

光大永明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——国债期货（年度披露-20230120）

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：	程锐	职务：	总经理
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	1982-12
行政责任人学历	研究生	行政责任人学位	博士
行政责任人所在部门	公司高管	行政责任人入司时间	2014-05-01
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：	孙锐	职务：	部门总监
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	1982-04
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	2016-04-14	专业责任人所在部门	固定收益投资部
专业责任人专业资质	无，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	中级经济师

二、基本条件

整体评估情况：	公司按照《中国银保监会关于优化保险机构投资管理能力监管有关事项的通知》要求，逐条对照《保险机构衍生品运用管理能力标准——国债期货》要求，对公司衍生品运用管理能力基本条件是否符合规定进行了自评估。经评估，公司在治理结构、组织架构、衍生品交易业务操作、内部控制、风险管理制度、信息系统、衍生品交易专业管理人员等方面符合相关规定，近两年未受到监管机构重大行政处罚。经评估，符合《保险机构衍生品运用管理能力标准——国债期货》相关要求。		
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：	董事会知晓相关风险并承担参与衍生品交易的最终责任，董事会制定授权制度，建立决策机制，明确管理人员职责及报告要求。根据公司管理情况，公司将国债期货投资业务授权纳入公司投资授权体系进行管理，总经理办公会在董事会的授权下行使经营管理权限，总经理办公会下设投资决策委员会作为国债期货投资的决策机构。公司设立了投资交易、风险管理、清算核算、内部稽核等部门，不同部门间有防火墙机制并独立运作，部门间业务均严格分离，部门设置履行了发文程序，发文中明确了部门职责、岗位职责、部门负责人及人员配置等内容。经评估，符合《保险机构衍生品运用管理能力标准——国债期货》相关要求。		
投资交易部门	1		
部门名称：	交易管理部		
发文时间：	2021-12-08	文件名称（含文号）：	关于优化投资条线组织架构及部门职责的通知（光保资发〔2021〕546号）
岗位设置：	衍生品交易员		

2			
部门名称：		固定收益投资部	
发文时间：		2022-06-15	文件名称（含文号）： 关于修订固定收益投资部、多元投资部部门职责及岗位说明书的通知（光保资发〔2022〕365号）
岗位设置：		投资经理,研究员	
风险管理部			
1			
部门名称：		风险管理部	
发文时间：		2022-12-22	文件名称（含文号）： 关于调整法务合规部、风险管理部部门职责的通知（光保资发〔2022〕866号）
岗位设置：		全面风险管理岗,风险控制岗,风险监测岗	
清算核算部门			
1			
部门名称：		运营管理部	
发文时间：		2021-01-25	文件名称（含文号）： 关于印发优化调整后的部门职责、岗位说明书的通知（光保资发〔2021〕52号）
岗位设置：		投资核算岗,投资清算岗	
内部稽核部门			
1			
部门名称：		审计部	
发文时间：		2021-01-25	文件名称（含文号）： 关于印发优化调整后的部门职责、岗位说明书的通知（光保资发〔2021〕52号）
岗位设置：		审计岗	
防火墙机制：		公司在不同部门之间设立防火墙体系，实行严格的业务分离制度，投资交易、风险管理、清算核算、内部稽核等部门独立运作；设立不同部门承担衍生品运用的各个职能，研究、投资职能由固定收益投资部承担，交易职能由交易管理部承担，风险管理部负责风险管理工作，运营管理部负责清算核算，审计部负责内部稽核，不同部门业务分离，相互独立。符合《保险机构衍生品运用管理能力标准——国债期货》相关要求。	
评估结果：		符合规定	

