

关于合众资产管理股份有限公司 衍生品运用管理能力（股指期货）建设及自评估情况 的信息披露公告——年度披露

根据原中国银行保险监督管理委员会《关于优化保险机构投资管理能力监管有关事项的通知》及《保险机构衍生品运用管理能力标准（股指期货）》，合众资产管理股份有限公司（以下简称“公司”）开展了衍生品（股指期货）运用管理能力自评估相关工作。经公司自评估，公司衍生品（股指期货）运用管理能力建设达到《关于优化保险机构投资管理能力监管有关事项的通知》及《保险机构衍生品运用管理能力标准（股指期货）》要求。

公司已在中国保险资产管理业协会系统填报衍生品（股指期货）运用管理能力建设及自评估情况，并生成年度披露报告（对外披露版），现根据《关于优化保险机构投资管理能力监管有关事项的通知》规定予以披露。

附件：合众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（年度披露-20240124）

合众资产管理股份有限公司

2024 年 1 月 26 日

合众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（年度披露-
20240124）

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：	徐永伟	职务：	临时负责人
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	女	行政责任人出生年月	1969-09
行政责任人学历	硕士研究生	行政责任人学位	硕士
行政责任人所在部门	总经理室	行政责任人入司时间	2023-11-06
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：	袁国勇	职务：	金融工程部副总经理(主持部门工作)
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	1978-07
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	2012-08-30	专业责任人所在部门	金融工程部
专业责任人专业资质	注册金融分析师、金融风险管理师	专业责任人专业技术职务	无

二、基本条件

整体评估情况：	
在公司治理方面，公司已建立股东大会、董事会、监事会和经营管理层之间各施其责、规范运作、相互制衡的公司治理结构，公司具有良好的公司治理结构，董事会根据公司管理情况，建立了授权制度和决策机制，公司董事会、监事会和经营管理层任职履职情况良好，授权体系明确，运转顺畅，公司近两年未受到监管机构重大行政处罚。 在股指期货交易业务操作方面，公司设置了金融工程部、组合管理部、集中交易部、风险管理部、稽核监察部、法律合规部和运营保障部等股指期货相关业务部门，涉及资产配置、投资交易、风险管理、清算核算、内部稽核等职能。股指期货业务的各相关部门和岗位职责遵循权责分明、相互独立、相互制衡和有效监督、原则设立，股指期货投资决策、交易执行、资金清算、会计估值和核算、风险管理和内部稽核等部门和岗位之间实行严格分离，前、中、后台岗位严格分离，关键岗位相互制衡，重点环节双人复核。股指期货业务团队中资产配置、投资交易、风险管理和清算核算等业务人员均通过了期货从业资格考试，部门负责人和业务经理符合从业年限要求。 在股指期货业务操作制度方面，公司制定了《合众资产管理股份有限公司股指期货投资管理办法》、《合众资产管理股份有限公司股指期货业务实施细则》、《合众资产管理股份有限公司股指期货保证金管理办法》、《合众资产管理股份有限公司股指期货投资清算及期货保证金划拨管理办法》等股指期货业务操作制度，制度明确了股指期货业务涉及的资产配置、投资、研究、交易、清算与结算等各环节的操作流程，覆盖股指期货交易的前、中、后台，各环节分工明确、权责清晰、紧密衔接。 在内部控制制度方面，公司制定了《合众资产管理股份有限公司股指期货投资内部控制管理办法》，明确了股指期货交易前、中、后台的岗位职责，确保各业务操作和风险管理流程可执行、关键岗位相互制衡、重点环节双人复核等。 在风险管理制度方面，公司制定了《合众资产管理股份有限公司股指期货投资风险管理办法》、《合众资产管理股份有限公司股指期货业务风险控制实施细则》和《合众资产管理股份有限公司股指期货投资业务内部稽核办法》等风险管理制度，建立了事前、事中和事后风控监控机制，明确了风险监测指标和风险预警机制，并将股指期货交易风险控制纳入公司总体风险管理架构，覆盖股指期货交易前、中、后台等。 在系统建设方面，公司采购了市场成熟的恒生投资交易系统（含股指期货模块）、恒生资产估值与会计核算系统（含股指期货估值和核算模块）和恒生投资绩效评估与风险管理系统（含股指期货模块），实现了股指期货期现匹配（套期保值）、期货展期（合约到期管理）、期货保证金管理、期货交易风险管理（事前和事中风控）、交易结算、估值核算、绩效评估和事后风控等股指期货套期保值业务全流程管理功能。 综上所述，公司在基本条件方面符合衍生品运用管理能力（股指期货）能力标准的基本要求。	
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：

