

英大保险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（首次披露—



20210208

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:	李燕芳	职务:	董事长
专业责任人:	刘开俊	职务:	总经理
类别:	高级管理人员		

二、基本条件

整体评估情况:	<p>公司培育形成了良好的公司治理文化，建立了良好的公司治理结构，“三会一层”职责清晰、分工明确、运行顺畅。董事会对股东大会负责，在自身职权范围内对公司重大事项进行决策，董事会下设四个专业委员会，协助董事会决策。监事会认真履行职责。公司管理层落实董事会决议、决策日常经营事项。经营层下设投资决策委员会、风险管理委员会等专业委员会，协助经营层进行经营管理。公司董事、监事、高级管理人员均具有期货或证券业务经验，且通过了期货从业资格考试。公司建立了完善、有效的股指期货交易管理制度体系，制定了健全的股指期货交易业务操作、内部控制和风险管理等相关制度，业务操作涵盖研究、决策、交易、清算、结算全过程，明确责任分工，确定关键岗位相互制约，重点环节双人复核。风险管理制度纳入公司总体风险管理架构，覆盖股指期货前、中、后台。公司在投资分析、资产估值和核算、风险管理、交易结算等方面进行了系统化建设，建立了投资交易、会计核算和风险管理等信息系统，相关系统均通过了可靠性测试。公司衍生品运用管理能力（股指期货）基本条件符合《关于优化保险机构投资管理能力监管有关事项的通知》（银保监发〔2020〕45号）等相关规定。</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:

发文时间:	2021-01-14	文件名称(含文号):	《英大保险资产管理有限公司关于财务部组织架构相关情况的通知》英大资产组织(2021)22号
岗位设置:	投资核算岗		
2			
部门名称:	运营管理部		
发文时间:	2021-01-14	文件名称(含文号):	《英大保险资产管理有限公司关于运营管理部组织架构相关情况的通知》英大资产组织(2021)18号
岗位设置:	清算岗		
内部稽核部门			
1			
部门名称:	党建工作部(审计部)		
发文时间:	2021-02-07	文件名称(含文号):	《英大保险资产管理有限公司关于调整党建工作部(审计部)组织架构相关情况的通知》英大资产组织(2021)52号
岗位设置:	稽核管理岗		

四、专业队伍

整体评估情况:						
公司衍生品运用管理能力(股指期货)专业队伍符合监管规定。公司为股指期货业务配备了分析研究、资产配置、投资交易、风险控制、清算核算(财务处理)、审计稽核等专业管理人员共15人,互不兼任,其中资产配置和投资交易专业人员7人,风险控制专业人员3人,清算和核算专业人员3人,分析研究1人,审计稽核人员1人。资产配置和投资交易、风险控制、清算和核算业务的专业人员均通过了期货从业人员资格考试,负责人员具有5年以上证券或期货业务经验,业务经理具有3年以上证券或期货业务经验。						
专业队伍人员基本信息:						
序号	姓名	岗位	是否兼职	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	刘尔宁	交易岗	是	期货或证券业务经验	已通过	13.20
2	万朝晖	交易岗	是	期货或证券业务经验	已通过	5.24
3	赵丹	部门负责人	是	期货或证券业务经验	已通过	8.27
4	徐婷	稽核管理岗	是	期货或证券业务经验	已通过	3.32
5	叶旭晨	部门负责人	是	期货或证券业务经验	已通过	11.78
6	罗义锋	股票投资岗	是	期货或证券业务经验	已通过	11.55
7	崔峰	衍生品投资岗	否	期货或证券业务经验	已通过	6.45
8	李荣柱	资产配置岗	是	期货或证券业务经验	已通过	4.59
9	张生	部门负责人	是	期货或证券业务经验	已通过	14.16
10	贾秀红	投资核算岗	是	期货或证券业务经验	已通过	8.56
11	付谋拼	投资核算岗	是	期货或证券业务经验	已通过	11.11
12	姜涛	清算岗	是	期货或证券业务经验	已通过	7.94
13	倪忠浩	部门负责人	是	期货或证券业务经验	已通过	7.93
14	房笑妮	风险管理岗	是	期货或证券业务经验	已通过	3.38
15	贺婷婷	风险管理岗	是	期货或证券业务经验	已通过	9.78

