期货公司金融期货结算业务管理暂行办法(草案)

关于公开征求《期货公司金融期货结算业务管理暂行办法》等规章意见的通知

根据《期货交易管理条例》,我会草拟了《期货公司金融期货结算业务管理暂行办法》、《期货公司风险监管指标管理暂行办法》和《证券公司为期货公司提供中间介绍业务管理暂行办法》,现公开征求意见。

请将意见或者建议以电子邮件或者传真的形式于 2007 年 4 月 12 日之前反馈我会。

感谢对我会工作的支持。

电子邮件 cuinan@csrc.gov.cn

传 真:010-88061111

中国证券监督管理委员会

2007 年 4 月 6 日

第一章 总则

第一条 为了规范期货公司金融期货结算业务,维护期货市场秩序,防范风险,根据《期货交易管理条例》,制定本办法。

第二条 期货公司金融期货结算业务是指,期货公司担任实行会员分级结算制度的金融期货交易所(以下简称期货交易所)的结算会员,依据本办法规定从事的相关业务活动。

第三条 期货公司从事金融期货结算业务,应当经中国证券监督管理委员会(以下简称中国证监会)批准,取得金融期货结算业务资格。

第四条 期货公司从事金融期货结算业务,应当遵守本办法的规定。

第五条 中国证监会及其派出机构依法对期货公司从事金融期货业务进行监督管理。

中国期货业协会和期货交易所依法对期货公司的金融期货业务活动进行自律管理。

第二章 资格的取得与终止

第六条 期货公司金融期货结算业务资格分为交易结算业务资格和全面结算业务资格。

第七条 期货公司申请金融期货结算业务资格,应当具备下列基本条件:

(一)取得金融期货经纪业务资格;

(二)具有从事金融期货结算业务的详细计划,包括部门设置、人员配置、岗位责任、金融期货结算业务管理制度和风险管理制度等;

(三)结算和风险管理部门或者岗位负责人具有担任期货公司交易、结算或者风险管理部门或者岗位负责人 2 年以上经历;

(四)具有满足金融期货结算业务需要的期货从业人员;

(五)高级管理人员近 2 年内未受过刑事处罚,未因违法违规经营受过行政处罚,无不良信用记录,且不存在因涉嫌违法违规经营正在被有权机关调查的情形;

(六)不存在被中国证监会及其派出机构采取《期货交易管理条例》第五十九条第二款、第六十条规定的监管措施的情形;

(七)不存在因涉嫌违法违规经营正在被行政、司法机关立案调查的情形;

(八)近 3 年内未因违法违规经营受过刑事处罚或者行政处罚。但期货公司控股股东或者实际控制人变更,高级管理人员变更比例超过 50%,对出现上述情形负有责任的高级管理人员和业务负责人已不在公司任职,且已整改完成并经住所地中国证监会派出机构验收合格的,可不受此限制;

(九)近 3 年内未出现严重的期货交易、结算风险事件。但期货公司控股股东或者实际控制人变更,高级管理人员变更比例超过 50%,对出现上述情形负有责任的高级管理人员和业务负责人已不在公司任职,且已整改完成并经住所地中国证监会派出机构验收合格的,可不受此限制;

(十)控股股东和实际控制人持续经营 2 个以上完整的会计年度;控股股东或者实际控制人为金融机构,在最近 2 年成立或者重组的,应当自成立或者重组完成之日起持续经营;

(十一)控股股东和实际控制人近 2 年内未受过刑事处罚,未因违法违规经营受过行政处罚,且不存在因涉嫌违法违规经营正在被有权机关立案调查的情形。

第八条 期货公司申请金融期货交易结算业务资格,除应当具备本办法第七条规定的基本条件外,还应当具备下列条件:

(一)董事长、总经理和副总经理中,至少 2 人的期货或者证券从业时间在 5 年以上,其中至少 1 人期货从业时间在 5 年以上且具有期货从业人员资格,连续任期货公司董事长或者高级管理人员时间在 3 年以上;

(二)注册资本不低于 5000 万元,申请日前 2 个月风险监管指标持续符合具有交易结算业务资格的期货公司应具备的标准;

(三)申请日前 3 个会计年度中,至少 1 年盈利且每季度末客户权益总额平均不低于 8000 万元,且控股股东期末净资产不低于 2 亿元;或者控股股东期末净资本不低于 5 亿元,控股股东不适用净资本或者类似指标的,净资产应当不低于 8 亿元;

