

中国人寿资产管理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— 20220128）

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：	王军辉	职务：	总裁
行政责任人米利：	揭如岩	是否履行完备的授权程序	是

第 委员会在核前
会决策人；清算
事投资管理；立
董投了部理、设
三司明确等管文
届公明核险式
第权，稽风正
过授度，部、等
经事策、交《
业董决算、资规
指董核核投资责
期任，授保保职
指责定、清确部
展最司制度，司
开公的公限有
公交。风分
品文、员理
求。品交和产
要衍相资位资
管与署投岗寿
监参签的、人
合担批易务、中
符承审交业《
架并及货的
组风策指期发
组关决股指下
）相行负责实通
货知务立系作
期业已设体运
指事会火墙独
理（董期司火
管过，指公防
用通对股。立
运议层要间核
品审理告之稽
衍会、及部内
公25员职不

投资交易部门

公司已配备股指期货交易专业管理人员，包括分析研究、投资交易、财务处理、风险控制和审计稽核等人员

上线时间	2009-01-05	评估结果	符合规定
主要功能	Mortfolio估值核算系统配备了股指期货估值与清算模块，能够稳定高效的实现会计确认、计量、账务处理及财务报告等流程，能够满足估值需求，符合规定要求。		
风险管理信息系统：			
系统名称	恒生投资交易系统		
上线时间	2015-06-23	评估结果	符合规定
主要功能	2015年6月23日，公司风险管理信息系统变更为恒生投资交易系统，能够对股指期货交易进行实时监控，各项风险管理指标固化在系统中，能够实现及时预警，符合规定要求。		

风险管理

评估情况：

制定印发了《中国人寿资产管理有限公司股指期货风险管理暂行办法》和《中国人寿资产管理有限公司股指期货交易管理办法》，建立了动态风险管理机制，包括制定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，完善应急机制和管理预案；根据公司及资产组合实际情况，动态监测相关风险控制指标，制定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；制定了有效的激励制度和机制，未简单将股指期货交易盈亏与业务人员收入挂钩，后台及风险管理部门的人员报酬独立于交易盈亏情况；内部审计部门定期对衍生品交易的风险管理情况进行监督检查，独立提交半年度和年度稽核报告。

动态风险管理机制评估：全面的风险管理制度和业务操作流程，信息系统，应急机制和管理预案等制度、信息系统

评估：通过恒生002系统进行风险监控，设定保证金分级预警，对每笔指令进行风险提示。经评估，风险对冲有效性预警机制建设情况符合要求。

激励制度和机制评估：公司已建立激励制度和机制，未简单将股指期货交易盈亏与业务人员收入挂钩，后台及风险管理部门的人员报酬独立于交易盈亏情况。经评估，激励制度和机制情况符合要求。

定期监督检查情况评估：公司已建立衍生品风险管理定期核查机制，独立提交半年度和年度稽核报告。检查内容包括业务合规情况、制度执行情况、人员资质情况、避险政策及有效性评估等。经评估，定期监督检查情况符合要求。

回溯分析情况评估：公司已将股指期货每半年的买入计划与实际执行偏差回溯情况纳入半年及年度稽核审计报告，并按规定向银保监会进行报告。经评估，稽核审计报告情况符合要求。

五、自评

衍生品运用管理能力建设进行了调研评估和自我评估，经过充分论证和评估，符合监管要求。



