

# 中国工商银行

中国工商银行



中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行



中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

中国工商银行

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  
独立运作；通过下正式  
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：

风险管理部门

1

部门名称：

发文时间：

岗位设置：

清算核算部门

1

部门名称：

发文时间：

岗位设置：

内部稽核部门

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  
 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  
 易制度内  
 容

风险对冲

衍生品交易

内部控制卷

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  
可进资  
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

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，现按规知  
我公司承诺

