

# 中再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— 20240126）



## 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：	李巍	职务：	党委书记、副董事长、总经理 0394
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	1971-01
行政责任人学历	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	2017-03-15
行政责任人专业资质	-	行政责任人专业技术职务	-
专业责任人：	罗若宏	职务：	副总经理
专业责任人类别：	高级管理人员	是否履行完备的授权程序：	
专业责任人性别	男	专业责任人出生年月	1973-02
专业责任人学历	研究生	专业责任人学位	硕士
专业责任人入司时间	2017-07-01	专业责任人所在部门	总经理室
专业责任人专业资质	专业责任人具备相关投资领域10年以上从业经历	专业责任人专业技术职务	-

## 二、基本条件

整体评估情况：
---------



<p>公司均符合《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> <p>公司近两年未受到监管机构重大行政处罚。具体情况如下：</p> <p>公司整体衍生品管理能力（股指期货）符合保险资产管理机构衍生品运用管理能力的基本条件。</p> <p>公司具有良好和完整的治理结构，建立了股东大会、董事会、经营管理层到各层级员工的分级授权和管理体系。目前公司授权体系清晰明确。公司制定了《中再资产管理股份有限公司股东大会对董事会授权方案》（中再资产发〔2023〕167号）、《中再资产管理股份有限公司对总经理授权方案》（中再资产发〔2023〕167号）、《中再资产管理股份有限公司投资审批授权管理办法》（中再资产发〔2022〕133号），确定了金融衍生品投资业务的授权管理体系，股东大会对董事会授权，董事会对总经理授权，总经理通过投资决策机构将股指期货投资权限分级授权给具体投资人员。</p> <p>公司制定了《中再资产管理股份有限公司战术资产配置管理办法》（中再资产发〔2021〕206号）、《中再资产管理股份有限公司股指期货投资管理办法》（中再资产发〔2023〕366号）、《中再资产管理股份有限公司股指期货交易操作规程》（中再资产发〔2021〕460号）、《中再资产管理股份有限公司金融期货风险控制管理办法》（中再资产发〔2020〕369号）、《中再资产管理股份有限公司资产管理业务防火墙管理暂行办法》（中再资产发〔2018〕304号）、《中再资产管理股份有限公司股指期货结算管理办法》（中再资产发〔2020〕422号）等制度，建立了完善的制度管理体系，对股指期货业务的资产配置和投资交易、风险管理、清算核算等全流程进行了规范。</p> <p>公司制定了相关内部控制制度。《中再资产管理股份有限公司内部控制管理办法》（中再资产发〔2019〕136号）、《中再资产管理股份有限公司投资风险管理办法》（中再资产发〔2022〕315号），将股指期货业务纳入公司整体内部控制体系中。</p> <p>公司制定了相关风险管理制度。公司制定了《中再资产管理股份有限公司全面风险管理办法》（中再资产发〔2023〕370号）、《中再资产管理股份有限公司投资风险管理办法》（中再资产发〔2022〕315号）、《中再资产管理股份有限公司金融期货风险控制管理办法》（中再资产发〔2020〕369号），将股指期货业务纳入公司总体风险管理架构，股指期货业务开展遵循制度规范。</p> <p>公司建立了投资交易、清算核算和风险管理等信息系统，其中投资交易、风险管理、交易结算使用恒生投资管理系统，估值核算使用fusion系统。</p> <p>公司建立了股指期货业务团队，团队人员均具备期货或证券业务相关经验，全部通过了期货从业资格考试，相关人员符合监管规定的要求。</p> <p>根据《中国再保险（集团）股份有限公司内部审计管理办法》（中再发〔2017〕118号）、《中国再保险（集团）股份有限公司内部审计项目委托管理暂行办法》（中再发〔2013〕122号）、中再资产管理股份有限公司第四届董事会第九次会议审议通过的《关于继续委托中国再保险（集团）股份有限公司开展内部审计项目的议案》，集团系统实行审计集中化管理，公司不设内部审计部门，内部审计职能由集团审计部承担。</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