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（股指期货）相关规则与制度建设情况符合监管要求。公司建立了完善有效的衍生产品运用管理制度，根据《股指期货业务管理办法》（英大资产创新〔2021〕34号）、《英大资产创新〔2021〕32号》、《英大资产创新〔2021〕50号》、《英大资产运营〔2020〕40号》、《英大资产运营〔2020〕41号》、《英大资产运营〔2020〕41号》。业务操作制度涵盖研究、决策、交易、清算、核算等全过程，明确责任分工，确保业务流程序清晰，环节紧密衔接；内部控制制度明确了岗位职责、业务操作流程、风险对冲方案等方面，进行了全面梳理和评估，重点环节双人复核；风险对冲方案方面，部门为对冲风险敞口和支取限额等进行了专项研究，并经过了《英大资产创新〔2021〕36号》附件《股指期货套期保值方案》的审批；风险对冲比例、保证金管理等事项，均经过了《英大资产创新〔2021〕38号》附件《股指期货套期保值方案》的审批；风险对冲比例、保证金管理等事项，均经过了《英大资产创新〔2021〕38号》附件《股指期货套期保值方案》的审批；风险对冲比例、保证金管理等事项，均经过了《英大资产创新〔2021〕38号》附件《股指期货套期保值方案》的审批。

衍生品交易管理制度：

制度内容	评估结果	制度明细
风险管理制度	符合规定	文件名称：《英大保险资产管理有限公司股指期货风险管理规则（2021年2月修订）》， 发文字号：英大资产风险〔2021〕50号， 发文时间：2021-02-07；
风险对冲方案	符合规定	文件名称：《英大保险资产管理有限公司股指期货套期保值实施细则》， 发文字号：英大资产创新〔2021〕36号， 发文时间：2021-01-15；
问责制度	符合规定	文件名称：《英大保险资产管理有限公司衍生品交易问责管理规则》， 发文字号：英大资产风险〔2021〕38号， 发文时间：2021-01-19； 文件名称：《英大保险资产管理有限公司股指期货运用业务工作守则》， 发文字号：英大资产创新〔2021〕33号， 发文时间：2021-01-15；
衍生品交易业务操作制度	符合规定	文件名称：《英大保险资产管理有限公司股指期货交易应急预案》， 发文字号：英大资产创新〔2021〕32号， 发文时间：2021-01-15； 文件名称：《英大保险资产管理有限公司股指期货运用业务管理办法》， 发文字号：英大资产创新〔2021〕35号， 发文时间：2021-01-15； 文件名称：《英大保险资产管理有限公司投资资金划拨管理办法（2020年12月修订）》， 发文字号：英大资产运营〔2020〕40号， 发文时间：2020-12-31； 文件名称：《英大保险资产管理有限公司投资清算管理办法（2020年12月修订）》， 发文字号：英大资产运营〔2020〕41号， 发文时间：2020-12-31； 文件名称：《英大保险资产管理有限公司股指期货研究管理细则》， 发文字号：英大资产创新〔2021〕31号， 发文时间：2021-01-15；
内部控制制度	符合规定	文件名称：《英大保险资产管理有限公司股指期货运用业务内部控制管理办法》， 发文字号：英大资产创新〔2021〕34号， 发文时间：2021-01-15；
与交易结算机构签署协议文件	符合规定	文件名称：《英大保险资产管理有限公司股指期货投资托管运营备忘录》， 发文字号：无， 发文时间：2021-01-22；