(四)中国证监会根据审慎监管原则规定的其他条件。

第九条 期货公司申请金融期货全面结算业务资格,除应当具备本办法第七条规定的基本条件外,还应当具备下列条件:

(一)董事长、总经理和副总经理中,至少 3 人的期货或者证券从业时间在 5 年以上,其中至少 2 人期货从业时间在 5 年以上且具有期货从业人员资格,连续任期货公司董事长或者高级管理人员时间在 3 年以上;

(二)注册资本不低于 1 亿元,申请日前 2 个月风险监管指标持续符合具有全面结算业务资格的期货公司应具备的标准;

(三)申请日前 3 个会计年度连续盈利、每季度末客户权益总额平均不低于 3 亿元,且控股股东期末净资产不低于 10 亿元;或者申请日前 3 个会计年度中,至少 2 年盈利且每季度末客户权益总额平均不低于 1 亿元,且控股股东期末净资本不低于 10 亿元,控股股东不适用净资本或者类似指标的,净资产应当不低于 15 亿元;

(四)中国证监会根据审慎监管原则规定的其他条件。

第十条 期货公司申请金融期货结算业务资格,应当向中国证监会提交下列申请材料:

(一)金融期货结算业务资格申请书;

(二)加盖公司公章的营业执照复印件和金融期货经纪业务资格证明文件;

(三)股东会或者董事会关于期货公司申请金融期货结算业务资格的决议文件;

(四)从事金融期货结算业务的计划书;

(五)《高级管理人员情况表》、《主要部门负责人情况表》和《从业人员情况表》;

(六)申请日前 2 个月月末的期货公司风险监管报表,且公司应当书面保证其申请日前 2 个月风险监管指标持续符合规定的标准;

(七)经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计的前 3 个会计年度财务报告;申请日在下半年的,还应当提供经审计的半年度财务报告;

(八)申请日前 3 个会计年度每季度末客户权益总额情况表;

(九)控股股东的经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计的最近一期的财务报告;

(十)律师事务所就期货公司是否符合本办法第七条第(五)项、第(七)项至第(十一)项规定的条件,以及股东会或者董事会决议是否合法出具的法律意见书;

(十一)若存在本办法第七条第(八)项或者第(九)项规定的情形的,还应提供住所地中国证监会派出机构出具的整改验收合格的专项意见书;

(十二)中国证监会规定的其他材料。

第十一条 中国证监会在受理金融期货结算业务资格申请之日起 3 个月内,作出批准或者不批准的决定。

第十二条 期货公司取得金融期货结算业务资格后,应当向期货交易所申请相应结算会员资格。

期货公司取得金融期货结算业务资格之日起 6 个月内,未取得期货交易所结算会员资格的,金融期货结算业务资格自动失效。

第十三条 只取得金融期货经纪业务资格的期货公司,可以向期货交易所申请成为非结算会员。

第十四条 取得金融期货结算业务资格的期货公司在终止金融期货结算业务前,应当结清相关期货业务,并依法返还客户的保证金和其他资产。受托为非结算会员结算的,还应当返还非结算会员的保证金和其他资产。

第三章 业务规则

第十五条 取得交易结算会员资格的期货公司(以下简称交易结算会员期货公司)可以受托为客户办理金融期货结算业务,不得接受非结算会员的委托为其办理金融期货结算业务。

第十六条 取得全面结算会员资格的期货公司(以下简称全面结算会员期货公司),可以受托为客户以及非结算会员办理金融期货结算业务。

第十七条 全面结算会员期货公司为非结算会员结算,应当签订结算协议。结算协议应当包括下列内容:

(一)交易指令下达方式及审查或验证措施;

(二)保证金标准;

(三)风险管理措施、条件及程序;

(四)结算流程;

(五)通知事项、方式及时限;

(六)不可归责于协议双方当事人所造成损失的情形及其处理方式;

(七)协议变更和解除;

(八)违约责任;

(九)争议处理方式;

(十)双方约定的且不违反法律、行政法规规定的其他事项。

第十八条 非结算会员的客户申请或者注销其交易编码的,由非结算会员按照期货交易所的规定办理。

第十九条 非结算会员下达的交易指令应当经全面结算会员期货公司审查或验证后进入期货交易所。全面结算会员期货公司可以按照结算协议的约定对非结算会员的指令采取必要的限制措施。

