

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—股指期货（年度披露-20240125）

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：    | 潘静             | 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    | 1982-11    |
| 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 | 2017-08-21     | 专业责任人所在部门    | 多元投资部      |
| 专业责任人专业资质 | 特许金融分析师（CFA）   | 专业责任人专业技术职务  | 无          |

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——股指期货》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——股指期货》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，公司将股指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股指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》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：  | 多元投资部                                                                                                                                                                                    |            |                                                |
| 发文时间：  | 2022-06-14                                                                                                                                                                               | 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：  | 投资经理岗,研究员岗                                                                                                                                                                               |            |                                                |
| 3      |                                                                                                                                                                                          |            |                                                |
| 部门名称：  | 资产配置及另类投资部                                                                                                                                                                               |            |                                                |
| 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：  | 账户经理岗                                                                                                                                                                                    |            |                                                |
| 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、投资职能由权益投资部承担，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——股指期货》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，其中资产配置和投资交易专业人员5人，清算和核算专业人员2人，风险控制专业人员3人，分析研究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——股指期货》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  | 梁宇宸 | 风险监测岗   | 否 | 其他        | 已通过 | 0.47  |
| 2  | 李梦鹏 | 衍生品交易员  | 否 | 期货或证券业务经验 | 已通过 | 6.80  |
| 3  | 张阳  | 衍生品交易员  | 否 | 期货或证券业务经验 | 已通过 | 10.55 |
| 4  | 林思  | 投资经理岗   | 否 | 期货或证券业务经验 | 已通过 | 12.48 |
| 5  | 黄健奇 | 研究员岗    | 否 | 期货或证券业务经验 | 未通过 | 6.19  |
| 6  | 单敏  | 审计岗     | 否 | 其他        | 未通过 | 11.72 |
| 7  | 杨钊  | 账户经理岗   | 否 | 期货或证券业务经验 | 已通过 | 3.71  |
| 8  | 闫小琴 | 账户经理岗   | 否 | 期货或证券业务经验 | 已通过 | 10.54 |
| 9  | 唐文亮 | 投资核算岗   | 否 | 其他        | 已通过 | 8.46  |
| 10 | 路媛  | 投资清算岗   | 否 | 其他        | 已通过 | 7.27  |
| 11 | 游梦羽 | 全面风险管理岗 | 否 | 其他        | 已通过 | 8.13  |
| 12 | 王克璋 | 风险控制岗   | 否 | 其他        | 已通过 | 8.13  |

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》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                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 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-兴业银行股份有限公司-股指期货操作备忘录，<br>发文文号：无，<br>发文时间：2020-03-31；<br>文件名称：光大永明资产管理股份有限公司-中国建设银行股份有限公司-股指期货操作备忘录，<br>发文文号：无，<br>发文时间：2020-03-31；                                                                                                 |
| 衍生品交易业务操作制度                                                                                                             | 符合规定 | 文件名称：股指期货投资管理办法，<br>发文文号：光保资发〔2022〕652号，<br>发文时间：2022-09-28；<br>文件名称：股指期货交易操作规程，<br>发文文号：光保资发〔2023〕194号，<br>发文时间：2023-03-23；                                                                                                                           |
| 内部控制制度                                                                                                                  | 符合规定 | 文件名称：市场风险管理办法，<br>发文文号：光保资发〔2020〕410号，<br>发文时间：2020-12-23；<br>文件名称：股指期货投资管理办法，<br>发文文号：光保资发〔2022〕652号，<br>发文时间：2022-09-28；<br>文件名称：股指期货交易操作规程，<br>发文文号：光保资发〔2023〕194号，<br>发文时间：2023-03-23；<br>文件名称：风险管理办法，<br>发文文号：光保资发〔2023〕472号，<br>发文时间：2023-08-04； |
| 风险管理制度                                                                                                                  | 符合规定 | 文件名称：市场风险管理办法，<br>发文文号：光保资发〔2020〕410号，<br>发文时间：2020-12-23；<br>文件名称：股指期货投资管理办法，<br>发文文号：光保资发〔2022〕652号，<br>发文时间：2022-09-28；<br>文件名称：股指期货交易操作规程，<br>发文文号：光保资发〔2023〕194号，<br>发文时间：2023-03-23；<br>文件名称：风险管理办法，<br>发文文号：光保资发〔2023〕472号，<br>发文时间：2023-08-04； |