公司已建立股东大会、董事会、监事会和经营管理层之间各施其责、规范运作、相互制衡的公司治理结构，符合监管规定。

公司董事知晓股指期货相关风险并承担参与股指期货交易的最终责任，董事会根据公司管理情况，制定了《合众资产管理股份有限公司投资授权管理办法》，建立了授权制度和决策机制，明确管理人员职责和报告要求。

公司正式下发了《合众资产管理股份有限公司关于调整衍生品运用管理能力组织架构相关事宜的通知》，发文中明确了各部门职责、岗位职责、部门负责人及人员配置等。股指期货业务相关部门和岗位，主要包括金融工程部、组合管理部、权益投资部、研究部、集中交易部、风险管理部、稽核监察部、法律合规部和运营保障部等，涉及资产配置、投资交易、风险管理、清算核算、内部稽核等职能。股指期货业务的各相关部门和岗位职责遵循权责分明、相互独立、相互制衡和有效监督原则设立，股指期货投资决策、交易执行、资金清算、会计估值和核算、风险管理和内部稽核等部门和岗位之间实行严格分离，前、中、后台岗位严格分离，关键岗位相互制衡，重点环节双人复核。不同部门之间设有防火墙机制，并参照公司制定的《防范利益冲突与防火墙机制管理办法》执行。综上所述，公司在组织架构设置方面符合股指期货能力标准的基本要求。

投资交易部门

1

部门名称：	权益投资部		
发文时间：	2021-09-16	文件名称（含文号）：	《合众资产管理股份有限公司关于调整衍生品运用管理能力组织架构相关事宜的通知》（合众资产工作通知〔2021〕38号）
岗位设置：	投资岗		

2

部门名称：	研究部		
发文时间：	2021-09-16	文件名称（含文号）：	《合众资产管理股份有限公司关于调整衍生品运用管理能力组织架构相关事宜的通知》（合众资产工作通知〔2021〕38号）
岗位设置：	研究岗		

3

部门名称：	组合管理部		
发文时间：	2021-09-16	文件名称（含文号）：	《合众资产管理股份有限公司关于调整衍生品运用管理能力组织架构相关事宜的通知》（合众资产工作通知〔2021〕38号）
岗位设置：	资产配置岗		

4

部门名称：	金融工程部		
发文时间：	2021-09-16	文件名称（含文号）：	《合众资产管理股份有限公司关于调整衍生品运用管理能力组织架构相关事宜的通知》（合众资产工作通知〔2021〕38号）
岗位设置：	投资岗,研究岗		

5

部门名称：	集中交易部		
发文时间：	2021-09-16	文件名称（含文号）：	《合众资产管理股份有限公司关于调整衍生品运用管理能力组织架构相关事宜的通知》（合众资产工作通知〔2021〕38号）
岗位设置：	交易岗		

风险管理部门

1			
部门名称：	法律合规部		
发文时间：	2021-09-16	文件名称（含文号）：	《合众资产管理股份有限公司关于调整衍生品运用管理能力组织架构相关事宜的通知》（合众资产工作通知〔2021〕38号）
岗位设置：			
2			
部门名称：	风险管理部		
发文时间：	2021-09-16	文件名称（含文号）：	《合众资产管理股份有限公司关于调整衍生品运用管理能力组织架构相关事宜的通知》（合众资产工作通知〔2021〕38号）
岗位设置：	风险管理岗		
清算核算部门			
1			
部门名称：	运营保障部		
发文时间：	2021-09-16	文件名称（含文号）：	《合众资产管理股份有限公司关于调整衍生品运用管理能力组织架构相关事宜的通知》（合众资产工作通知〔2021〕38号）
岗位设置：	核算岗,清算岗		
内部稽核部门			
1			
部门名称：	稽核监察部		
发文时间：	2021-09-16	文件名称（含文号）：	《合众资产管理股份有限公司关于调整衍生品运用管理能力组织架构相关事宜的通知》（合众资产工作通知〔2021〕38号）
岗位设置：	稽核监察岗		
防火墙机制：	公司从事股指期货投资业务的各相关部门和岗位职责遵循权责分明、相互独立、相互制衡和有效监督原则设立，股指期货投资决策、交易执行、资金清算、会计估值和核算、风险管理和内部稽核等部门和岗位之间严格分离，实行前、中、后台岗位严格分离，关键岗位相互制衡，重点环节双人复核等。不同部门之间设有防火墙机制，并参照公司制定的《防范利益冲突与防火墙机制管理办法》执行。		
评估结果：	符合规定		