第二十条 非结算会员下达的交易指令进入期货交易所后,期货交易所应当及时将委托回报和成交结果反馈给全面结算会员期货公司和非结算会员。

非结算会员对委托回报和成交结果有异议的,应当及时向全面结算会员期货公司和期货交易所报告。

第二十一条 全面结算会员期货公司应当在期货保证金存管银行开设保证金账户,用于存放非结算会员和客户的保证金。

全面结算会员期货公司的保证金账户应当与其自有资金账户相互独立、分别管理。

全面结算会员期货公司应当为每个非结算会员开立一个内部专门账户,明细核算。

第二十二条 非结算会员是期货公司的,其与全面结算会员期货公司期货业务资金往来,只能通过各自的保证金账户办理。

非结算会员的客户出入金,只能通过非结算会员的保证金账户办理。

第二十三条 全面结算会员期货公司向非结算会员收取的保证金除用于非结算会员的期货交易外,任何机构或者个人不得占用、挪用。

非结算会员向客户收取的保证金属于客户所有,除用于客户的期货交易外,任何机构或者个人不得占用、挪用。

第二十四条 全面结算会员期货公司和非结算会员应当按照中国证监会、期货交易所的有关规定,在结算协议中约定全面结算会员期货公司的保证金账户中非结算会员结算准备金最低余额,非结算会员应当以自有资金缴纳。

第二十五条 全面结算会员期货公司应当按照结算协议约定的保证金标准向非结算会员收取保证金。

全面结算会员期货公司向非结算会员收取的保证金,不得低于期货交易所向全面结算会员期货公司收取的保证金标准。

第二十六条 全面结算会员期货公司应当建立并执行当日无负债结算制度。

期货交易所对全面结算会员期货公司结算后,全面结算会员期货公司应当根据期货交易所结算结果及时对非结算会员进行结算,并出具交易结算报告。

全面结算会员期货公司对非结算会员的所有结算项目的内容、格式、处理方式和处理日期应当与期货交易所保持一致。

全面结算会员期货公司应当确保交易结算报告的真实、准确和完整。

第二十七条 期货交易所从全面结算会员期货公司保证金账户中划拨非结算会员应向期货交易所支付的手续费。

第二十八条 除下列情形外,全面结算会员期货公司不得划转非结算会员保证金:

(一)依据非结算会员的要求支付可用资金;

(二)收取非结算会员应当交存的保证金;

(三)收取非结算会员应当支付的手续费、税款及其他费用;

(四)双方约定的且不违反法律、行政法规规定的情形。

第二十九条 非结算会员应当按照结算协议约定的时间和方式查询交易结算报告。

第三十条 非结算会员对交易结算报告的内容有异议的,应当在结算协议约定的时间内向全面结算会员期货公司提出书面异议;非结算会员对结算报告的内容无异议的,应当按照结算协议约定的方式确认。非结算会员在结算协议约定的时间内既未对交易结算报告的内容确认,也未提出异议的,视为对交易结算报告内容无异议。

非结算会员有异议的,全面结算会员期货公司应当在结算协议约定的时间内予以核实。

非结算会员未在结算协议约定的异议期间内提出异议的,不得再提出异议。

第三十一条 全面结算会员期货公司应当依照中国证监会、期货交易所的规定,建立对非结算会员的保证金管理制度。

全面结算会员期货公司可以根据非结算会员的资信及市场情况调整保证金标准。

第三十二条 全面结算会员期货公司应当按照期货交易所的有关规定,建立并执行对非结算会员的限仓制度。

第三十三条 非结算会员客户的持仓达到期货交易所规定的持仓报告标准的,客户应当通过非结算会员向期货交易所报告。客户未报告的,非结算会员应当向期货交易所报告。

第三十四条 非结算会员的结算准备金余额低于规定或者约定最低余额的,应当及时追加保证金或者自行平仓。非结算会员未在结算协议约定的时间内追加保证金或者自行平仓的,全面结算会员期货公司有权对该非结算会员的持仓强行平仓。