四、专业队伍

整体评估情况：						
公司配备了国债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，其中资产配置和投资交易人员7人，清算和核算人员2人，风险控制人员3人，分析研究人员1人，审计稽核人员1人，资产配置和投资交易、清算和核算、风险控制专业人员均已通过期货从业人员资格考试。投资交易、风险控制和清算岗位人员不存在相互兼任情况。负责人员具有5年以上期货或证券从业经验，业务经理具有3年以上期货或证券业务经验。经评估，符合《保险机构衍生品运用管理能力标准——国债期货》相关要求。						
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	殷颖煜	衍生品交易员	否	期货或证券业务经验	已通过	3.53
2	王倩	投资经理	否	期货或证券业务经验	已通过	5.05
3	林斌	投资经理	否	期货或证券业务经验	已通过	12.55
4	詹一明	投资经理	否	期货或证券业务经验	已通过	10.81
5	毛维彤	投资经理	否	期货或证券业务经验	已通过	7.01
6	朱靖红	投资经理	否	期货或证券业务经验	已通过	9.08

7	孙锐	投资经理	否	期货或证券业务经验	已通过	12.31
8	张一弛	研究员	否	期货或证券业务经验	已通过	8.06
9	单敏	审计岗	否	其他	未通过	10.73
10	唐文亮	投资核算岗	否	其他	已通过	7.47
11	路媛	投资清算岗	否	其他	已通过	6.28
12	游梦羽	全面风险管理岗	否	其他	已通过	7.15
13	高善功	风险控制岗	否	其他	已通过	10.81
14	王克璋	风险控制岗	否	其他	已通过	7.14

五、投资规则与基本制度

整体评估情况：		
公司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，相关制度文件均按照公司规章制度管理规则履行审批和发文程序。经评估，符合《保险机构衍生品运用管理能力标准——国债期货》相关要求。		
衍生品交易管理制度：		
制度内容	评估结果	制度明细
风险对冲方案	符合规定	文件名称：2022年度国债期货风险对冲方案， 发文文号：无， 发文时间：2022-05-19；
与交易结算机构签署协议文件	符合规定	文件名称：光大永明资产管理股份有限公司-光大期货-光大银行期货投资托管运营备忘录， 发文文号：无， 发文时间：2022-04-02；
衍生品交易业务操作制度	符合规定	文件名称：国债期货投资管理办法， 发文文号：光保资发〔2022〕286号， 发文时间：2022-05-09； 文件名称：国债期货交易管理细则， 发文文号：光保资发〔2022〕286号， 发文时间：2022-05-09； 文件名称：国债期货风险管理细则， 发文文号：光保资发〔2022〕286号， 发文时间：2022-05-09；
内部控制制度	符合规定	文件名称：国债期货投资管理办法， 发文文号：光保资发〔2022〕286号， 发文时间：2022-05-09； 文件名称：集中交易管理办法， 发文文号：光保资发〔2021〕510号， 发文时间：2021-11-19； 文件名称：国债期货交割管理细则， 发文文号：光保资发〔2022〕286号， 发文时间：2022-05-09； 文件名称：国债期货交易管理细则， 发文文号：光保资发〔2022〕286号， 发文时间：2022-05-09； 文件名称：国债期货风险管理细则， 发文文号：光保资发〔2022〕286号， 发文时间：2022-05-09； 文件名称：内部控制办法， 发文文号：光保资发〔2017〕355号， 发文时间：2017-12-28； 文件名称：内部控制评价办法， 发文文号：光保资发〔2018〕102号， 发文时间：2018-05-03； 文件名称：市场风险管理办法， 发文文号：光保资发〔2020〕410号， 发文时间：2020-12-23； 文件名称：风险管理办法， 发文文号：光保资发〔2022〕244号， 发文时间：2022-04-22；