四、专业队伍

整体评估情况：						
公司衍生品运用管理（股指期货）专业队伍符合股指期货能力标准的基本要求。公司建立了包括风险责任人和专业业务人员的股指期货业务团队，专业业务人员均通过了期货从业资格考试且符合从业经验要求。公司为股指期货业务配备了资产配置和投资交易人员、分析研究人员、风险控制人员、清算核算人员、审计稽核人员等专业管理人员共13人，其中资产配置和投资交易专业人员6人，风险控制专业人员3人，分析研究人员1人，清算和核算专业人员2人，审计稽核专业人员1人。部门负责人具有5年以上期货和证券业务经验，业务经理具有3年以上期货和证券业务经验。投资交易、风险控制和清算岗位人员不存在相互兼任情况；公司未参与除股指期货外的其他衍生品交易。						
专业队伍人员基本信息：						
序号	姓名	岗位	是否为能力标准要求的专职人员	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	杜若辰	投资岗	否	期货或证券业务经验	未通过	9.53
2	谭宇欣	稽核监察岗	否	其他	已通过	7.47
3	陈莉	配置岗	否	期货或证券业务经验	已通过	4.50

4	刘怡惟	核算岗	否	期货或证券业务经验	已通过	12.22
5	李君	清算岗	否	其他	已通过	11.51
6	邛明阳	投资岗	否	期货或证券业务经验	已通过	3.86
7	李莘泰	投资岗	否	期货或证券业务经验	已通过	7.32
8	袁国勇	投资岗	否	期货或证券业务经验	已通过	16.26
9	贾慧捷	交易岗	否	期货或证券业务经验	已通过	7.44
10	刘晨宇	交易岗	否	期货或证券业务经验	已通过	12.14
11	贾尚达	风险管理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	6.06
12	黄涵华	风险管理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	1.97
13	宋皓宇	风险管理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	10.47

