

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— 20210729）



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:	执行董事、总经理、审计负责人
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	1965-03
行政责任人学历	博士研究生	行政责任人学位	博士
行政责任人所在部门	执行董事、总经理、审计负责人	行政责任人入司时间	2011-03-01
行政责任人专业资质	无	行政责任人专业技术职务	无
专业责任人:	王勇	职务:	基金投资部总经理
专业责任人类别:	授权的相关资产管理部门负责人	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	1976-04
专业责任人学历	博士研究生	专业责任人学位	博士
专业责任人入司时间	2008-11-26	专业责任人所在部门	基金投资部
专业责任人专业资质	无	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，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的分级授权与管控体系。公司董事会、监事会、经理层及参与股指期货交易的各项授权、体系明确，运转顺畅。公司董事、监事、高级管理人员均具备良好的诚信记录，无不良记录，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《新华资产管理股份有限公司2021年度组织架构设置方案》（新资人（2021）6号），设立了包括基金投资部、集中交易部、合规与风控部、运营管理部、内部审计室等股指期货业务相关的投资、交易、风险管理、清算核算、内部稽核部门并明确部门职责。公司下发《新华资产管理股份有限公司各项投资管理岗位设置及人员配置方案》（新资人（2021）22号），对股指期货业务部门负责人、岗位职责及人员配置情况进行明确。公司建立了股指期货投资团队，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、内部控制制度和风险管理等制度，业务操作相互制约，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。公司明确了岗位职责，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。公司建立了股指期货业务操作流程，该流程覆盖了股指期货业务投资研究、投资决策、交易执行、风险控制以及清算结算等全过程。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，相关系统均实现了股指期货业务的升级改造并通过了可靠性测试。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、风险控制和审计稽核。</p> <p>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:	
---------	--

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《新华资产管理股份有限公司2021年度公司组织架构设置方案》（新资人〔2021〕6号），设立了包括基金投资部、集中交易部、合规与风控部、运营管理部 and 内部审计室等股指期货业务相关的投资交易、风险管理、清算核算、内审稽核部门并明确部门职责。公司下发《新华资产管理股份有限公司各项投资管理岗位设置及人员配置方案》（新资人〔2021〕22号），建立股指期货投资团队，对股指期货业务的部门负责人、岗位职责及人员配置情况进一步明确。公司下发《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、内审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《关于授权公司总裁办公会审议和批准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。

投资交易部门

1			
部门名称:	基金投资部		
发文时间:	2021-06-29	文件名称(含文号):	《新华资产管理股份有限公司2021年度公司组织架构设置方案》(新资人〔2021〕20号)
岗位设置:	部门负责人,金融工程岗		

2			
部门名称:	集中交易部		
发文时间:	2021-06-29	文件名称(含文号):	《新华资产管理股份有限公司2021年度公司组织架构设置方案》(新资人〔2021〕20号)
岗位设置:	交易员		

风险管理部门

1			
部门名称:	合规与风控部		
发文时间:	2021-06-29	文件名称(含文号):	《新华资产管理股份有限公司2021年度公司组织架构设置方案》(新资人〔2021〕20号)
岗位设置:	风险控制岗		

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):	《新华资产管理股份有限公司2021年度公司组织架构设置方案》(新资人〔2021〕20号)
岗位设置:	核算岗,清算岗		

内部稽核部门

1			
部门名称:	内部审计室		
发文时间:	2021-06-29	文件名称(含文号):	《新华资产管理股份有限公司2021年度公司组织架构设置方案》(新资人〔2021〕20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能力（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专业队伍符合监管规定》（新资人（2021）22号），建立股指期货投资团队，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，公司基金管理部下设金融工程岗，负责股指期货的投资与分析研究工作。公司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	曹凯	内部审计岗	是	期货或证券业务经验	已通过	9.89
2	夏路	风险管理岗	是	期货或证券业务经验	已通过	13.84
3	彭茜	风险管理岗	是	期货或证券业务经验	已通过	15.14
4	施璟	风险管理岗	是	期货或证券业务经验	已通过	5.97
5	王勇	部门负责人	是	期货或证券业务经验	已通过	18.89
6	闫奕歆	金融工程岗	是	期货或证券业务经验	已通过	10.97
7	刘丹迪	金融工程岗	是	期货或证券业务经验	已通过	4.54
8	张娟	核算岗	是	期货或证券业务经验	已通过	10.06
9	马建波	核算岗	是	期货或证券业务经验	已通过	11.13
10	王靳	清算岗	是	期货或证券业务经验	已通过	8.19
11	丁文曦	交易员	是	期货或证券业务经验	已通过	12.06
12	杨杉	交易员	是	期货或证券业务经验	已通过	13.97

