

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：	拟任总经理	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
审议层要间核
用通过对股等
管理、指公防
（董事司火墙
指期货已体运
期货业务立作
）相关负责通
组织决策指下
架构并以格发
符合承担交易
监管参签的、人
要衍相资位资
求。品文易人管
公交件。员理
司易。风分有
展最司管制公
指责定、清确部
期货了授保保
业董权核核投
务董决算、交
已事策、交定
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、设
会决理；清算
策理人；已算
决人前

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

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，能够对股指期货期
 主要功能：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，并能及时的预警，符合
 规定要求。

风险管理

八、

评估情况：

整体
公司

制定印发了《中国太平洋资产管理有限责任公司股指期货业务管理办法》



