

香港交易及結算所有限公司及香港聯合交易所有限公司對本公告之內容概不負責，對其準確性或完整性亦不發表任何聲明，並明確表示概不對因本公告全部或任何部份內容而產生或因倚賴該等內容而引致之任何損失承擔任何責任。



**國泰君安證券股份有限公司**  
**Guotai Junan Securities Co., Ltd.**

(於中華人民共和國註冊成立的股份有限公司)

(股份代號：02611)

**海外監管公告**

本公告乃由國泰君安證券股份有限公司（「本公司」）根據香港聯合交易所有限公司證券上市規則第13.10B條作出。

茲載列本公司於上海證券交易所網站發佈之《國泰君安證券股份有限公司關於公司開展信用衍生品業務獲得中國證券監督管理委員會無異議函的公告》，僅供參閱。

承董事會命  
國泰君安證券股份有限公司  
楊德紅  
董事長

中國上海

2018年11月2日

截至本公告日期，本公司執行董事為楊德紅先生、王松先生及喻健先生；本公司非執行董事為傅帆先生、劉櫻女士、鐘茂軍先生、周磊先生、王勇健先生、林發成先生及周浩先生；以及本公司獨立非執行董事為夏大慰先生、施德容先生、陳國綱先生、凌濤先生、靳慶軍先生及李港衛先生。

证券代码：601211

证券简称：国泰君安

公告编号：2018-074

# **国泰君安证券股份有限公司**

## **关于公司开展信用衍生品业务获得中国证券监督管理委员会无异议函的公告**

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

近日，国泰君安证券股份有限公司（以下简称“公司”）收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于国泰君安证券开展信用衍生品业务的无异议函》（机构部函[2018]2545号）。

根据该复函，中国证监会对公司开展银行间市场信用风险缓释工具、交易所市场信用风险缓释工具以及监管认可的其他信用衍生品业务无异议。

复函同时要求，公司开展信用衍生品业务，应当以服务实体经济为目标，合规、审慎开展业务，将相关业务纳入全面风险管理体系，建立健全覆盖各业务环节的内部管理制度，强化客户适当性管理；公司开展信用衍生品业务，应当严格计算各项风险控制指标，并按规定填报监管报表。上述指标包括但不限于：一是买入信用衍生品按照账面价值的100%计算市场风险资本准备，卖出信用衍生品按照合约的名义价值总额的20%计算市场风险资本准备。二是按照业务净收入的18%计算操作风险准备。三是卖出信用衍生品按合约名义价值总额的100%计算表外项目余额。

公司将严格按照复函要求，立足于服务实体经济合规、审慎开展业务，严格计算各项风险控制指标，切实防范业务风险；并严格按照中国证券业协会发布的有关场外业务备案管理的相关要求履行备案和信息报送义务。

特此公告。

国泰君安证券股份有限公司董事会

2018年11月2日