

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
行政责任人类型：	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
专业责任人类型：	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：
<p>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</p>

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，

八、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风险管理办法》，建立了动态风

险管理机制，包括制定国债期货化险目的和全面风险管理制度等业务操作流
程，制定并严格执行风险管理考核办法，明确风险管理有效性预警机制，及时根据市场动态作出风险预警控制，并
定了有效的激励制度和机制，未简单将国债期货交易盈亏与业务人员收入挂钩，后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，与当年早调汇兑计划盈亏共同执行的偏差，由业务人员及年度稽核报告，并按规定
报监管报告。经评估，风险管理体系建设情况符合要求。

动态风险管理机制评估：

公司《国债期货投资管理暂行办法》、《国债期货风险管理办法（试行）》
制度书明确了全面的国债期货交易风险管理制度和业务操作流程、信息
危机机制和管理制度等内容，信息系统能够及时监测、评估并处理风险