五、投资规则与基本制度

整体评估情况：		
在股指期货交易业务操作制度方面，公司制定了《合众资产管理股份有限公司股指期货投资管理办法》、《合众资产管理股份有限公司股指期货业务实施细则》、《合众资产管理股份有限公司股指期货保证金管理办法》、《合众资产管理股份有限公司股指期货清算及期货保证金划拨管理办法》等股指期货业务操作制度，制度明确了股指期货业务涉及的资产配置、投资、研究、决策、交易、清算与结算等各环节的操作流程，覆盖股指期货交易的前、中、后台，各环节分工明确、权责清晰、紧密衔接。 在内部控制制度方面，公司制定了《合众资产管理股份有限公司股指期货投资内部控制管理办法》，明确了股指期货交易前、中、后台的岗位职责，确保各业务操作和风险管理流程可执行、关键岗位相互制衡、重点环节双人复核等；公司制定了《合众资产管理股份有限公司内部审计制度》，制度规定“年度内部审计计划应涵盖监管规定的审计内容”，从事后对公司股指期货交易进行监督。 在风险管理制度方面，公司制定了《合众资产管理股份有限公司股指期货投资风险管理办法》、《合众资产管理股份有限公司股指期货业务风险控制实施细则》和《合众资产管理股份有限公司股指期货投资业务内部稽核办法》等股指期货交易风险控制纳入公司总体风险和管理架构，覆盖股指期货交易前、中、后台等。 在问责制度方面，公司制定了《合众资产管理股份有限公司金融衍生品投资业务专业人员工作守则》、《合众资产管理股份有限公司重大责任追究制度》和《合众资产管理股份有限公司违规处罚管理办法》，制度规范了期货交易主管人员和专业人员的工作守则和问责管理办法，明确了公司员工违规行为的处罚规定。股指期货交易业务操作制度、内部控制制度、风险管理制度和问责制度等股指期货相关业务制度均通过公司经营管理层董事会审议批准，并以公司正式文件形式下发执行。 在与交易结算机构签署协议文件方面，公司与中国工商银行股份有限公司和新湖期货股份有限公司签署了《合众资产管理股份有限公司股指期货投资托管营运备忘录(传统账户)》、《合众资产管理股份有限公司股指期货投资托管营运备忘录(分红和万能账户)》，与中国邮政储蓄银行股份有限公司和中信期货有限公司签署了《合众资产-邮政储蓄银行-中信期货-期货三方操作备忘录》，备忘录详细规定了股指期货业务交易、保证金管理结算、风险控制及数据传输等事项中我司、托管机构、期货经纪公司各自的权利和义务。 在风险对冲方案方面，公司按照规定制定了风险对冲的框架性议案《股指期货投资议案》，明确了参与股指期货交易的投资目的和策略、投资目标、投资范围、投资规模和投资期限、风险敞口和风险限额、保证金风险控制、考核标准等，议案经过了风险管理部、投委会审批。 综上所述，公司在股指期货相关的投资规则和基本制度建设符合股指期货能力标准的基本要求。		
衍生品交易管理制度：		
制度内容	评估结果	制度明细
衍生品交易业务操作制度	符合规定	文件名称：合众资产管理股份有限公司股指期货投资管理办法， 发文文号：合众资产发〔2018〕185号， 发文时间：2018-09-05； 文件名称：合众资产管理股份有限公司股指期货交易流程书， 发文文号：合众资产发〔2018〕185号， 发文时间：2018-09-05； 文件名称：合众资产管理股份有限公司股指期货保证金管理办法， 发文文号：合众资产发〔2018〕185号， 发文时间：2018-09-05； 文件名称：合众资产管理股份有限公司股指期货业务实施细则， 发文文号：合众资产发〔2018〕185号， 发文时间：2018-09-05； 文件名称：合众资产管理股份有限公司股指期货投资清算及期货保证金划拨管理办法， 发文文号：合众资产发〔2018〕214号， 发文时间：2018-09-26；

风险对冲方案	符合规定	文件名称：股指期货投资议案， 发文文号：无， 发文时间：2013-09-03；
问责制度	符合规定	文件名称：合众资产管理股份有限公司重大责任追究制度， 发文文号：合众资产发（2012）6号， 发文时间：2012-05-18； 文件名称：合众资产管理股份有限公司违规处罚管理办法， 发文文号：合众资产发（2021）11号， 发文时间：2021-01-08； 文件名称：合众资产管理股份有限公司金融衍生品投资交易业务专业人员工作守则， 发文文号：合众资产发（2021）35号， 发文时间：2021-01-21；
与交易结算机构签署协议文件	符合规定	文件名称：合众资产管理股份有限公司股指期货投资托管运营备忘录（分红和万能账户）， 发文文号：无， 发文时间：2013-04-15； 文件名称：合众资产-邮政储蓄银行-中信期货-期货三方操作备忘录， 发文文号：无， 发文时间：2020-07-13； 文件名称：合众资产管理股份有限公司股指期货投资托管运营备忘录（传统账户）， 发文文号：无， 发文时间：2019-12-27；
内部控制制度	符合规定	文件名称：合众资产管理股份有限公司内部审计制度， 发文文号：合众资产发（2021）7号， 发文时间：2021-01-05； 文件名称：合众资产管理股份有限公司股指期货投资内部控制管理办法， 发文文号：合众资产发（2018）223号， 发文时间：2018-09-30；
风险管理制度	符合规定	文件名称：合众资产管理股份有限公司股指期货业务风险控制实施细则， 发文文号：合众资产发（2020）240号， 发文时间：2020-12-01； 文件名称：合众资产管理股份有限公司股指期货投资业务内部稽核办法， 发文文号：合众资产发（2013）24号， 发文时间：2013-04-17； 文件名称：合众资产管理股份有限公司股指期货投资风险管理办法， 发文文号：合众资产发（2018）223号， 发文时间：2018-09-30；