<p>整体评估情况：</p> <p>公司衍生品运用管理（股指期货）组织架构设置符合《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，董事会、部门设置等符合规定要求。公司第三届董事会第三次会议通过《关于中再资产管理股份有限公司参与股指期货交易的议案》，签署了《中再资产管理股份有限公司董事会风险知晓函》，董晓晓董事知晓并承诺承担股指期货交易的最终责任。公司制定了《中再资产管理股份有限公司对董事会授权方案》（中再资产发〔2023〕167号）、《中再资产管理股份有限公司对总经理授权方案》（中再资产发〔2023〕167号）、《中再资产管理股份有限公司投资审批授权管理办法》（中再资产发〔2022〕133号），确定了金融衍生品投资业务的授权管理体系，股东大会对董事会授权，董事会对总经理授权，总经理通过投资决策机构将股指期货投资权限分级授权给具体投资人员。公司授权体系清晰明确。公司设立了组合管理部、风险管理部、内控合规与法律事务部、交易管理部、信息技术部、运营管理部等部门，制定了《中再资产管理股份有限公司战术资产配置管理办法》（中再资产发〔2021〕206号）、《中再资产管理股份有限公司股指期货投资管理办法》（中再资产发〔2023〕366号）、《中再资产管理股份有限公司股指期货交易操作规程》（中再资产发〔2021〕460号），对资产配置和投资交易、风险管理、清算核算进行了具体规定。公司下发了《关于调整公司部分部门职责和内设岗位职责的通知》（中再资产发〔2023〕497号），对相关部门职责和岗位职责进行了明确。根据《中国再保险（集团）股份有限公司内部审计管理办法》（中再发〔2017〕118号）、《中国再保险（集团）股份有限公司内部审计项目委托管理暂行办法》（中再发〔2013〕122号）、中再资产管理股份有限公司第四届董事会第十九次会议审议通过的《关于继续委托中国再保险（集团）股份有限公司开展内部审计项目的议案》，集团系统实行审计集中化管理，公司不设内部审计部门，内部审计职能由集团审计部承担。</p>			
投资交易部门			
1			
部门名称：	交易管理部		
发文时间：	2023-12-29	文件名称（含文号）：	《关于调整公司部分部门职责和内设岗位职责的通知》（中再资产发〔2023〕497号）
岗位设置：	衍生品交易员岗		
2			



部门名称:	权益投资部		
发文时间:	2023-12-29	文件名称(含文号):	《关于调整公司部分部门职责和内设岗位职责的通知》(中再资产发(2023)497号)
岗位设置:	股票研究岗		
3			
部门名称:	组合管理部		
发文时间:	2023-12-29	文件名称(含文号):	《关于调整公司部分部门职责和内设岗位职责的通知》(中再资产发(2023)497号)
岗位设置:	投资业务岗,资产配置岗		
风险管理部			
1			
部门名称:	内控合规与法律事务部		
发文时间:	2023-12-29	文件名称(含文号):	《关于调整公司部分部门职责和内设岗位职责的通知》(中再资产发(2023)497号)
岗位设置:	内控合规监督岗,内控合规管理岗		
2			
部门名称:	风险管理部		
发文时间:	2023-12-29	文件名称(含文号):	《关于调整公司部分部门职责和内设岗位职责的通知》(中再资产发(2023)497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:	2023-12-29	文件名称(含文号):	《关于调整公司部分部门职责和内设岗位职责的通知》(中再资产发(2023)497号)
岗位设置:	会计核算岗,清算管理岗		
内部稽核部门			
1			
部门名称:	集团公司审计部(监事会办公室)		
发文时间:	2021-05-06	文件名称(含文号):	中国再保险(集团)股份有限公司部门工作职责(中再发(2021)99号)
岗位设置:	投资审计岗		
防火墙机制:	公司防火墙机制建设符合规定,防火墙体系情况、业务分离制度、部门间独立运作等情况符合规定。公司制定了《中再资产管理股份有限公司资产管理业务防火墙管理暂行办法》(中再资产发(2018)304号),明确了前、中、后台之间设立防火墙体系,实行严格的业务分离制度,确保投资交易、风险管理、清算核算等部门独立运行,公司各项业务的开展均需遵循该制度规范,公司不设立内部审计机构,集团公司对集团系统各子公司内部审计工作实施集中化管理,相关稽核工作独立开展。		
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）专业队伍建设符合监管规定，专业人员的数量、经验、资质能力符合规定。公司配备了股指期货专业管理人员共11人，包含了资产配置和投资交易、清算核算、风险控制、研究分析等人员，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2人，研究分析人员1人，上述人员均通过了期货从业资格；资产配置和投资交易、风险控制、清算核算岗位人员不存在相互兼任情况；负责人员具有5年以上证券业务经验，业务经理均具有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	是否通过期货从业资格考试	相关经验年限
1	赵岳	衍生品交易员岗	否	期货或证券业务经验	已通过	11.81
2	杨冬青	衍生品交易员岗	否	期货或证券业务经验	已通过	14.51
3	贾昊	内控合规监督岗	否	期货或证券业务经验	已通过	4.50
4	王之博	内控合规管理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	4.33
5	韩璐	股票研究岗	否	期货或证券业务经验	已通过	7.42
6	袁军	投资业务岗	否	期货或证券业务经验	已通过	5.50
7	崔岩	投资业务岗	否	期货或证券业务经验	已通过	12.25
8	于慧慧	资产配置岗	否	期货或证券业务经验	已通过	10.51
9	秦莽	会计核算岗	否	期货或证券业务经验	已通过	12.51
10	薛山	清算管理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	9.34
11	张恬	风险管理岗	否	期货或证券业务经验	已通过	11.51