风险管理制度	符合规定	文件名称：国债期货投资管理办法， 发文文号：光保资发〔2022〕286号， 发文时间：2022-05-09； 文件名称：集中交易管理办法， 发文文号：光保资发〔2021〕510号， 发文时间：2021-11-19； 文件名称：国债期货系统应急预案， 发文文号：光保资发〔2022〕286号， 发文时间：2022-05-09； 文件名称：国债期货交割管理细则， 发文文号：光保资发〔2022〕286号， 发文时间：2022-05-09； 文件名称：国债期货交易管理细则， 发文文号：光保资发〔2022〕286号， 发文时间：2022-05-09； 文件名称：国债期货风险管理细则， 发文文号：光保资发〔2022〕286号， 发文时间：2022-05-09； 文件名称：内部控制办法， 发文文号：光保资发〔2017〕355号， 发文时间：2017-12-28； 文件名称：内部控制评价办法， 发文文号：光保资发〔2018〕102号， 发文时间：2018-05-03； 文件名称：市场风险管理办法， 发文文号：光保资发〔2020〕410号， 发文时间：2020-12-23； 文件名称：风险管理办法， 发文文号：光保资发〔2022〕244号， 发文时间：2022-04-22；
问责制度	符合规定	文件名称：国债期货投资管理办法， 发文文号：光保资发〔2022〕286号， 发文时间：2022-05-09； 文件名称：员工违纪处理办法， 发文文号：光保资发〔2022〕466号， 发文时间：2022-07-25； 文件名称：行政问责管理办法， 发文文号：光保资发〔2021〕195号， 发文时间：2021-04-20；

六、托管机制

整体评估情况：
公司开展国债期货投资业务，与相关资产托管机构签署协议文件，明确国债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。经评估，符合《保险机构衍生品运用管理能力标准——国债期货》相关要求。

七、系统建设

整体评估情况：			
公司开展国债期货投资业务，建立了国债期货交易的交易、会计核算和风险管理等信息系统，信息系统包括业务处理设备、交易软件和操作系统等，并通过可靠性测试。经评估，符合《保险机构衍生品运用管理能力标准——国债期货》相关要求。			
交易结算系统：			
系统名称	恒生投资交易管理系统软件V03.2		
上线时间	2012-03-02	评估结果	符合规定
主要功能	交易结算系统采用恒生投资交易管理系统软件V03.2，具备交易、清算功能，能够与合作的交易结算机构信息系统对接，并建立了相应的备份通道。系统稳定高效，且能够满足交易需求。		
投资分析系统：			
系统名称	恒生投资交易管理系统软件V03.2-国债期货套保子系统		
上线时间	2015-07-25	评估结果	符合规定

