

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	是否通过期货从业人员资格考试	相关经验年限
1	闫奕歆	金融工程岗	否	期货或证券业务经验	已通过	10.48
2	刘丹迪	金融工程岗	否	期货或证券业务经验	已通过	4.05
3	杨杉	交易员	否	期货或证券业务经验	已通过	13.48

4	郝黎红	交易员	否	期货或证券业务经验	已通过	8.65
5	丁文曦	交易员	否	期货或证券业务经验	已通过	11.57
6	施璟	风险管理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	5.48
7	彭茜	风险管理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	14.65
8	夏路	风险管理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	13.35
9	马建波	估值岗	否	期货或证券业务经验	已通过	10.64
10	王靳	结算岗	否	期货或证券业务经验	已通过	7.70
11	张娟	估值岗	否	期货或证券业务经验	已通过	9.57
12	陈洁	内部审计岗	否	期货或证券业务经验	已通过	18.71

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。公司根据实际情况制定了《分红账户风险对冲方案》，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、保证金管理措施及风险敞口限额，并经过公司合规与风险控制部和证券投资决策委员会审批。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、风险控制及数据传输等事项，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〕5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〕3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。公司制定了内部控制相关制度，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风险管理办法》（新资风〔2016〕2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，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。各项制度均经过公司经营管理层审议批准，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
风险管理制度	符合规定	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：2020-12-01； 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：2020-12-01； 文件名称：《新华资产管理股份有限公司风险管理办法》， 发文文号：新资风〔2016〕2号， 发文时间：2016-04-05；
风险对冲方案	符合规定	文件名称：《分红账户风险对冲方案》， 发文文号：2020-550号， 发文时间：2020-11-23；
问责制度	符合规定	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；

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；</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

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。公司发行组合类保险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。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，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。相关系统均通过了可靠性测试。

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。系统功能主要包括综合业务品种设置、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，支持股指期货业务的会计确认、计量、账务处理及财务报告控制。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、监控中心申报费数据、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：
<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。公司建立了股指期货业务的动态风险管理机制，制定了股指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，完善了应急机制和管理预案。公司下发《新华资产管理股份有限公司风险管理办法》（新资风〔2016〕2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性预警机制，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。</p> <p>公司内部审计室按照监管和公司制度要求定期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。后台及风险管理部的人员报酬，独立于交易盈亏情况。</p>