## 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）的相关规则和制度建设符合监管规定，按规定制定了风险对冲方案、与交易结算机构签署了协议文件、建立健全了衍生品交易业务操作制度、内部控制制度、风险管理制度和问责制度，相关制度文件均正式发文。具体情况如下：

公司制定了股指期货业务风险对冲方案（套期保值方案）。具体为：公司投资决策委员会审议批准了《寿再资产-锐诚6号资产管理产品套期保值方案》、《大地账户股指期货买入套期保值方案》、《中再资产-锐祺5号资产管理产品套期保值方案》、《中再资产-锐祺6号资产管理产品套期保值方案》和《中再资产-锐祺7、9、10、11、12号资产管理产品风险对冲方案》，公司第三方专户与组合类产品决策委员会审议批准了《中再资产-锐祺6号资产管理产品风险对冲方案》、《中再资产-锐祺1号资产管理产品风险对冲方案》和《中再资产-风格轮动资产管理产品风险对冲方案》。对套保对象、套保工具、套保风险敞口限额、有效期限、保证金管理措施等情况进行详细说明。

公司与相关交易机构签署了相关协议文件，公司和工商银行分别与三家期货公司（银河期货、中粮期货、申银万国）签署了《中再资产管理股份有限公司股指期货投资托管运营备忘录》；公司和兴业银行等托管行分别与两家期货公司（银河期货、中粮期货）签署了《中再资产管理股份有限公司期货投资操作备忘录》。相关协议和期货备忘录均约定了股指期货业务的资金划拨、交易、结算、风险监控等事项，明确了协议各方的权利和义务。

公司建立健全了衍生品交易业务操作制度。具体为：公司制定了《中再资产管理股份有限公司战术资产配置管理办法》（中再资产发〔2021〕206号）、《中再资产管理股份有限公司股指期货投资管理办法》（中再资产发〔2023〕366号）、《中再资产管理股份有限公司股指期货结算管理办法》（中再资产发〔2020〕422号）、《中再资产管理股份有限公司股指期货交易操作规程》（中再资产发〔2021〕460号），制度涵盖了资产配置、投资决策、交易、清算核算等内容，责任分工明确。

公司制定了相关内部控制制度。《中再资产管理股份有限公司内部控制管理办法》（中再资产发〔2019〕136号）、《中再资产管理股份有限公司投资风险管理办法》（中再资产发〔2022〕315号）将股指期货业务纳入公司整体内部控制体系中。《中再资产管理股份有限公司金融期货风险控制管理办法》（中再资产发〔2020〕369号）第十二条明确规定了关键环节和重要岗位建立双人复核机制。公司还制定了《中再资产管理股份有限公司股东大会对董事会授权方案》（中再资产发〔2023〕167号）、《中再资产管理股份有限公司董事会对总经理授权方案》（中再资产发〔2023〕167号）、《中再资产管理股份有限公司投资审批授权管理办法》（中再资产发〔2022〕133号），明确了股指期货业务采用分级授权方式进行投资授权。