六、托管机制

整体评估情况：
公司衍生品（股指期货）托管机制符合监管要求。公司已经与中国工商银行股份有限公司北京市分行和银河期货有限公司签署了《英大资管有限公司股指期货投资托管运营备忘录》，确定股指期货业务的资金划拨、清算、估值、交易相关费用、结算数据等事项，明确了各方的权利和义务。

七、系统建设

整体评估情况：			
公司股指期货交易的系统建设情况符合监管要求。公司建立了投资分析、交易系统、数据库和交易软件等，各系统均通过了可靠性测试。投资分析系统采用恒生投资交易系统V03.2-股指期货套保模块，支持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；资产估值和核算系统采用恒生资产估值与财务会计核算系统软件（企业版）V2.6，配备了股指期货估值与清算模块，实现会统核算系统软件V03.2-股指期货交易管理模块和实时风控模块，各项风险管理指标固化在系统中，能够实现股指期货交易的实时监控及预警；交易结算系统采用恒生交易管理、清算管理等，实现了与合作交易结算机构信息系统的对接，建立了相应的备份通道。系统运行稳定高效，能够满足交易结算需求。			
交易结算系统：			
系统名称	恒生投资交易系统软件V03.2-股指期货交易管理模块		
上线时间	2021-01-21	评估结果	符合规定
主要功能	支持股指期货交易清算结算管理、期货柜台对接、期货终端信息采集等功能。交易结算系统能够与合作的交易结算机构信息系统对接，并建立了相应的备份通道。系统稳定高效，能够满足交易结算需求。		
投资分析系统：			
系统名称	恒生投资交易系统软件V03.2-股指期货套保模块		
上线时间	2021-01-21	评估结果	符合规定
主要功能	系统支持股指期货套保业务相关的套保额度管理、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，支持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。		
资产估值和核算系统：			
系统名称	恒生资产估值与会计核算系统软件（企业版）V2.6		
上线时间	2021-01-21	评估结果	符合规定
主要功能	系统功能主要包括股指期货交易模块、保证金费率设置、交易费率设置、公共数据查询、日终清算、生成凭证、估值表、数据查询、余额表、数据查询等功能模块，支持股指期货业务的会计确认、计量、账务处理及财务报告，符合监管规定。其中公共数据查询模块处理行情数据，来源为期货和期权信息、中金所-股指期货和期权行情。日终清算模块处理清算数据，来源为中金所-股指期货和期权交易、中金所-股指期货和期权到期交割、中金所-股指期货和期权结算明细、中金所-客户分项资金明细表等。核算模块根据清算数据产生期货业务凭证（含股指期货调的日终盈亏凭证、期货交易凭证（开仓和平仓）、到期交割凭证、交易保证金调整凭证等），通过期货交易业务模块和估值凭证模块生成估值表、余额表，进行账务处理。系统运行稳定高效，能够满足估值需求。		
风险管理信息系统：			
系统名称	恒生投资交易系统软件V03.2-股指期货交易管理模块和实时风控模块		
上线时间	2021-01-21	评估结果	符合规定
主要功能	支持股指期货指令交易流程管理、可用头寸及风险控制、保证金管理、信息查询、基础数据管理等功能，能够实现股指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：

