

# 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—国债期货（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：	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	1971-07
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	高级管理人员	行政责任人入司时间	2004-09-01
行政责任人专业资质	相关领域10年以上从业经历	行政责任人专业技术职务	高级经济师
专业责任人：	肖凤群	职务：	固定收益投资部总经理
专业责任人类别：	授权的相关资产管理部负责人	是否履行完备的授权程序：	是
专业责任人性别	女	专业责任人出生年月	1977-07
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	2006-01-01	专业责任人所在部门	固定收益投资部
专业责任人专业资质	相关领域10年以上从业经历	专业责任人专业技术职务	无

## 二、基本条件

整体评估情况：
公司受托参与国债期货交易，形成了在股东会领导下，董事会、监事会和管理层分权制衡的公司治理结构，以《公司章程》为基础，涵盖“三会一层”议事规则、专门委员会议事规则、派出董事与监事管理办法等内容的公司治理制度体系，公司治理结构良好。公司制定印发了《中国人寿资产管理有限公司国债期货投资管理办法（试行）》和《中国人寿资产管理有限公司国债期货风险管理办法（试行）》，覆盖国债期货交易

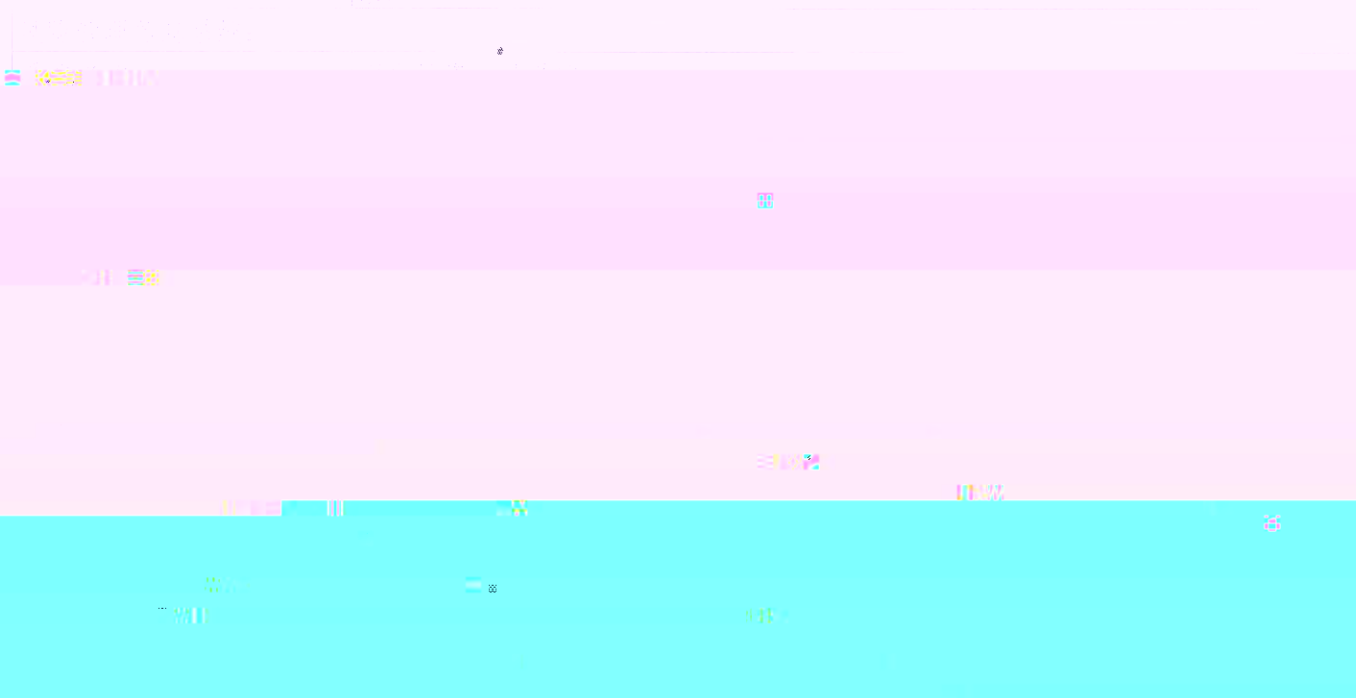


公司已配备国债期货交易专业管理人员，包括分析研究、投资交易、财务处理、风险控制和审计稽核等人员

文件名称：中国人寿资产管理有限公司员工违规行为  
处理办法，  
发文文号：国寿资发〔2021〕548号，

主要功能

HiPortfolio估值核算系统配备了国债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



动态风险管理预警机制建设情况符合规定要求。

公司风险对冲有效性预警机制建设情况符合规定要求。公司风险对冲有效性预警机制建设情况符合规定要求。公司风险对冲有效性预警机制建设情况符合规定要求。

及年度稽核  
情况符合要求

公司将国债期货每半年的买入计划与实际执行偏差回溯情况纳入半年度稽核报告，并按规定将稽核报告报告。经评估，稽核审计报告

## 九、自评估结果及承诺

根据《证券公司风险管理指引》及《证券公司风险管理指引》的相关规定，



