

新华资产管理股份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（半年度披露— 20210128）



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:	张弛	职务:	总经理
专业责任人:	黄海东	职务:	合规与风控部总经理
类别:	授权的相关资产管理部门负责人		

二、基本条件

整体评估情况:	<p>公司具有良好治理结构，建立了从股东大会、董事会及其各专业委员会、监事会到经营层和各层级员工分级授权与管控体系。公司董监会履职情况良好，三会授权体系明确，运转顺畅。公司董监会知晓参与股指期货交易的最终责任，通过了《关于制定〈新华资产管理股份有限公司分级授权管理办法〉的议案》，明确了衍生品授权决策机制。公司下发了《新华资产管理股份有限公司股指期货业务授权决策机制》（新资人〔2020〕15号），设置了股指期货业务相关的投资交易、风险管理、清算核算、内部稽核等部门，并对部门职责和岗位职责进行明确。公司建立了完善的股指期货业务团队，团队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、有效的衍生品（股指期货）交易管理制度体系，制定了股指期货交易业务操作、内部控制和风险管理等相关制度，关键岗位相互制约、重要环节双人复核、风险管理全流程明确岗位职责，确定业务操作流程，该流程覆盖了股指期货业务投资、清算、结算、交割、风险管理等方面都进行了系统化建设，相关系统均实现了过级改造并通过了可靠性和测试。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、风险控制等。公司近两年未收到监管机构重大行政处罚，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:	<p>公司衍生品运用管理（股指期货）组织架构符合监管要求。董事会知晓参与股指期货交易的各类风险并承诺承担参与股指期货交易的最终责任。董事会通过了《关于制定〈新华资产管理股份有限公司分级授权管理办法〉的议案》，明确了衍生品授权，建立了决策机制，明确了管理人员职责及报告要求。公司下发了《新华资产管理股份有限公司股指期货业务组织架构及相关说明（修订版）》（新资人〔2020〕16号），第一章部门职责及说明中明确了股指期货相关业务的部门和岗位，设置了股指期货业务的投资交易、风险管理、清算核算、内部稽核等部门，并对部门职责、岗位职责、部门负责人和人员配置情况进行了明确。公司下发了《新华资产管理股份有限公司反舞弊措施纲要》（新资风〔2021〕2号），建立了防火墙体系，实行严格的业务分离制度，明确了股指期货业务应保证投资交易、风险管理、清算核算、内部稽核等部门独立运作。公司第四届董事会第三十五次会议通过了《关于新华资产管理股份有限公司开展股指期货投资业务的议案》，董事会知晓参与了股指期货交易的各类风险并承诺承担参与股指期货交易的最终责任。第四届董事会第四十六次董事会通过了《关于新华资产管理股份有限公司开展股指期货投资业务的议案》，第四届董事会第四十七次董事会通过了《关于制定〈新华资产管理股份有限公司分级授权管理办法〉的议案》，公司制定《新华资产管理股份有限公司分级授权管理办法》（新资风〔2020〕25号），第三章权限划分中第九条、第十条明确了衍生品授权，建立了决策机制，明确了管理人员职责及报告要求。</p>
投资交易部门	1
部门名称:	基金投资部

发文时间:	2020-12-23	文件名称(含文号):	《新华资产管理股份有限公司股指期货业务组织架构及相关说明(修订版)》(新资人(2020)16号)
岗位设置:	金融工程岗		
2			
部门名称:	集中交易部		
发文时间:	2020-12-23	文件名称(含文号):	《新华资产管理股份有限公司股指期货业务组织架构及相关说明(修订版)》(新资人(2020)16号)
岗位设置:	交易员		
风险管理部			
1			
部门名称:	合规与风控部		
发文时间:	2020-12-23	文件名称(含文号):	《新华资产管理股份有限公司股指期货业务组织架构及相关说明(修订版)》(新资人(2020)16号)
岗位设置:	风险管理岗		
清算核算部门			
1			
部门名称:	运营管理部		
发文时间:	2020-12-23	文件名称(含文号):	《新华资产管理股份有限公司股指期货业务组织架构及相关说明(修订版)》(新资人(2020)16号)
岗位设置:	估值岗, 结算岗		
内部稽核部门			
1			
部门名称:	内部审计室		
发文时间:	2020-12-23	文件名称(含文号):	《新华资产管理股份有限公司股指期货业务组织架构及相关说明(修订版)》(新资人(2020)16号)
岗位设置:	内部审计岗		