|        |      |                                                                                                                                                                                                                                                              |
|--------|------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 问责制度   | 符合规定 | 文件名称：行政问责管理办法，<br>发文文号：光保资发〔2021〕195号，<br>发文时间：2021-04-20；<br>文件名称：员工违纪处理办法，<br>发文文号：光保资发〔2022〕466号，<br>发文时间：2022-07-25；<br>文件名称：员工违反劳动纪律处罚管理办法，<br>发文文号：光保资发〔2017〕122号，<br>发文时间：2017-05-02；<br>文件名称：股指期货投资管理办法，<br>发文文号：光保资发〔2022〕652号，<br>发文时间：2022-09-28； |
| 风险对冲方案 | 符合规定 | 文件名称：聚宝7号股指期货投资策略，<br>发文文号：无，<br>发文时间：2021-03-29；<br>文件名称：聚财121号期货对冲方案，<br>发文文号：无，<br>发文时间：2020-08-31；<br>文件名称：聚宝6号期货对冲方案，<br>发文文号：无，<br>发文时间：2020-07-31；                                                                                                    |

## 六、托管机制

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

## 七、系统建设

|                                                                                                          |                                                                                              |      |      |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------|------|------|
| 整体评估情况：                                                                                                  |                                                                                              |      |      |
| 公司开展股指期货投资业务，建立了股指期货交易的投资交易、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》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-股指期货套保子系统                                                                  |      |      |
| 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-股指期货套保子系统，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，公司对股指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股指期货清算模块，满足股指期货清算要求。                                            |      |      |
| 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。 |
|------|-------------------------------------------------------------------------------|

八、风险管理

|                                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 整体评估情况：                                                                                         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 公司开展股指期货投资业务，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》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，制定了股指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〔2023〕472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。《股指期货投资管理办法》（光保资发〔2022〕652号）明确股指期货投资业务风险纳入全面风险管理体系进行管理，对股指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信息系统软件V3.0为公司风险管理系统，能够实现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。公司制定了规范、全面的股指期货业务操作流程制度，《股指期货投资管理办法》（光保资发〔2022〕652号）和《股指期货交易操作规程》（光保资发〔2023〕194号）对股指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。《股指期货投资管理办法》（光保资发〔2022〕652号）明确了股指期货投资各相关部门及岗位职责，实现了部门及关键岗位的分离和相互制衡。 |
| 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。《股指期货投资管理办法》（光保资发〔2022〕652号）规定，风险管理部设计股指期货投资的量化风险控制指标体系，定期或不定期对股指期货投资组合及其对应资产组合的风险状况进行评估；对股指期货指标进行系统设置、对股指期货交易进行监控，及时提示风险；制定与业务相适应并符合监管要求的风险控制指标与方案，定期审查限额，并对限额情况制定监控和处理程序；监控基差、套保比例、保证金等相应指标及时发出预警，根据套期保值比率变化，适时调整期货合约头寸；风险管理部对股指期货投资的风险限额、风控指标进行监控，发现异常及时向相关部门发出风险提示或暂停交易。                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 激励制度和机制评估：                                                                                      | 公司制定了有效的激励制度和机制，股指期货交易盈亏与业务人员收入不挂钩，后台及风险管理部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。公司制定《绩效考核管理办法》（光保资发〔2023〕1号），明确了价值导向、长期激励的绩效考核原则，避免因短期利益牺牲公司长期稳健的发展，同时要求绩效考核工作应当即注重工作结果也关注工作过程。公司每年度确定各部门绩效合同及绩效考核方案，合理设定考核指标与分值，全面准确、实事求是地反映工作完成情况，而非简单将交易盈亏与业务人员收入挂钩，中后台部门则突出服务满意度指标，独立于交易盈亏情况。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 定期监督检查情况评估：                                                                                     | 公司定期监督检查情况符合规定。公司审计部建立了衍生品风险管理定期核查机制，定期对股指期货投资管理执行情况进行专项审计，审计范围涵盖股指期货业务开展的合规情况、相关制度执行情况、专业人员资质情况和避险政策及其有效性评估等。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 回溯分析情况评估：                                                                                       | 公司股指期货投资管理定期专项审计的审计内容包括半年度买入计划与实际执行偏差的回溯情况，审计结论纳入公司半年度及年度股指期货投资管理专项审计报告，并按规定向银保监会报告。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |

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。