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、有效的衍生品（股指期货）交易管理制度，各项制度均经过公司董事会或经营管理层审议批准，以公司正式文件形式下发执行。公司根据实际情况制定了《新华资产多因子股票精选资产管理产品-风险对冲方案》，明确了对冲目标、对冲工具、对冲对象及规模、对冲期限、对冲比例、保证金管理、风险敞口限额及交易限制，并经过公司证券投资决策委员会审批，合规与风控部出具意见。公司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》，确定股指期货业务的业务交易、保证金管理、结算、数据等项，明确了各方的权利和义务。公司制定了股指期货交易业务操作相关制度，制度包含《新华资产管理股份有限公司股指期货研究管理办法》（新资基（2020）3号）、《新华资产管理股份有限公司股指期货投资管理办法》（新资基（2020）5号）、《新华资产管理股份有限公司股指期货交易管理办法》（新资交（2020）1号）、《新华资产管理股份有限公司股指期货交易资金管理细则》（新资运（2020）3号）、《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》（新资运（2020）4号），涵盖研究、决策、交易、清算、结算全过程，明确责任分工，确保业务流程清晰，环节紧密衔接。公司制定了内部控制相关制度，明确了岗位职责，确保业务操作和风险管理流程可执行。其中《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）第二章金融衍生品业务风险管理职责分工第六条明确了关键岗位相互制约，重点环节双人复核。公司制定了风险管理相关制度，制度包含《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）等，将股指期货交易纳入公司总体风险管理架构，能够覆盖股指期货交易前、中、后台，公司各项业务开展均需遵循该制度规范。公司下发了《新华资产管理股份有限公司股指期货从业人员守则》（新资基（2020）4号）、《新华资产管理公司问责管理办法（暂行）》（新资风（2010）3号）等问责相关制度，明确了股指期货交易主管人员和专业人员的工作守则。

衍生品交易管理制度：

制度内容	评估结果	制度明细
------	------	------

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金融衍生品风险管理办法》， 发文文号：新资风（2020）24号， 发文时间：2020-12-03； 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从业人员守则》， 发文文号：新资基（2020）4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业务风险管理办法》， 发文文号：新资风（2020）23号， 发文时间：2020-12-03； 文件名称：《新华资产管理股份有限公司股指期货投资管理办法》， 发文文号：新资基（2020）5号， 发文时间：2020-12-01；</p>
问责制度	符合规定	<p>文件名称：《新华资产管理公司问责管理办法（暂行）》， 发文文号：新资风（2010）3号， 发文时间：2010-05-28； 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>
风险管理制度	符合规定	<p>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办法》， 发文文号：新资风（2020）24号， 发文时间：2020-12-03； 文件名称：《新华资产管理股份有限公司全面风险管理办法》， 发文文号：新资风（2020）31号， 发文时间：2020-12-25； 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办法》， 发文文号：新资风（2020）23号， 发文时间：2020-12-03；</p>
风险对冲方案	符合规定	<p>文件名称：《新华资产多因子股票精选资产管理产品-风险对冲方案》， 发文文号：2021-1号， 发文时间：2021-01-20；</p>
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投资管理办法》， 发文文号：新资基（2020）5号， 发文时间：2020-12-01；</p>

六、托管机制

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的投资范围，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。

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，系统包括业务处理设备、交易软件和交易系统，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的会计确认、计量、账户处理及财务报告符合监管要求实时监控，各项风险管理指标设置在系统中，能够及时预警。交易结算系统能够和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。股指期货交易管理系统稳定高效，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、账户处理及财务报告符合监管规定。系统功能主要包括业务品种设置、交易结算账户设置、交易保证金设置、资金汇划设置、核算综合数据查询等功能模块，支持股指期货业务的会计确认、计量、账户处理及财务报告数据查询等模块，支持股指期货业务的会计确认、计量、账户处理及财务报告数据查询等模块。清算模块处理清算数据，来源为监控中心成交明细、监控中心持仓数据、监控中心交割明细接口、期货监控中心客户资金数据、监控中心申报费等。核算模块根据清算数据产生期货业务凭证，通过期货交易业务和证券库估值。制作估值表、余额表，进行账务处理。通过期货交易业务、国债期货交割、期货台账表等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:

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。