<p>公司已建立了股指期货业务的全面风险管理制度体系，符合监管要求。</p> <p>(一) 已建立了股指期货业务的全面风险管理制度体系和动态风险管理机制，制定了股指期货交易的全面风险管理预案。《英大保险资管有限公司股指期货交易应急预案》(英大资产创新〔2021〕34号)、《英大保险资管有限公司股指期货交易应急预案》(英大资产创新〔2021〕32号)等制度对此予以规定。</p> <p>(二) 根据市场变化对交易作出风险预警。《英大保险资管有限公司股指期货运用业务管理办法》(英大资产创新〔2021〕35号)、《英大保险资管有限公司股指期货风险管理规则(2021年2月修订)》(英大资产创新〔2021〕34号)对此予以规定。</p> <p>(三) 激励制度和机制。《英大保险资管有限公司股指期货运用业务内部控制管理办法》(英大资产创新〔2021〕34号)第二十七条规定公司应制定合理有效的激励制度和机制，不得简单将股指期货交易盈亏与业务人员收入挂钩，后台及风险管理人薪酬应当独立于交易盈亏情况。</p> <p>(四) 定期监督检查情况。《英大保险资管有限公司股指期货风险管理规则(2021年2月修订)》(英大资产风险〔2021〕50号)第二十条规定，风险管理部定期对股指期货交易的风险管理情况进行监督检查，独立提交半年和年度稽核审计报告。检查内容包括业务合规情况、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>(五) 回溯分析情况。保险机构应当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。《英大保险资管有限公司股指期货风险管理规则(2021年2月修订)》(英大资产风险〔2021〕50号)第二十四条规定，业务部门每半年回溯股指期货买入计划与实际执行的偏差，审计管理部门将结果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。</p>	<p>公司已建立了股指期货业务的全面风险管理制度体系和动态风险管理机制，制定了股指期货交易的全面风险管理预案。《英大保险资管有限公司股指期货交易应急预案》(英大资产创新〔2021〕34号)、《英大保险资管有限公司股指期货交易应急预案》(英大资产创新〔2021〕32号)等制度对此予以规定。</p> <p>(一) 已建立了股指期货业务的全面风险管理制度体系和动态风险管理机制，制定了股指期货交易的全面风险管理预案。《英大保险资管有限公司股指期货交易应急预案》(英大资产创新〔2021〕34号)、《英大保险资管有限公司股指期货交易应急预案》(英大资产创新〔2021〕32号)等制度对此予以规定。</p> <p>(二) 根据市场变化对交易作出风险预警。《英大保险资管有限公司股指期货运用业务管理办法》(英大资产创新〔2021〕35号)、《英大保险资管有限公司股指期货风险管理规则(2021年2月修订)》(英大资产创新〔2021〕34号)对此予以规定。</p> <p>(三) 激励制度和机制。《英大保险资管有限公司股指期货运用业务内部控制管理办法》(英大资产创新〔2021〕34号)第二十七条规定公司应制定合理有效的激励制度和机制，不得简单将股指期货交易盈亏与业务人员收入挂钩，后台及风险管理人薪酬应当独立于交易盈亏情况。</p> <p>(四) 定期监督检查情况。《英大保险资管有限公司股指期货风险管理规则(2021年2月修订)》(英大资产风险〔2021〕50号)第二十条规定，风险管理部定期对股指期货交易的风险管理情况进行监督检查，独立提交半年和年度稽核审计报告。检查内容包括业务合规情况、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>(五) 回溯分析情况。保险机构应当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。《英大保险资管有限公司股指期货风险管理规则(2021年2月修订)》(英大资产风险〔2021〕50号)第二十四条规定，业务部门每半年回溯股指期货买入计划与实际执行的偏差，审计管理部门将结果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。</p>
