

公司衍生品运用管理（国
会议审议通过，董以事
期货业务进行决策及交
司已设立负责国债期
火墙体系，实行严格业
配置等；通过下正式

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

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
 执行。公司
 有限公司。公
 了明确规
 内部控制
 《中国人
 分办法》
 通过。公
 项，明确
 衍生品交
 制度内容

风险对冲

衍生品交易

内部控制制

问责制度

风险管理制

与交易结算
 文件

六、 并

整体评
委托人
委托司
公托管
托管机

七、 系

整体评
司建
公理系
进行统
进可资
可性
交易结
系统名
上线时
主要功
投资分
系统名
上线时

主要功

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

八、 反

整体评
司制
公司风
公程，建
，动了态
，定有于
，独立核
度稽告
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

