



一、风险

风险责任人
行政责任人
行政责任人
行政责任人
行政责任人
行政责任人
行政责任人
专业责任人
专业责任人
专业责任人
专业责任人
专业责任人
专业责任人

型：
别
历
在
部
资
型：
制
度
反
司
时
资

二、基本条

整体评估情	公司管理、责	受托公司(后	参与公司(后
-------	--------	--------	--------

件：
国
程
理
行
，
确
人
互
守
统
统
托
包
常
期
约
度
国
世
资
产
，
处
用
的
，
方
《
制
》
对
，
寿
制
则
行
，
相
方
经
是

行政处罚情况
受托情况：

三、组织架

整体评估情

构

易，中货程理点中办场，勿言，
交易，《期流管重《分市业公面，
交础系《期流管重《分市业公面，
货基体信和信业务产、处用的，方
期约度》国世资产》的采迎面管

公司衍生品运用管理（国
 次会议审议通过，董
 期货业务进行决策以
 司已设立负责国债期
 火墙体系，实行严格
 独立运作；通过下
 配置等。

投资交易部门

1

部门名称：

发文时间：

岗位设置：

2

部门名称：

发文时间：

岗位设置：

风险管理部

1

部门名称：

发文时间：

岗位设置：

清算核算部

1

部门名称：

发文时间：

岗位设置：

内部稽核部

1

部门名称：

发文时间：

岗位设置：

四、专业队伍

整体评估情况：

公司已配备国债期货交易
 。其中，资产配置和投资
 于2人，均已通过期货从业
 员具有5年以上期货或证券

专业队伍人员基本信息：

序号	姓名
1	刘子豪
2	汪青川
3	孙琪

4
5
6
7
8
9
10
11
12

五、投资

整体评估	公司建立了内部控制制度，并严格执行。公司明确了内部控制《中国分办法》通过，明确
衍生品交易	衍生品交易
制度内容	衍生品交易
风险对冲	衍生品交易
衍生品交易	衍生品交易
内部控制	衍生品交易
问责制度	衍生品交易
风险管理制度	衍生品交易
与交易结算文件	衍生品交易

六、并

整体评
委托人
委托司
托管管
机

七、系

整体评
司建
公理系
进行统
进可资
可靠性

交易结
系统名

上线时

主要功

投资分

系统名
上线时

主要功

主要功

资产估

系统名
上线时

主要功

系统名

上线时

主要功

风险管

系统名
上线时

主要功

主要功

八、风

整体评
司制
公司风
公程，建
，动了态
，定有
，立
，独于
，度核
，会报

动态风险管理机

风险对冲有效性
评估:

激励制度和机制

定期监督检查情

回溯分析情况评

九、自评估结:

根据《关于
衍生品运用管理
要求, 现按规定
我公司承诺