公司制定了相关风险管理制度。公司制定了《中再资产管理股份有限公司全面风险管理办法》（中再资产发〔2023〕370号）、《中再资产管理股份有限公司投资风险管理办法》（中再资产发〔2022〕315号）、《中再资产管理股份有限公司金融期货风险控制管理办法》（中再资产发〔2020〕369号），将股指期货业务纳入公司总体风险管理架构，股指期货业务开展遵循制度规范。

公司制定了相关问责制度。《中再资产管理股份有限公司问责管理办法》（中再资产发〔2022〕160号）、《中再资产管理股份有限公司投资人员行为守则》（中再资产发〔2019〕69号）、《中再资产管理股份有限公司资产管理业务责任追究暂行办法》（中再资产发〔2020〕378号），明确了参与股指期货业务人员的行为规范和问责制度。

上述文件均经过公司经营管理部门的审议批准，其中公司内部制度以公司发文形式下发执行。

衍生品交易管理制度：



制度内容	评估结果	制度明细
问责制度	符合规定	文件名称：中再资产管理股份有限公司资产管理业务责任追究暂行办法， 发文文号：中再资产发（2020）378号， 发文时间：2020-12-25； 文件名称：中再资产管理股份有限公司投资人员行为守则， 发文文号：中再资产发（2019）69号， 发文时间：2019-03-05； 文件名称：中再资产管理股份有限公司问责管理办法， 发文文号：中再资产发（2022）160号， 发文时间：2022-04-18；
与交易结算机构签署协议文件	符合规定	文件名称：中再资产管理股份有限公司股指期货投资托管运营备忘录-申银万国期货、工商银行、中再资产， 发文文号：无， 发文时间：2019-04-11； 文件名称：中再资产管理股份有限公司期货投资操作备忘录-银河期货、兴业银行、中再资产， 发文文号：无， 发文时间：2020-09-24； 文件名称：中再资产管理股份有限公司期货投资操作备忘录-中粮期货、兴业银行、中再资产， 发文文号：无， 发文时间：2020-09-24； 文件名称：中再资产管理股份有限公司股指期货投资托管运营备忘录-银河期货、工商银行、中再资产， 发文文号：无， 发文时间：2020-09-24； 文件名称：中再资产管理股份有限公司股指期货投资托管运营备忘录-中粮期货、工商银行、中再资产， 发文文号：无， 发文时间：2020-09-24；
风险对冲方案	符合规定	文件名称：中再资产-锐祺5号资产管理产品卖出套期保值方案， 发文文号：无， 发文时间：2020-10-16； 文件名称：寿再账户股指期货买入套期保值方案， 发文文号：无， 发文时间：2019-11-20； 文件名称：中再资产-锐祺7、9、10、11、12号资产管理产品风险对冲方案， 发文文号：无， 发文时间：2021-05-17； 文件名称：中再资产-风格轮动资产管理产品风险对冲方案， 发文文号：无， 发文时间：2023-03-02； 文件名称：中再资产-锐诚1号资产管理产品风险对冲方案， 发文文号：无， 发文时间：2022-07-25； 文件名称：中再资产-锐诚6号资产管理产品风险对冲方案， 发文文号：无， 发文时间：2021-12-29； 文件名称：中再资产-锐祺6号资产管理产品套期保值方案， 发文文号：无， 发文时间：2021-03-30； 文件名称：大地账户股指期货买入套期保值方案， 发文文号：无， 发文时间：2020-03-09；