第三十五条 非结算会员的结算准备金余额小于零并未能在约定时间内补足的,全面结算会员期货公司应当按照约定的原则和措施对非结算会员或其客户的持仓强行平仓。

除前款规定外,全面结算会员期货公司可以与非结算会员在结算协议中约定应予强行平仓的其他情形。

第三十六条 期货交易所开市前,非结算会员结算准备金余额小于规定或者约定最低余额的,全面结算会员期货公司应当禁止其开仓。

第三十七条 非结算会员在期货交易中违约的,应当承担违约责任。全面结算会员期货公司先以该非结算会员的保证金承担该非结算会员的违约责任;保证金不足的,全面结算会员期货公司应当以风险准备金和自有资金代为承担违约责任,并由此取得对该非结算会员的相应追偿权。

第三十八条 全面结算会员期货公司认为必要的,可以对非结算会员进行风险提示。

第四章 监督管理

第三十九条 全面结算会员期货公司、交易结算会员期货公司应当按照《期货交易所管理办法》和期货交易所交易规则及其实施细则的规定行使结算会员的权利,履行结算会员的义务。

第四十条 全面结算会员期货公司、交易结算会员期货公司应当以自有资金向期货交易所缴纳结算担保金。

全面结算会员期货公司不得向非结算会员收取结算担保金。

第四十一条 期货公司被期货交易所接纳为会员、暂停或者终止会员资格的,应当在收到期货交易所的通知文件之日起 3 个工作日内向住所地中国证监会派出机构报告。

第四十二条 全面结算会员期货公司与非结算会员签订、变更和终止结算协议的,应当向协议双方住所地中国证监会派出机构、期货交易所和期货保证金安全存管监控机构报告。

第四十三条 全面结算会员期货公司应当建立并实施风险管理、内部控制等制度,保证金融期货结算业务正常进行,确保非结算会员及其客户资金安全。

第四十四条 全面结算会员期货公司应当谨慎、勤勉地办理金融期货结算业务,控制金融期货结算业务风险;建立金融期货结算业务风险隔离机制和保密制度,平等对待本公司客户、非结算会员及其客户,防范利益冲突,不得利用结算业务关系及因此获得的信息损害非结算会员及其客户的合法权益。

非结算会员应当谨慎、勤勉地控制其客户交易风险,不得利用结算业务关系损害为其结算的全面结算会员期货公司及其客户的合法权益。

第四十五条 全面结算会员期货公司应当在定期报告中向中国证监会派出机构报告下列情况:

(一)非结算会员名单及其变化情况;

(二)金融期货结算业务所涉及的内部控制制度的执行情况;

(三)金融期货结算业务所涉及的风险管理制度的执行情况;

(四)中国证监会规定的其他情况。

第四十六条 全面结算会员期货公司调整非结算会员结算准备金最低余额的,应当在当日结算前向期货交易所和期货保证金安全存管监控机构报告。

第四十七条 全面结算会员期货公司应当按规定向期货保证金安全存管监控机构报送非结算会员及非结算会员客户的相关信息。

第五章 法律责任

第四十八条 未经中国证监会批准,期货公司擅自从事金融期货结算业务的,根据《期货交易管理条例》第七十条处罚。

第四十九条 交易结算会员期货公司受托为非结算会员或者其他期货公司进行金融期货结算的,根据《期货交易管理条例》第七十条处罚。

第五十条 全面结算会员期货公司有下列行为之一的,根据《期货交易管理条例》第七十条处罚:

(一)违反规定为不符合规定条件的非结算会员进行金融期货结算;

(二)允许非结算会员在保证金不足的情况下进行期货交易。

第五十一条 全面结算会员期货公司有下列行为之一的,根据《期货交易管理条例》第七十一条处罚:

(一)违规划转非结算会员保证金;

(二)不按照规定接受非结算会员委托或者不按照非结算会员委托内容擅自进行期货交易;

(三)未将非结算会员的交易指令下达到期货交易所;

(四)向非结算会员提供虚假成交回报;

(五)违反规定向非结算会员收取保证金,或者挪用非结算会员保证金。

第五十二条 全面结算会员期货公司向非结算会员收取结算担保金的,中国证监会责令改正,予以警告,并处 3 万元以下罚款。

第六章 附则

第五十三条 本办法自 2007 年 月 日起施行。

期货公司风险监管指标管理暂行办法(草案)

