

# 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
行政责任人类别：	拟任高级管理人员	是否履行完备的授权程序	是

第 25 页  
委员会、及部内  
衍生品报告之稽  
审议通过。立部  
管理，指公防门  
（董事火墙体运  
指期货已设体运  
期货业务立系作  
）相关负责实施  
组织决策指严下  
架构并及格的《  
符合承担审批交  
监管参与署投岗  
要衍相资位和产  
求。品文易人管  
公交件。员分有  
司开的风限公  
展最司管制公  
股最终制度，部  
指定了清部门  
期货，授核算保  
业董决核资责  
务董决算、交  
已事会策、交  
过授度，稽风  
三公明核险正  
届司确等管文  
董投了部理、  
事资管门、清  
会决理；算前  
策人已在核  
第 25 页

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 and 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

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，能够对股指期货主要功能进行实时监控，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《中国人寿资产管理股份有限公司股指期货风险管理办法》和《中国人寿资产管理股份有限公司风险管理总则》，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，独立出具半年度和年度稽核报告；每半年回溯买入计划与实际执行的偏差，纳入每半年及年度稽核报告，并按规定向银保监会报告。

公司建立了动态风险管理机制，通过《中国人寿资产管理股份有限公司股指期货投资管理办法》《中国人寿资产管理股份有限公司股指期货风险管理办法》等制度明确了全行股指期货业务风险管理制

动态风险管理机制评估：

公司风险对冲方案中规定了风险敞口、持仓期限、保证金管理、对冲比例及有效

风险对冲有效性预警

## 结论及承诺

关于优化保险机构投资风险管理能力监管有关事项的承诺

## 九、其他

根据《

