



发  
岗  
清  
1  
部

发  
岗  
内  
1  
部

发  
岗

四

整  
公  
。子  
员  
专

序

- 1
- 2
- 3
- 4
- 5
- 6
- 7
- 8
- 9
- 10
- 11
- 12

五

整  
公  
司  
规  
管  
资  
责  
国  
衍

制度内容	评估结果
风险管理制度	符合规定
风险对冲方案	符合规定
问责制度	符合规定
衍生品交易业务操作制度	符合规定
内部控制制度	符合规定
与交易结算机构签署协议文件	符合规定

## 六、托管机制

### 整体评估情况：

委托人已与中国农业银行股份有限公司签署托管协议，公司签订了期货投资三方协议备忘录，确定了国债期货托管机构、期货经纪公司三方各自的权利和义务。

## 七、系统建设

### 整体评估情况：

公司国债期货业务在投资交易、会计核算、风险管理生投资交易系统V03.2进行国债期货的投资分析进行资产估值核算，包括相应的业务处理设备、交易可靠性测试，符合要求。

### 交易结算系统：

系统名称	恒生投资交易系统
上线时间	2015-06-23
主要功能	公司通过恒生投资交易系统对应的备份通道。国债期货

### 投资分析系统：

系统名称	恒生投资交易系统-国债
上线时间	2020-03-02
主要功能	系统自带组合管理功能，系统自带组合管理功能，保证了账户安全。

### 资产估值和核算系统：

系上主网系上主

整公百等

动

风评

澎

定

巨

力

系

打