第一章 总则

第一条 为加强对期货公司的风险监管,促进期货公司加强内部控制,防范风险,根据《期货交易管理条例》,制定本办法。

第二条 期货公司应当按照本办法的规定编制、报送风险监管报表。

第三条 期货公司应当建立与风险监管指标相适应的内部控制制度,应当建立动态的风险监控和资本补足机制,确保净资本等风险监管指标持续符合标准。

第四条 期货公司扩大业务规模或向股东分配利润以及发生其他可能对净资本产生重大影响的事项前,应当对相应的风险监管指标进行敏感性测试。

第五条 期货公司应当聘请具备证券、期货相关业务资格的会计师事务所对期货公司年度风险监管报表进行审计。

会计师事务所及其注册会计师应当勤勉尽责,对出具报告所依据的文件资料内容的真实性、准确性和完整性进行核查和验证,并对出具审计报告的合法性、真实性负责。

第二章 风险监管指标的计算

第六条 期货公司风险监管指标包括期货公司净资本、净资本与净资产的比例、流动比率、负债与净资产的比例等衡量期货公司财务安全的监管指标。

第七条 本办法所称净资本是在期货公司净资产的基础上,按照变现能力对资产负债项目及其他项目进行风险调整后得出的综合性风险监管指标。

净资本的计算公式为:净资本=净资产-资产调整值+负债调整值-客户未足额追加的保证金-/+其他调整项。

第八条 期货公司资产按照分类、流动性、账龄和可回收性等情况采取不同比例进行风险调整。

第九条 期货公司持有的金融资产,按照分类和流动性情况采取不同比例进行风险调整。分类中同时符合两个或两个以上标准的,应当采用最高的比例进行风险调整。

第十条 期货公司应当按照账龄及其核算的具体内容,采取不同比例对应收项目进行风险调整。分类中同时符合两个或两个以上标准的,应当采用最高的比例进行风险调整。

第十一条 期货公司计算净资本时,应当按照企业会计准则的规定对相关项目充分计提资产减值准备。

中国证监会派出机构可以要求期货公司对资产减值准备计提的充足性和合理性进行专项说明;有证据表明期货公司未能充分计提资产减值准备的,中国证监会派出机构可以要求期货公司相应核减净资本金额。

第十二条 期货公司计算净资本时,可以将“期货风险准备金”等有助于增强抗风险能力的负债项目加回。

除“期货风险准备金”外,期货公司认为某项负债需要在计算净资本时予以调整的,应当增加附注,详细说明该项负债反映的具体内容;中国证监会及其派出机构可以根据审慎监管原则决定是否对该项负债进行调整。

第十三条 期货公司应当按照企业会计准则的规定确认预计负债。

中国证监会派出机构可以要求期货公司对预计负债进行专项说明;有证据表明期货公司未能准确确认预计负债的,中国证监会派出机构可以要求期货公司相应核减净资本金额。

第十四条 客户保证金未足额追加的,期货公司应当相应调减净资本。客户保证金在报表报送日之前已足额追加的,期货公司可以在报表附注中说明,经公司注册地中国证监会派出机构确认后,可以在“其他调整项”中作调增处理。

未足额追加的客户保证金应当按期货交易所规定的保证金标准计算,不包括已经记入“应收风险损失款”科目的客户因穿仓形成的对期货公司的债务。

第十五条 期货公司应当在净资本计算表的附注中,充分披露期末未决诉讼、未决仲裁等或有负债的性质、涉及金额、形成原因、进展情况、可能发生的损失和预计损失的会计处理情况,并在计算净资本时按照一定比例扣减。

第十六条 期货公司借入次级债务的,可以将所借入的次级债务按照中国证监会规定的比例计入净资本。

期货公司向股东或其关联企业借入的具有次级债务性质的长期借款,可以在计算净资本时将所借入的长期借款按照一定比例计入净资本。

第十七条 客户保证金未足额追加的,期货公司在计算符合规定的最低限额的结算准备金时,应当相应调减。

第三章 风险监管指标标准

第十八条 期货公司必须持续符合以下风险监管指标标准:

(一)净资本不得低于人民币 1500 万元;

(二)净资本不得低于客户权益的 6%;

(三)净资本按营业部数量平均折算额(净资本/营业部家数)不得低于人民币 300 万元;

(四)净资本与净资产的比例不得低于 40%;