内部控制制度	符合规定	<p>文件名称：中再资产管理股份有限公司内部控制管理办法，          发文文号：中再资产发（2019）136号，          发文时间：2019-04-29；          文件名称：中再资产管理股份有限公司投资审批授权管理办法，          发文文号：中再资产发（2022）133号，          发文时间：2022-04-15；          文件名称：中再资产管理股份有限公司资产管理业务防火墙管理暂行办法，          发文文号：中再资产发（2018）304号，          发文时间：2018-12-28；          文件名称：中再资产管理股份有限公司投资风险管理办法，          发文文号：中再资产发（2022）315号，          发文时间：2022-08-02；          文件名称：中再资产管理股份有限公司金融期货风险控制管理办法，          发文文号：中再资产发（2020）369号，          发文时间：2020-12-25；          文件名称：中再资产管理股份有限公司股东大会对董事会授权方案，          发文文号：中再资产发（2023）167号，          发文时间：2023-04-28；          文件名称：中再资产管理股份有限公司董事会对总经理授权方案，          发文文号：中再资产发（2023）167号，          发文时间：2023-04-28；</p>
衍生品交易业务操作制度	符合规定	<p>文件名称：中再资产管理股份有限公司股指期货结算管理办法，          发文文号：中再资产发（2020）422号，          发文时间：2020-12-29；          文件名称：中再资产管理股份有限公司股指期货投资管理办法，          发文文号：中再资产发（2023）366号，          发文时间：2023-10-23；          文件名称：中再资产管理股份有限公司战术资产配置管理办法，          发文文号：中再资产发（2021）206号，          发文时间：2021-06-04；          文件名称：中再资产管理股份有限公司股指期货交易操作规程，          发文文号：中再资产发（2021）460号，          发文时间：2021-12-09；</p>
风险管理制度	符合规定	<p>文件名称：中再资产管理股份有限公司全面风险管理办法，          发文文号：中再资产发（2023）370号，          发文时间：2023-10-26；          文件名称：中再资产管理股份有限公司投资风险管理办法，          发文文号：中再资产发（2022）315号，          发文时间：2022-08-02；          文件名称：中再资产管理股份有限公司金融期货风险控制管理办法，          发文文号：中再资产发（2020）369号，          发文时间：2020-12-25；</p>

## 六、托管机制

### 整体评估情况：

公司股指期货业务托管机制符合规定，与资产托管机构签署了协议文件，确定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。公司系统内受托管理的资金，均托管至工商银行，各委托人分别与工商银行，签订了保险资产托管协议，公司和工商银行分别与三家期货公司（银河期货、中粮期货、申银万国期货）签署了《中再资产管理股份有限公司股指期货投资托管运营备忘录》；第三方产品分别与光大银行和兴业银行等签订了保险资产托管协议。公司和兴业银行等托管行分别与两家期货公司（银河期货、中粮期货）签署了《中再资产管理股份有限公司股指期货投资操作备忘录》。相关协议和备忘录详细约定了股指期货业务的资金划拨、交易、保证金管理、风险监控、数据传输、清算估值等事项，明确了协议各方的权利和义务。



## 七、系统建设

整体评估情况：			
<p>公司股指期货交易的系统建设情况符合规定，投资交易、会计核算、风险管理等信息系统的建设符合规定，已包括相应的业务处理设备、交易软件和操作系统等，已通过可靠性测试。具体情况如下： 公司在投资交易、会计核算、风险管理等方面进行了系统化建设。系统覆盖股指期货投资业务的组合管理、指令下达、风控审批、指令委托、日终对账和清算。在公司现有恒生投资管理系统(O32)中增加了股指期货投资指令、股指期货投资交易、策略交易模块套保版(HUNDSUN策略交易1.0-股指期货套保版)等模块，使用Fusion系统进行估值核算。相关系统均通过了可靠性测试。公司股指期货业务的交易处理设备包括：交易机、清算文件接收机、交易系统服务器，专线都独立部署，与外部互联网隔离。交易软件包括：Fusion系统、恒生投资管理系统(O32)、FDEP系统，上述系统相互独立且根据业务需要进行权限控制。服务器操作系统包括：redhat 6.5、windows server2012，公司定期进行系统补丁修复和内网查杀，保障系统安全。上述交易设备、交易软件和操作系统符合相关规定，并通过可靠性测试。</p>			
交易结算系统：			
系统名称	恒生投资管理系统-股指期货模块		
上线时间	2019-10-20	评估结果	符合规定
主要功能	<p>系统功能达标。支持对股指期货交易清算，日终接收期货公司对账单，交易流水单等清算数据进行系统自动对账，同时支持连接多家期货机构有相应的备份线路。支持与合作的交易结算机构信息系统对接，并有备份通道。交易系统稳定高效，满足交易需求。</p>		
投资分析系统：			
系统名称	恒生投资管理系统-股指期货套保子模块		
上线时间	2019-10-20	评估结果	符合规定
主要功能	<p>该投资系统符合规定，在计算对冲资产组合风险所需的衍生品数量、实现担保品动态调整的衍生品规模调整等方面均符合规定。支持对股指期货交易的投资管理分析，支持对套保额度和套保方案的管理，支持套保事前分析、套保方案审批、套保风险监控，支持套保信息的查询，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，实现担保品动态调整。</p>		
资产估值和核算系统：			
系统名称	Fusion系统		
上线时间	2023-04-17	评估结果	符合规定
主要功能	<p>系统功能达标。系统支持股指期货业务的相关核算会计科目计算，实现股指期货资产估值、会计核算、保证金管理、交易核算、清算、会计确认、计量、账务处理、财务报告等业务处理和查询，符合规定。股指期货估值系统稳定高效，且能够满足估值需求。符合股指期货业务的估值核算和信息披露要求。</p>		
风险管理信息系统：			
系统名称	恒生投资管理系统-股指期货套保子模块		
上线时间	2019-10-20	评估结果	符合规定
主要功能	<p>系统功能达标。支持股指期货指令流程管控，对交易指令的可用头寸、持仓检查、保证金风控、冗余度、风险度等多维度实现对股指期货指令的实时监控。支持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。</p>		