六、托管机制

整体评估情况：

公司股指期货托管机制符合股指期货能力标准的基本要求。公司与中国工商银行股份有限公司和新湖期货股份有限公司签署了《合众资产管理股份有限公司股指期货投资托管运营备忘录（传统账户）》、《合众资产管理股份有限公司股指期货投资托管运营备忘录（分红和万能账户）》，与中国邮政储蓄银行股份有限公司和中信期货有限公司签署了《合众资产-邮政储蓄银行-中信期货-期货三方操作备忘录》，以上备忘录详细规定了股指期货业务的资金划拨、清算、估值等事项，明确了各事项中我司、托管机构、期货经纪公司各自的权利和义务。经评估，托管机制建设情况符合要求。

七、系统建设

整体评估情况：

公司在股指期货系统建设方面符合股指期货能力标准的基本要求。公司采购了市场成熟的恒生投资交易系统（含股指期货模块）、恒生资产估值与会计核算系统（含股指期货估值和核算模块）和恒生投资绩效评估与风险管理系统（含股指期货模块），实现了股指期货期现匹配（套期保值，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）、期货展期（合约到期管理）、期货保证金管理、期货交易风险管理（事前和事中风控）、交易结算、估值核算、绩效评估和事后风控等股指期货套期保值业务全流程管理功能。核心业务系统在网络、存储、操作系统、数据库和应用软件等层面进行了集群部署和热备份，保障系统和数据的高可用性。相关系统上线前均通过了业务测试和可靠性测试，并制定了《投资系统重大突发事件应急预案》，保障核心业务系统的可用性和可靠性。与期货公司的交易通道，通过深证通主、备线路进行链接。两条线路互为备份、实时切换，保证了交易通道的实时、高效。经评估，公司系统建设情况符合要求。			
交易结算系统：			
系统名称	恒生投资交易管理系统032（股指期货交易和清算模块）		
上线时间	2020-02-28	评估结果	符合规定
主要功能	系统高效稳定，支持交易结算，与期货公司的交易通道，通过深证通主、备线路进行链接。两条线路互为备份、实时切换，保证了交易通道的实时、高效。		
投资分析系统：			
系统名称	恒生投资交易管理系统032（股指期货智能交易模块和期现匹配模块）		
上线时间	2020-02-28	评估结果	符合规定
主要功能	系统高效稳定，实现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。支持期货和现货篮子智能交易以及期货展期交易，保证期货和现货智能匹配和合约到期展期智能交易，支持投资授权管理、套保额度管理、风险敞口管理、风险限额管理和保证金管理等，满足股指期货套期保值和保证金的动态管理要求。		
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	2016-01-25	评估结果	符合规定
主要功能	系统高效稳定，满足会计准则估值核算要求，支持股指期货业务相关会计科目、交易保证金、交易结算账户、业务种类等设置、股指期货交易结算数据导入、交易清算和估值核算等功能，完成会计确认、财务核算，生成估值报表、余额表和资产负债表等财务报表功能。		
风险管理信息系统：			
系统名称	恒生投资交易管理系统032（风险控制模块）		
上线时间	2020-02-28	评估结果	符合规定
主要功能	系统高效稳定，满足事前和事中风险管理需求，支持投资经理授权管理（指令授权审批机制）、风险敞口管理、保证金管理、套保额度管理、风险限额管理和合约到期提醒等风险预警和风险控制功能，各项风险管理指标固化在系统中，重要风险指标能够进行实时监控和预警等。		
系统名称	恒生投资绩效评估与风险管理系统		
上线时间	2013-01-14	评估结果	符合规定
主要功能	系统高效稳定，满足事后风险管理需求，支持交易清算和估值核算后账务数据导入，分析和计算各类风险和绩效指标，形成风险和绩效报表，满足绩效评估和事后风控管理需求。		

八、风险管理

整体评估情况：

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。