主要功能	投资分析系统采用恒生投资交易管理系统软件V03.2-国债期货套保子系统，能够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。		
资产估值和核算系统：			
系统名称	HUND SUN资产估值与会计核算系统软件V2.6		
上线时间	2012-03-02	评估结果	符合规定
主要功能	资产估值和核算系统采用HUND SUN资产估值与会计核算系统软件V2.6，会计确认、计量、账务处理及财务报告符合规定。估值系统稳定高效，且能够满足估值需求。公司对国债期货投资业务进行独立核算，托管行只对核算业务起监督作用。		
系统名称	恒生投资交易管理系统软件V03.2日终清算功能		
上线时间	2012-03-02	评估结果	符合规定
主要功能	恒生投资交易管理系统软件V03.2日终清算功能为公司配备的国债期货清算模块，满足国债期货清算要求。		
风险管理信息系统：			
系统名称	HUND SUN投资绩效评估与风险管理系统软件V3.0		
上线时间	2012-03-02	评估结果	符合规定
主要功能	风险管理信息系统采用HUND SUN投资绩效评估与风险管理系统软件V3.0，能够实现国债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：	
公司开展国债期货投资业务，构建了完善的风险管理体系，包括动态风险管理机制、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。经评估，符合《保险机构衍生品运用管理能力标准——国债期货》相关要求。	
动态风险管理机制评估：	公司建立了动态风险管理机制，制定了国债期货交易的全面风险管理制度与业务操作流程，建立了实时监测、评估与处置风险的信息系统，完善了应急机制和管理预案。公司制定《风险管理办法》（光保资发〔2022〕244号），为公司风险管理总体办法，公司各项业务开展均需遵循该制度规范。公司制定《市场风险管理办法》（光保资发〔2020〕410号），对市场风险的识别、计量、监控、报告、压力测试、重大或突发市场风险应急管理进行了具体要求。《国债期货投资管理办法》（光保资发〔2022〕286号）明确国债期货投资业务风险纳入全面风险管理体系进行管理，《国债期货风险管理细则》（光保资发〔2022〕286号）对国债期货投资业务的风险识别、风险评估、控制实施、监督反馈、风险报告、危机处理机制和方案等进行了详尽规定。HUND SUN投资绩效评估与风险管理系统软件V3.0为公司风险管理系统，能够实现国债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。公司制定了规范、全面的国债期货业务操作流程制度，《国债期货投资管理办法》（光保资发〔2022〕286号）、《国债期货风险管理细则》（光保资发〔2022〕286号）和《国债期货交易管理细则》（光保资发〔2022〕286号）对国债期货投资业务的投资研究、决策体系、授权管理、投资交易执行、风险监测与流程控制、资金划拨、清算核算、应急处置等全过程做了详尽规范。《国债期货交割管理细则》（光保资发〔2022〕286号）明确“公司对国债期货交割业务实行集中管理，统一组织国债期货交割业务的开展与实施，建立以投资决策委员会为核心，固定收益投资部、交易管理部、风险管理部、运营管理部以及信息技术部等前中后台部门相互分离、相互制约、协调配合的组织体系”。《国债期货系统应急预案》（光保资发〔2022〕286号）明确了国债期货系统应急的管理架构与职责、应急流程等。
风险对冲有效性预警机制评估：	公司制定了风险对冲有效性预警机制，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，及时根据市场变化对交易做出风险预警。《国债期货风险管理细则》（光保资发〔2022〕286号）规定，风险管理部拟定国债期货投资相关风险管理制度及风险管理政策；识别、评估国债期货投资业务相关风险，实施风险限额管理，会同业务部门研究风险控制指标，按照公司相关要求监测、分析和报告风险限额实施情况；协调投资、交易、信息技术等相关部门，确保风险管理系统能够实现对国债期货的实时监控，各项风险管理指标固化在系统中，并能够及时预警；对固定收益投资部拟定的风险对冲方案进行有效性评估；按照规划不定期对国债期货投资业务进行检查，监督关键指标，及时发现问题并督促改进；对国债期货投资业务存续期间发生异常、重大或突发等风险事件时，协助业务发起部门及时采取有效措施。
激励制度和机制评估：	公司制定了有效的激励制度和机制，国债期货交易盈亏与业务人员收入不挂钩，后台及风险管理部门的人员报酬独立于交易盈亏情况。激励制度和机制符合规定。《国债期货投资管理办法》（光保资发〔2022〕286号）规定“不得简单将衍生品交易盈亏与业务人员的收入挂钩”。公司制定《绩效考核管理办法》（光保资发〔2023〕1号）明确中后台部门突出服务满意度指标，坚持价值导向、长期激励原则。

定期监督检查情况评估：	公司制定《国债期货投资管理办法》（光保资发〔2022〕286号）规定“审计部负责对公司国债期货业务的合规性、真实性、效率和效果，以及内部控制的健全性和有效性等进行独立审计；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”。具体检查内容包括但不限于业务合规情况、制度执行情况、人员资质情况、避险政策及有效性评估等。
回溯分析情况评估：	半年及年度稽核审计报告纳入每半年的买入计划与实际执行偏差回溯情况，并按规定向银保监会进行报告。《国债期货投资管理办法》（光保资发〔2022〕286号）规定“审计部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”。

九、自评估结果及承诺

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，我达到了该项能力的基本要求，现按规定披露相关信息。

我承诺对本公告披露的及时性、内容的真实性、完整性负责。