

期货风险管理公司衍生品交易业务 过渡期相关安排

一、设置过渡期 36 个月

1. 过渡期内，在期货公司取得衍生品交易业务牌照之前，其下设已在协会备案衍生品交易业务的风险管理公司可以继续展业。

2. 过渡期内，在期货公司取得牌照并完成业务调整后，其下设的风险管理公司不得再新增交易。

3. 过渡期结束后，对于未取得牌照的期货公司，其下设的风险管理公司应当在 12 个月内了结存续业务，不得新增交易。

二、关于过渡期的监管安排

证监会及其派出机构对期货公司从事衍生品交易业务进行行政监管；协会对风险管理公司进行自律管理。过渡期内，在证监会期货部指导下，派出机构和协会将通过联合检查、定期会议或信息通报等具体方式，对期货公司和风险管理公司从事衍生品交易业务出现的违法违规行为，保持监管力度一致，防止监管套利。

三、关于业务调整的工作安排

1. 期货公司衍生品交易业务牌照的申请流程相关事项，见证监会有关规定。

2. 期货公司与其下设风险管理公司之间的衍生品交易主协

议、交易确认书等业务合同（含存续交易）变更转移相关事项，由公司与客户协商办理。

3. 期货公司与其下设风险管理公司之间的“保险+期货”项目变更转移事项，由公司与保险公司协商办理。

4. 期货公司开立衍生品交易业务对冲账户相关事项，由中国证券登记结算和中国期货市场监控中心另行通知。

5. 期货公司与其下设风险管理公司之间的衍生品交易业务对冲账户持仓迁移相关事项，按上交所、深交所、上期所、郑商所、大商所、中金所、广期所、中国证券登记结算和中国期货市场监控中心相关安排办理。

6. 在上述安排明确的基础上，各公司应当制定完善可行的衍生品交易业务调整方案，统筹考虑风险隔离、场地、设备、系统、人员变动及考核等因素，做好承接衍生品交易业务相关协议签署，妥善处理存量业务，实现业务平稳过渡。

四、关于风险监管指标的计算

1. 期货公司应当提前评估业务调整对风险监管指标的影响，自过渡期开始，模拟计算纳入其下设风险管理公司衍生品交易业务风险的监管指标。在取得衍生品交易业务牌照并完成业务调整后，应当计提衍生品交易业务风险资本准备，并按照要求填报月度、年度监管报表。具体要求由中国期货市场监控中心另行通知。

2. 在业务调整完成前，风险管理公司应当继续按照协会发布的《期货风险管理公司风险控制指标管理办法（试行）》规定，

计提衍生品交易业务风险资本准备。

附件：衍生品交易业务过渡期内工作流程图