## 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方位风险管理体系，符合规定。动态风险管理机制、风险预警机制、激励制度和机制、监督检查机制、偏差回溯机制等情况均符合规定。 公司制定了《中再资产管理股份有限公司全面风险管理办法》（中再资产发〔2023〕370号）、《中再资产管理股份有限公司投资风险管理办法》（中再资产发〔2022〕315号），将股指期货业务纳入公司总体风险管理架构。《中再资产管理股份有限公司投资风险管理办法》（中再资产发〔2022〕315号）、《中再资产管理股份有限公司金融期货风险控制管理办法》（中再资产发〔2020〕369号）明确了股指期货业务动态风险管理机制、风险对冲有效性预警机制。 公司制定了《中再资产管理股份有限公司员工绩效考核管理办法》（中再资产发〔2022〕167号）、《中再资产管理股份有限公司风险类指标绩效考核管理办法》（中再资产发〔2022〕174号），有统一的员工绩效考核管理制度、员工绩效工资管理制度，明确了员工收入不直接与交易盈亏挂钩。 根据《中国再保险（集团）股份有限公司内部审计管理办法》（中再发〔2017〕118号）、《中国再保险（集团）股份有限公司内部审计项目委托管理暂行办法》（中再发〔2013〕122号）、中再资产管理股份有限公司第四届董事会第十次审议通过《关于继续委托中国再保险（集团）股份有限公司开展内部审计项目的议案》，集团系统实行审计集中化管理，公司不设立内部审计部门，内部审计职能由集团审计部承担。集团内部审计部根据监管规定和内部审计制度的要求，定期对我司开展衍生品交易风险管理情况监督检查，将半年度买入计划与实际执行的偏差回溯情况纳入稽核审计报告，并按规定向监管机构报告。</p>			