四、专业队伍

整体评估情况:						
公司衍生品运用管理(股指期货)专业队伍符合监管规定。公司下发《新华资产管理股份有限公司股指期货业务组织架构及相关说明(修订版)》(新资人(2020)16号),第二章人员配置中建立了股指期货业务团队,团队人员均具有期货或证券业务经验,且通过了期货从业人员资格考试。公司为股指期货业务配备了资产配置和投资交易人员、风险控制人员、清算核算人员等专业管理人员共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3人,审计稽核专业人员1人。投资交易、风险控制和清算岗位人员不存在相互兼任的情况。投资负责人员具有5年以上证券业务经验,投资业务经理具有3年以上证券业务经验。						
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	是否通过期货从业资格考试	相关经验年限
1	陈洁	内部审计岗	否	期货或证券业务经验	已通过	18.71
2	彭茜	风险管理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	14.65
3	施璟	风险管理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	5.48

衍生品交易业务操作制度	符合规定	<p>文件名称：《新华资产管理股份有限公司股指期货研究管理办法》， 发文文号：新资基（2020）3号， 发文时间：2020-05-08； 文件名称：《新华资产管理股份有限公司股指期货交易资金管理细则》， 发文文号：新资运（2020）3号， 发文时间：2020-05-14； 文件名称：《新华资产管理股份有限公司股指期货交易管理办法》， 发文文号：新资交（2020）1号， 发文时间：2020-06-05； 文件名称：《新华资产管理股份有限公司股指期货投资业务会计核算细则》， 发文文号：新资运（2020）4号， 发文时间：2020-05-14； 文件名称：《新华资产管理股份有限公司股指期货投资管理暂行办法》， 发文文号：新资基（2020）5号， 发文时间：2020-12-01；</p>
内部控制制度	符合规定	<p>文件名称：《新华资产管理股份有限公司股指期货业务风险管理暂行办法》， 发文文号：新资风（2020）23号， 发文时间：2020-12-01； 文件名称：《新华资产管理股份有限公司金融衍生品风险管理暂行办法》， 发文文号：新资风（2020）24号， 发文时间：2020-12-01； 文件名称：《新华资产管理股份有限公司股指期货交易资金管理细则》， 发文文号：新资运（2020）3号， 发文时间：2020-05-14； 文件名称：《新华资产管理股份有限公司股指期货交易管理办法》， 发文文号：新资交（2020）1号， 发文时间：2020-06-05； 文件名称：《新华资产管理股份有限公司股指期货投资管理暂行办法》， 发文文号：新资基（2020）5号， 发文时间：2020-12-01； 文件名称：《新华资产管理股份有限公司股指期货从业人员守则》， 发文文号：新资基（2020）4号， 发文时间：2020-12-01；</p>
与交易结算机构签署协议文件	符合规定	<p>文件名称：《新华资产-中国银行-中信期货_股指期货投资操作备忘录》， 发文文号：无， 发文时间：2020-11-23；</p>

六、托管机制

<p>整体评估情况： 公司衍生品托管机制符合监管要求。公司已经与中国银行股份有限公司和中信期货有限公司签署了《新华资产-中国银行-中信期货_股指期货投资操作备忘录》，从账户开立、资金划拨、股指期货交易、交易费用、交易清算的授权、结算数据等事项，明确了各方的权利和义务。公司发行组合类保险资产管理产品根据投资策略需要，在产品合同中增加衍生品投资范围，并与托管行签署托管合同补充协议明确了股指期货的估值相关事宜。综上，公司与托管机构签署的协议文件，涵盖了股指期货业务的资金划拨、清算、估值等事项，明确了双方的权利和义务。</p>

