

# 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，符合规定要求。		
风险管理信息系统：			
系统名称	国债期货交易系统		
上线时间	2015-06-23	评估结果	符合规定
主要功能	公司通过HiW投资交易系统实现对国债期货交易的实时监控，各项风险管理指标固化在系统中，并能够及时预警，符合规定要求。		

## 四、风险管理

### 整体评估情况：

公司制定印发了《中国人寿资产管理有限公司国债期货风险管理办法（试行）》和《中国人寿资产管理有限公司国债期货业务管理办法》，建立了动态风险管理机制，包括制定国债期货交易的全面风险管理制度与业务操作流程，建立实时监测、评估与外置风险的信息系统，完善应急处置预案；根据公司及资产组合实际情况动态监测相关风险控制指标，制定风险对冲有效性预警机制，及时根据市场波动及时调整。制定了有效的激励制度和机制，关简单将国债期货交易盈亏与业务人员收入挂钩，与台及风险管理部的人员报酬独立于交易盈亏情况；内部审计部门定期对衍生品交易的风险管理情况进行监督检查，独立提交半年度和年度稽核报告。