<p>动态风险管理机制评估：</p>	<p>公司已建立了股指期货业务的全面风险管理制度体系和动态风险管理机制，制定了股指期货交易的全面风险管理预案。《英大保险资管有限公司股指期货交易应急预案》(英大资产创新〔2021〕34号)、《英大保险资管有限公司股指期货交易应急预案》(英大资产创新〔2021〕32号)等制度对此予以规定。</p> <p>(一) 已建立了股指期货业务的全面风险管理制度体系和动态风险管理机制，制定了股指期货交易的全面风险管理预案。《英大保险资管有限公司股指期货交易应急预案》(英大资产创新〔2021〕34号)、《英大保险资管有限公司股指期货交易应急预案》(英大资产创新〔2021〕32号)等制度对此予以规定。</p> <p>(二) 根据市场变化对交易作出风险预警。《英大保险资管有限公司股指期货运用业务管理办法》(英大资产创新〔2021〕35号)、《英大保险资管有限公司股指期货风险管理规则(2021年2月修订)》(英大资产创新〔2021〕34号)对此予以规定。</p> <p>(三) 激励制度和机制。《英大保险资管有限公司股指期货运用业务内部控制管理办法》(英大资产创新〔2021〕34号)第二十七条规定公司应制定合理有效的激励制度和机制，不得简单将股指期货交易盈亏与业务人员收入挂钩，后台及风险管理人薪酬应当独立于交易盈亏情况。</p> <p>(四) 定期监督检查情况。《英大保险资管有限公司股指期货风险管理规则(2021年2月修订)》(英大资产风险〔2021〕50号)第二十条规定，风险管理部定期对股指期货交易的风险管理情况进行监督检查，独立提交半年和年度稽核审计报告。检查内容包括业务合规情况、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>(五) 回溯分析情况。保险机构应当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。《英大保险资管有限公司股指期货风险管理规则(2021年2月修订)》(英大资产风险〔2021〕50号)第二十四条规定，业务部门每半年回溯股指期货买入计划与实际执行的偏差，审计管理部门将结果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。</p>
<p>风险对冲有效性预警机制评估：</p>	<p>《英大保险资管有限公司股指期货运用业务管理办法》(英大资产创新〔2021〕35号)、《英大保险资管有限公司股指期货风险管理规则(2021年2月修订)》(英大资产风险〔2021〕50号)、《英大保险资管有限公司股指期货运用业务内部控制管理办法》(英大资产创新〔2021〕34号)规定公司根据市场变化对交易作出风险预警。具体为：《英大保险资管有限公司股指期货运用业务管理办法》(英大资产创新〔2021〕35号)第四十六条规定，风险管理部定期对股指期货交易的风险管理情况进行跟踪、监测、评估，当发现风险指标异常时，应当及时提示；确有风险对冲需求并需要灵活处置的，应严格履行内部审批程序。《英大保险资管有限公司股指期货风险管理规则(2021年2月修订)》(英大资产风险〔2021〕50号)第十四条规定，风险管理部应及时对对冲方案的避险有效性进行评估。评估股指期货价值时，应当采用市场公认或合理的估值方法。第十五条规定，各部门应根据资产组合的实际情况，动态监测相关风险控制指标，在风险对冲方案中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调整。业务部门应密切关注外部市场变化，审慎评估市场变化趋势，及时调整对冲方案，防范市场风险。第十八条规定，公司将风险限额分解为不同层级，由风险管理部控制执行。对违反风险限额等交易情况，风险管理部应及时报告；确有风险对冲需求并需要灵活处置的，应严格履行内部审批程序。第二十四条规定，业务部门每半年回溯股指期货买入计划与实际执行的偏差，审计管理部门将结果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。</p>
<p>激励制度和机制评估：</p>	<p>《英大保险资管有限公司股指期货运用业务内部控制管理办法》(英大资产创新〔2021〕34号)第二十七条规定公司应制定合理有效的激励制度和机制，不得简单将股指期货交易盈亏与业务人员收入挂钩，后台及风险管理人薪酬应当独立于交易盈亏情况。</p>
<p>定期监督检查情况评估：</p>	<p>《英大保险资管有限公司股指期货风险管理规则(2021年2月修订)》(英大资产风险〔2021〕50号)第二十三条规定，风险管理部定期对股指期货交易的风险管理情况进行监督检查，独立提交半年和年度稽核审计报告。检查内容包括业务合规情况、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>《英大保险资管有限公司股指期货风险管理规则(2021年2月修订)》(英大资产风险〔2021〕50号)第二十四条规定，业务部门每半年回溯股指期货买入计划与实际执行的偏差，审计管理部门将结果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。</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，我对保险资管机构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。我确认，应当至少在首次开展本投资管理业务前10日已完成并公开披露本投资管理能力建设及自评估情况。