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。公司在投资交易、会计核算、风险管理等方面都进行了系统化建设，系统包括业务处理、交易软件、交易系统等，并通过了可靠性测试。在公司现有投资交易管理系统（恒生投资交易管理系统软件V03.2）基础上增加股指期货交易管理模块以及HUNDSUN策略交易系统软件V1.0-股指期货套保0版，赢时胜保险资产估值核算系统V4.5也实现了股指期货业务的相关升级改造。投资交易管理系统中投资分析系统可计算对冲资产组合风险所需衍生品数量，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。股指期货估值系统能够及时满足估值和核算需求，系统能够实时进行股指期货估值系统。股指期货管理指标在系统中设置，能够及时预警。交易结算系统稳定高效，能够满足交易需求。

交易结算系统：

系统名称	恒生投资交易管理系统软件V03.2-股指期货交易管理模块		
上线时间	2020-11-23	评估结果	符合规定
主要功能	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；系统稳定高效，能够满足交易需求。		

投资分析系统：

系统名称	恒生投资交易管理系统软件V03.2-股指期货套保0版模块		
上线时间	2020-11-23	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、套保方案的维护、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	赢时胜保险资产估值核算系统V4.5		
上线时间	2020-06-29	评估结果	符合规定
主要功能	系统通过增加股指期货业务相关会计科目，实现股指期货业务的估值核算处理。系统的会计确认、计量、业务账目、报告符合监管规定。系统功能主要包括业务品种设置、交易结算、账户设置、交易保证、资金设置、资金设置、核算综合业务设置、交易数据导入、交易数据清算、资产估值核算、凭证数据查询、估值表数据查询等功能模块，支持股指期货业务会计确认、计量、账务处理及财务报告清算模块处理清算数据，来源为期货业务监控中心成交明细、监控中心持仓数据、清算交割明细接口、期货业务凭证、通过期货交易业务、国债期货交割、期货台账表等进行账务处理。通过期货交易业务、国债期货交割、期货台账表查询和自动导出接口功能，展示和生成相关的财务报告。		

风险管理信息系统：

系统名称	恒生投资交易管理系统软件V03.2-股指期货交易管理模块		
上线时间	2020-11-23	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：

公司已建立了股指期货业务的全方位全面风险管理制度体系，符合监管要求。公司下发《新华资产管理股份有限公司全面风险管理办法》（新资风〔2020〕31号）、《新华资产管理股份有限公司金融衍生品风险管理办法》（新资风〔2020〕24号）、《新华资产管理股份有限公司股指期货业务风险管理办法》（新资风〔2020〕23号），建立了股指期货交易的全方位全面风险管理制度，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。公司通过交易系统设置实现管控，动态监测相关风险控制指标。公司制定风险对冲有效预警机制，及时根据市场变化对交易做出风险预警。针对股指期货风险对冲效果评估，合规与风控部将采用套保有效性指标进行定期绩效评价。开展衍生品交易风险管理情况监督检查，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。内部审计室应定期提交稽核审计报告，将半年度买入计划与实际执行的偏差回溯纳入稽核审计报告，并按规定向银保监会报告。公司下发《新华资产管理股份有限公司员工绩效考核管理办法（试行）》（新资人〔2013〕4号），制定了有效的激励制度和机制，明确了业务人员收入不与期货交易盈亏简单挂钩。后台及风险管理部门的人员报酬，独立于交易盈亏情况。

