货交易专业人员。公司国债期货交易专业管理人员中，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，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，资产配置和投资交易专业人员人数未在其他衍生品业务中重复计算。公司国债期货负责人员具有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。经评估，公司衍生品（国债期货）运用管理专业队伍建设情况符合监管规定。						
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	张忆湫	现券交易岗	否	期货或证券业务经验	已通过	14.43
2	李清	一方投资经理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	8.92
3	汪石磊	一方投资经理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	11.50
4	张洋洋	审计作业岗	否	其他	已通过	6.67
5	曹璐	一方组合经理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	17.85
6	樊飞	核算管理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	9.59
7	王博文	清算管理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	19.52
8	王博	衍生品投资岗（国债期货方向）	否	期货或证券业务经验	已通过	9.76
9	欧阳叶田	衍生品投资岗（国债期货方向）	否	期货或证券业务经验	已通过	5.00
10	李名玥	内控合规管理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	11.51
11	冯登赢	绩效评估岗	否	期货或证券业务经验	已通过	5.55
12	邓艾	金融风险岗	否	期货或证券业务经验	已通过	10.33

五、投资规则与基本制度

整体评估情况： 公司衍生品运用管理能力相关投资规则与基本制度建设符合规定，已按照规定制定了风险对冲方案并经公司风险管理部门及有关决策人员审批；与交易结算机构签署协议文件确定国债期货业务交易、保证金管理结算、风险控制及数据传输等事项，明确双方的权利和义务；建立健全衍生品交易业务操作制度、内部控制制度、风险管理制度和问责制度，相关制度文件已经管理层批准，以公司正式文件形式下发执行。		
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：中国人保资产管理有限公司国债期货套期保值实施细则， 发文文号：人保资产发[2022]193号， 发文时间：2022-03-24； 文件名称：中国人保资产管理有限公司国债期货投资管理办法， 发文文号：人保资产发[2022]193号， 发文时间：2022-03-24； 文件名称：统一配置型账户利用国债期货进行风险对冲的方案， 发文文号：无， 发文时间：2021-05-25；

内部控制制度	符合规定	文件名称：中国人保资产管理有限公司国债期货套期保值实施细则， 发文文号：人保资产发[2022]193号， 发文时间：2022-03-24； 文件名称：中国人保资产管理有限公司国债期货投资风险管理办法（试行）， 发文文号：人保资产发[2022]623号， 发文时间：2022-10-09； 文件名称：中国人保资产管理有限公司国债期货投资管理辦法， 发文文号：人保资产发[2022]193号， 发文时间：2022-03-24；
问责制度	符合规定	文件名称：中国人保资产管理有限公司投资业务经营管理责任制（试行）， 发文文号：人保资产发（2021）158号， 发文时间：2021-03-31； 文件名称：中国人保资产管理有限公司衍生品交易相关人员管理细则， 发文文号：人保资产发[2020]529号， 发文时间：2020-09-25； 文件名称：中国人保资产管理有限公司员工违规行为处罚实施细则， 发文文号：人保资产发（2021）156号， 发文时间：2021-03-31；
衍生品交易业务操作制度	符合规定	文件名称：中国人保资产管理有限公司国债期货套期保值实施细则， 发文文号：人保资产发[2022]193号， 发文时间：2022-03-24； 文件名称：中国人保资产管理有限公司国债期货投资管理辦法， 发文文号：人保资产发[2022]193号， 发文时间：2022-03-24； 文件名称：中国人保资产管理有限公司金融期货交易管理实施细则， 发文文号：人保资产交[2020]1号， 发文时间：2020-05-29；
与交易结算机构签署协议文件	符合规定	文件名称：人保资产-建设银行-中粮期货-期货投资托管操作三方备忘录， 发文文号：无， 发文时间：2020-06-10； 文件名称：中国人保资产管理有限公司-招商银行上海分行-广发期货有限公司总对总期货投资三方协议备忘录， 发文文号：无， 发文时间：2020-06-15；
风险管理制度	符合规定	文件名称：中国人保资产管理有限公司国债期货投资风险管理辦法（试行）， 发文文号：人保资产发[2022]623号， 发文时间：2022-10-09；

六、托管机制

整体评估情况：
公司已与中国建设银行股份有限公司、中粮期货有限公司、招商银行股份有限公司、广发期货有限公司等机构签署三方协议，协议规定了期货业务的资金划拨、清算、估值等事项，明确各方权利和义务。经评估，公司衍生品运用托管机制符合监管规定。

七、系统建设

整体评估情况：			
公司开展国债期货交易业务信息系统建设符合规定，投资交易、会计核算、风险管理等信息系统建设符合规定，相应的业务处理设备、交易软件和操作系统等，均通过可靠性测试。			
交易结算系统：			
系统名称	恒生投资交易系统国债期货交易模块和国债期货交割模块		
上线时间	2012-12-01	评估结果	符合规定

主要功能	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。期货交易管理系统稳定高效，能够满足交易需求。		
投资分析系统：			
系统名称	恒生投资交易系统国债期货套保模块		
上线时间	2012-12-01	评估结果	符合规定
主要功能	投资分析系统具备计算对冲资产组合风险所需的衍生品数量，并根据市场变化，调整衍生品规模，逐步实现担保品动态调整的功能。		
资产估值和核算系统：			
系统名称	赢时胜估值核算系统		
上线时间	2012-12-01	评估结果	符合规定
主要功能	国债期货估值与清算模块，会计确认、计量、账务处理及财务报告符合规定。系统稳定高效且能够满足估值需求。		
风险管理信息系统：			
系统名称	衡泰风险管理系统		
上线时间	2012-12-01	评估结果	符合规定
主要功能	风险管理信息系统能够实现期货交易的实时监控，各项风险管理指标固化在系统中，并能够及时预警。		
系统名称	恒生投资交易系统风险控制相关功能		
上线时间	2012-12-01	评估结果	符合规定
主要功能	风险管理信息系统能够实现期货交易的实时监控，各项风险管理指标固化在系统中，并能够及时预警。		

八、风险管理

整体评估情况：	
公司衍生品运用（国债期货）风险管理体系包括动态风险管理机制、风险预警机制、激励机制、监督检查机制、偏差回溯机制等内容。经评估，公司衍生品运用（国债期货）风险管理体系基本符合监管规定。	
动态风险管理机制评估：	公司建立动态风险管理机制，包括制定国债期货交易的全面风险管理制度与业务操作流程，建立实时监测、评估与处置风险的信息系统，完善应急机制和管理预案。
风险对冲有效性预警机制评估：	公司根据受托资产组合实际情况，动态监测相关风险控制指标，制定风险对冲有效性预警机制，及时根据市场变化对交易作出风险预警。
激励制度和机制评估：	公司制定了有效的激励制度和机制，不简单将国债期货交易盈亏与业务人员收入挂钩。后台及风险管理部门的人员报酬，独立于交易盈亏情况。
定期监督检查情况评估：	公司已设立审计部门，配备了审计稽核人员，由审计部向承担内部审计与稽核职能的集团审计中心提交审计稽核需求，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。检查至少包括业务合规情况、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：	公司已设立审计部门，配备了审计稽核人员，由审计部向承担内部审计与稽核职能的集团审计中心提交审计稽核需求，将每半年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。

