

**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-20250116）

合众资产管理股份有限公司

2025 年 1 月 23 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— 20250116）

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兼权益投资部副总经理
专业责任人类别：	授权的相关资产管理部 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、权益投资部
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，公司具有良好公司治理结构，董事会、监事会和经营管理层根据《公司法》和《上市公司治理准则》等法律法规，建立了授权制度和决策机制，公司近两年来未受到监管机构重大行政处罚。

在财务处理、法律合规、风险控制等方面，公司配备了相应岗位，严格执行了各项管理制度，确保了各项业务操作的合规性和风险控制的有效性。公司建立了完善的内部控制体系，包括但不限于分析研究、投资交易、稽核、风险管理、清算、法律合规、风险控制、内部审计、人力资源、信息技术、运营支持等部门，各部门职责明确，相互制衡，重点环节双人复核。股指期货业务涉及资产配置、投资、研究、交易、清算、风控、法律合规、风险控制、内部审计、人力资源、信息技术、运营支持等部门，各部门职责明确，相互制衡，重点环节双人复核。

在股指期货业务方面，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》，明确了各环节双人复核等。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内部控制办法》、《合众资产管理股份有限公司股指期货业务风险管理细则》和《合众资产管理股份有限公司股指期货业务风险管理实施细则》等制度，建立了事前、事中、事后全流程风险管理机制，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体系，覆盖股指期货交易前、中、后台等。

在系统建设方面，公司建立了投资交易系统、恒生估值系统（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（合约到期后风控）等股指期货业务全流程管理功能。公司建立了股指期货业务全流程管理功能。

综上所述，公司在基本条款方面符合《股指期货业务内部控制管理办法》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。公司董事会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制度》，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			
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，股指期货和投资决策、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:						
<p>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。</p>						
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	10.55
2	谭宇欣	稽核岗	否	其他	已通过	8.47
3	陈莉	配置岗	否	期货或证券业务经验	已通过	5.51
4	刘怡惟	核算岗	否	期货或证券业务经验	已通过	13.23
5	李君	清算岗	否	其他	已通过	12.51
6	邛明阳	投资岗	否	期货或证券业务经验	已通过	4.84
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	18.04
9	贾慧捷	交易岗	否	期货或证券业务经验	已通过	8.44
10	刘晨宇	交易岗	否	期货或证券业务经验	已通过	13.14
11	张漫春	风险管理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	6.65
12	贾尚达	风险管理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	7.06
13	韦若愚	风险管理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	3.78

五、投资规则与基本制度

整体评估情况:

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； 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；

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：

公司的信息系统至少包括业务处理设备、交易软件和操作系统等，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恒生投资和交易系统（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、期货套期保值和期货展期智能交易以及期货展期智能交易、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。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。核心业务系统在网络、存储、操作均通过了业务测试和可靠性的测试，并制定了《投资系统重要事件应急预案》，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、备线路进行连接。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、备线路进行连接。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

动态风险管理机制评估：	<p>公司制定了《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业务操作细则》、《合众资产管理股份有限公司股指期货业务风险控制细则》、《合众资产管理股份有限公司股指期货业务风险管理细则》、《合众资产管理股份有限公司股指期货业务应急预案》等制度，明确了股指期货业务各环节的操作流程、风险控制措施、风险管理要求等，并建立了股指期货业务风险预警机制，对股指期货业务风险敞口、套保额度、对冲比例、持仓限额等风险指标进行实时监控和预警，并依据风险预警机制，及时采取风险对冲措施，确保股指期货业务风险可控。同时，公司还建立了股指期货业务应急预案，明确了股指期货业务突发事件的应急处置流程，确保在突发事件发生时能够及时、有效地进行处置。</p>
风险对冲有效性预警机制评估：	<p>公司建立了风险对冲有效性预警机制，及时根据市场变化对交易作出风险预警。公司制定了《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》，明确了风险监控指标体系和风险对冲预警体系，具体包括套保有效性、风险敞口、风险敞口、保证金风险比例、套保额度、持仓限额等风险指标的监测和预警，并依据风险异常情况启动相应的报告流程，业务部门收到风险提示后，在规定时间内进行反馈和调整。</p>
激励制度和机制评估：	<p>公司制定了《合众资产管理股份有限公司绩效考核管理办法》，并依据此办法每年制定《员工年度考核实施方案》，方案中规定员工的绩效考核结果包括工作业绩、合规情况、风险控制、工作态度、行为表现等，最终考核结果分为优秀、良好、合格、不合格四个等级。绩效考核结果与薪酬挂钩，对于绩效考核优秀的人员，公司将给予相应的奖励；对于绩效考核不合格的人员，公司将给予相应的处罚。同时，公司还建立了合规考核机制，将合规情况纳入绩效考核体系，确保员工在业务开展过程中严格遵守法律法规和公司规章制度。</p>
定期监督检查情况评估：	<p>公司制定了《合众资产管理股份有限公司股指期货业务内部稽核办法》，明确了股指期货业务内部稽核的组织架构、稽核范围和稽核程序。稽核范围包括股指期货业务内部控制制度的执行情况、业务操作的合规性、风险管理的有效性等。稽核程序包括稽核计划的制定、稽核实施、稽核报告编制和稽核整改等环节。公司还建立了内部审计制度，定期对股指期货业务进行专项审计，并将审计结果报送国家金融监督管理总局。</p>
回溯分析情况评估：	<p>公司按规定每半年开展一次股指期货专项审计，并出具审计报告，报告内容包含买入计划与实际执行偏差的回溯情况，并按规定报送国家金融监督管理总局。</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。