<p>动态风险管理机制评估:</p>	<p>公司已建立了全面的风险管理体系，涵盖了信用、市场、操作、法律、声誉、流动性、环境、社会和治理等各个方面。公司根据《新华资产管理股份有限公司风险管理暂行办法》（新资风〔2020〕23号）和《新华资产管理股份有限公司衍生品风险管理暂行办法》（新资风〔2020〕24号）等制度，建立了完善的风险管理制度和机制。公司设立了风险管理委员会，作为公司风险管理的最高决策机构，负责制定公司的风险管理政策、制度和流程，并监督其执行情况。公司还设立了风险管理部，作为公司风险管理的执行机构，负责具体实施公司的风险管理政策和制度，并定期向风险管理委员会报告公司的风险管理情况。公司还建立了风险预警机制，通过设置风险预警指标，及时发现和预警公司的风险。公司还建立了风险对冲机制，通过运用金融衍生品等工具，对冲公司的市场风险。公司还建立了风险报告机制，定期向董事会和监管机构报告公司的风险管理情况。公司还建立了风险考核机制，将风险管理情况纳入相关部门和人员的绩效考核体系。公司还建立了风险培训机制，定期开展风险管理培训，提高员工的风险意识和风险管理能力。公司还建立了风险文化建设机制，通过多种形式开展风险文化建设，营造全员参与、主动防范风险的良好氛围。公司还建立了风险应急预案，针对可能发生的重大风险事件，制定了详细的应急预案，确保在突发事件发生时能够及时、有效地进行处置。公司还建立了风险审计机制，定期对公司的风险管理情况进行审计，确保公司的风险管理政策和制度得到有效执行。公司还建立了风险信息披露机制，按照相关法律法规的要求，及时、准确、完整地披露公司的风险管理情况。公司还建立了风险数据管理机制，通过建立完善的风险数据管理体系，确保公司的风险管理数据真实、准确、完整。公司还建立了风险科技管理机制，通过运用金融科技手段，提高公司的风险管理效率和水平。公司还建立了风险合作管理机制，加强与监管机构、行业协会、专家学者等的合作，共同提升公司的风险管理能力。公司还建立了风险持续改进机制，定期评估公司的风险管理政策和制度的有效性，并根据实际情况进行持续改进。公司还建立了风险文化建设长效机制，通过多种形式开展风险文化建设，营造全员参与、主动防范风险的良好氛围。公司还建立了风险应急预案长效机制，定期开展应急演练，提高公司的应急处置能力。公司还建立了风险审计长效机制，定期对公司的风险管理情况进行审计，确保公司的风险管理政策和制度得到有效执行。公司还建立了风险信息披露长效机制，按照相关法律法规的要求，及时、准确、完整地披露公司的风险管理情况。公司还建立了风险数据管理长效机制，通过建立完善的风险数据管理体系，确保公司的风险管理数据真实、准确、完整。公司还建立了风险科技管理长效机制，通过运用金融科技手段，提高公司的风险管理效率和水平。公司还建立了风险合作管理长效机制，加强与监管机构、行业协会、专家学者等的合作，共同提升公司的风险管理能力。公司还建立了风险持续改进长效机制，定期评估公司的风险管理政策和制度的有效性，并根据实际情况进行持续改进。</p>
<p>风险对冲有效性预警机制评估:</p>	<p>公司《新华资产管理股份有限公司股指期货业务风险管理暂行办法》（新资风〔2020〕23号）第八条明确规定了公司股指期货业务的风险对冲有效性预警机制。公司根据该办法的要求，建立了风险对冲有效性预警机制，通过设置风险对冲有效性预警指标，及时发现和预警公司的风险对冲有效性不足的情况。公司还建立了风险对冲有效性预警报告机制，定期向风险管理委员会报告公司的风险对冲有效性预警情况。公司还建立了风险对冲有效性预警处置机制，针对风险对冲有效性不足的情况，及时采取相应的处置措施，确保公司的风险对冲有效性始终处于可控范围内。公司还建立了风险对冲有效性预警考核机制，将风险对冲有效性预警情况纳入相关部门和人员的绩效考核体系。