<p>动态风险管理机制评估：</p>	<p>公司建立了股指期货业务的全方位风险管理制度体系和动态风险管理机制，制定了股指期货业务的操作流程，建立实时监测、评估与处置风险的完整体系，符合规定。《中再资产管理股份有限公司投资风险管理暂行办法》（中再资产发〔2022〕315号）为投资风险管理总办法，将股指期货业务纳入整体投资风险管理框架内。其中第十条规定：风险管理部对固定收益类、股票类、商品类、衍生品类等投资业务的风险量化指标进行日常动态监控及分析，包括但不限于久期、集中度、授信信用情况、行业偏离度、在险价值等。《中再资产管理股份有限公司金融期货风险控制管理办法》（中再资产发〔2020〕369号）第三章明确了金融期货业务的风险控制工具与措施，第四章明确了金融期货业务的风险控制流程，明确了事前、事中、事后的风险评估及应对措施。《中再资产管理股份有限公司金融期货风险控制管理办法》（中再资产发〔2020〕369号）第十一条、第十二条和《中再资产管理股份有限公司股指期货交易操作规程》（中再资产发〔2021〕460号）第四章对股指期货业务的应急机制及管理预案做出明确规定。公司使用“恒生投资管理系统-股指期货套保子模块”作为股指期货业务的风险管理系统，风控合规部门根据监管规定、公司内部授权要求、风险对冲方案等要求在系统内进行事前风险控制，使违反风险控制指标的交易指令无法下达。事中交易系统实时监测股指期货保证金比例、风险敞口等指标。对于预警情况，期货公司和交易系统及时提示投资交易部门和运营管理部门，采取相应的风险处置措施。事后风控合规部门基于风险敞口、对冲比例等指标进行风险监控评估，对于突破限额要求的，及时提示投资部门采取相应的风险处置措施。</p>
<p>风险对冲有效性预警机制评估：</p>	<p>风险控制指标监测情况、风险对冲预警机制建立情况符合规定。《中再资产管理股份有限公司金融期货风险控制管理办法》（中再资产发〔2020〕369号）第十六条要求投资部门制定套期保值方案时，应当在方案中明确套期保值工具、对象、规模、期限以及有效性等相关内容，风险管理部门应对投资策略和具体操作方案有效性进行测算评估并出具意见。公司已将衍生品业务风控指标设入系统，进行监测。《中再资产管理股份有限公司金融期货风险控制管理办法》（中再资产发〔2020〕369号）第十七条要求风险管理部门如发现投资策略未按既定策略执行、风险指标预警等异常情况，将按照事先确定的程序，督促相关部门及时调整风险敞口，以确保投资策略或套期保值的可行性和有效性。公司已建立衍生品风险对冲预警机制，已在各风险对冲方案中进行明确，并予以执行。</p>
<p>激励制度和机制评估：</p>	<p>激励制度和机制符合规定，交易盈亏与业务人员收入挂钩情况、后台及风险管理部门的人员报酬与交易盈亏的独立情况等符合规定。公司制定了《中再资产管理股份有限公司员工绩效考核管理办法》（中再资产发〔2022〕167号）、《中再资产管理股份有限公司风险类指标绩效考核管理办法》（中再资产发〔2022〕174号），有统一的员工绩效考核管理制度、员工绩效工资管理制度。其中，股指期货相关业务人员的绩效工资收入不直接与交易盈亏挂钩，而是取决于员工的岗位价值、工作能力、部门考核结果、个人考核结果。考核的指标既包括投资业务类指标，也包括管理类指标、合规风控类指标。后台及风险管理部门的人员报酬，与交易盈亏情况无直接关联。后台及风险管理部门的人员的报酬主要取决于岗位价值、员工个人能力及当年度部门考核、个人考核综合结果，独立于交易盈亏情况。</p>
<p>定期监督检查情况评估：</p>	<p>定期监督检查情况符合规定，建立了衍生品（股指期货）风险管理定期核查机制，核查内容及稽核报告符合规定。根据《中国再保险（集团）股份有限公司内部审计管理办法》（中再发〔2017〕118号）、《中国再保险（集团）股份有限公司子公司内部审计项目委托管理暂行办法》（中再发〔2013〕122号）、中再资产管理股份有限公司第四届董事会第十九次会议审议通过的《关于继续委托中国再保险（集团）股份有限公司开展内部审计项目的议案》，集团系统实行审计集中化管理，公司不设内部审计部门，内部审计职能由集团审计部承担。集团公司审计部根据监管规定和内部审计制度的要求，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。</p>
<p>回溯分析情况评估：</p>	<p>稽核审计报告符合规定。根据《中国再保险（集团）股份有限公司内部审计管理办法》（中再发〔2017〕118号）、《中国再保险（集团）股份有限公司子公司内部审计项目委托管理暂行办法》（中再发〔2013〕122号）、中再资产管理股份有限公司第四届董事会第十九次会议审议通过的《关于继续委托中国再保险（集团）股份有限公司开展内部审计项目的议案》，集团系统实行审计集中化管理，公司不设内部审计部门，内部审计职能由集团审计部承担。集团公司审计部根据监管规定和内部审计制度的要求，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，并按规定向监管机构报告。</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。