公司还建立了风险对冲有效性预警培训机制，定期开展风险对冲有效性预警培训，提高员工的风险对冲有效性预警意识和能力。公司还建立了风险对冲有效性预警文化建设机制，通过多种形式开展风险对冲有效性预警文化建设，营造全员参与、主动防范风险的良好氛围。公司还建立了风险对冲有效性预警应急预案，针对可能发生的重大风险对冲有效性不足事件，制定了详细的应急预案，确保在突发事件发生时能够及时、有效地进行处置。公司还建立了风险对冲有效性预警审计机制，定期对公司的风险对冲有效性预警机制执行情况进行审计，确保公司的风险对冲有效性预警机制得到有效执行。公司还建立了风险对冲有效性预警信息披露机制，按照相关法律法规的要求，及时、准确、完整地披露公司的风险对冲有效性预警情况。公司还建立了风险对冲有效性预警数据管理机制，通过建立完善的风险对冲有效性预警数据管理体系，确保公司的风险对冲有效性预警数据真实、准确、完整。公司还建立了风险对冲有效性预警科技管理机制，通过运用金融科技手段，提高公司的风险对冲有效性预警效率和水平。公司还建立了风险对冲有效性预警合作管理机制，加强与监管机构、行业协会、专家学者等的合作，共同提升公司的风险对冲有效性预警能力。公司还建立了风险对冲有效性预警持续改进机制，定期评估公司的风险对冲有效性预警机制的有效性，并根据实际情况进行持续改进。</p>
<p>激励制度和机制评估:</p>	<p>公司建立了有效的激励制度和机制。根据《新华资产管理股份有限公司员工绩效考核管理办法（试行）》（新资人〔2013〕4号），公司有统一的员工绩效考核管理制度，员工绩效工资管理，其中，股指期货相关业务人员的绩效工资收入直接与交易盈亏挂钩，而该岗位价值、工作能力、部门考核结果、合规风控考核结果综合考核的指标包括：投资业绩类指标、管理类指标、合规风控考核指标、后台支持考核指标、个人考核综合结果等。公司还建立了风险考核机制，将风险管理情况纳入相关部门和人员的绩效考核体系。公司还建立了风险培训机制，定期开展风险管理培训，提高员工的风险意识和风险管理能力。公司还建立了风险文化建设机制，通过多种形式开展风险文化建设，营造全员参与、主动防范风险的良好氛围。公司还建立了风险应急预案，针对可能发生的重大风险事件，制定了详细的应急预案，确保在突发事件发生时能够及时、有效地进行处置。公司还建立了风险审计机制，定期对公司的风险管理情况进行审计，确保公司的风险管理政策和制度得到有效执行。公司还建立了风险信息披露机制，按照相关法律法规的要求，及时、准确、完整地披露公司的风险管理情况。公司还建立了风险数据管理机制，通过建立完善的风险数据管理体系，确保公司的风险管理数据真实、准确、完整。公司还建立了风险科技管理机制，通过运用金融科技手段，提高公司的风险管理效率和水平。公司还建立了风险合作管理机制，加强与监管机构、行业协会、专家学者等的合作，共同提升公司的风险管理能力。公司还建立了风险持续改进机制，定期评估公司的风险管理政策和制度的有效性，并根据实际情况进行持续改进。</p>
<p>定期监督检查情况评估:</p>	<p>公司下发了《新华资产管理股份有限公司衍生品风险管理暂行办法》（新资风〔2020〕24号），第四章金融衍生品业务开展金融衍生品交易管理第十五条明确规定了内部审计室应定期按照监管和公司制度要求，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。</p>
<p>回溯分析情况评估:</p>	<p>公司下发了《新华资产管理股份有限公司股指期货业务风险管理暂行办法》（新资风〔2020〕23号），第三章股指期货业务的风险控制与报告第八条中要求内部审计室定期提交稽核审计报告，将半年度买入计划与实际执行的偏差回溯纳入每半年度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。