(五)流动资产与流动负债的比例不得低于 100%;

(六)负债与净资产的比例不得高于 150%;

(七)符合规定的最低限额的结算准备金要求。

第十九条 期货公司委托其他机构提供中间介绍业务的,净资本不得低于人民币 3000 万元。

第二十条 从事交易结算业务的期货公司,净资本不得低于人民币 4500万元。

第二十一条 从事全面结算业务的期货公司,净资本不得低于以下标准:

(一)人民币 9000 万元;

(二)客户权益总额与非结算会员交付保证金之和的 6%。

第二十二条 中国证监会及其派出机构可以根据审慎监管原则,结合期货公司的风险状况及风险管理能力,提高其风险监管指标标准。

第二十三条 中国证监会对第十五条至第十八条规定的风险监管指标设置预警标准。对于规定“不得低于”一定标准的风险监管指标,其预警标准是规定标准的 120%,对于规定“不得高于”一定标准的风险监管指标,其预警标准是规定标准的 80%。

第四章 编制和披露

第二十四条 期货公司应当报送月度和年度风险监管报表。期货公司应当于月度终了后的 7 个工作日内向公司注册地中国证监会派出机构报送月度风险监管报表,在年度终了后的 3 个月内报送经注册会计师审计的年度风险监管报表。

中国证监会派出机构可以根据审慎监管原则,要求期货公司按周或按日编制并报送风险监管报表。

第二十五条 期货公司应当指定专人负责风险监管报表的编制和报送工作。

第二十六条 期货公司风险监管报表报送前需经公司法定代表人、经营管理主要负责人、财务负责人、结算负责人、制表人签字确认,上述签字人员应当保证风险监管报表真实、准确、完整。对风险监管报表内容持有异议的,应当书面注明意见和理由,向公司注册地中国证监会派出机构报送。

第二十七条 期货公司应当按照中国证监会规定的方式报送风险监管报表。

期货公司应当保留书面风险监管报表,相应责任人员应当在报表上签字,并加盖公司印章,保存时间 20 年。

第二十八条 经法定代表人签署确认,期货公司应当至少每半年向公司全体董事书面报告一次公司净资本等各项风险监管指标的具体情况。

经全体董事签署确认,期货公司应当至少每半年向公司全体股东书面报告一次公司净资本等各项风险监管指标的具体情况,并应当取得股东的签收确认证明。

第二十九条 风险监管指标与上月相比变动超过 20%的,期货公司应当向公司注册地中国证监会派出机构书面报告,说明原因,并在 5 个工作日内向全体董事和全体股东书面报告。

第三十条 当期货公司风险监管指标出现预警时,期货公司应于当日向公司注册地中国证监会派出机构书面报告,详细说明原因、对公司的影响、解决问题的具体措施和期限,同时向全体董事书面报告。

期货公司风险监管指标不符合规定标准情况时,期货公司除履行上述程序外,同时还应于当日向全体股东书面报告。

第五章 监督管理

第三十一条 期货公司未按期报送或报送的风险监管报表存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏的,中国证监会派出机构应当要求期货公司限期报送或者补充更正。

期货公司未在限期内报送或者补充更正的,公司注册地中国证监会派出机构应当对公司进行现场检查,发现期货公司明显违反企业会计准则和本办法有关规定的,可以直接认定风险监管指标不符合规定标准。

第三十二条 期货公司风险监管指标触及预警标准,进入风险预警期后,中国证监会派出机构应当在 5 个工作日内对公司风险监管指标触及预警标准的情况和原因进行核实,对公司的影响程度进行评估,并视情况采取下列措施:

(一)向公司出具警示函,并抄送其主要股东;

(二)对公司高级管理人员进行监管谈话,要求其提高公司净资本水平;

(三)要求公司进行重大业务决策时,应当至少提前 5 个工作日向公司注册地中国证监会派出机构报送临时报告,说明有关业务对公司财务状况和风险监管指标的影响;

(四)责令公司增加内部合规检查的频率,并提交合规检查报告。

第三十三条 期货公司风险监管指标恢复到预警标准以上并连续保持 3 个月的,风险预警期结束。

第三十四条 中国证监会派出机构应当在发现期货公司风险监管指标不符合规定标准或者接到期货公司报告后的 2 个工作日内对公司进行现场检查,对不符合规定标准的情况和原因进行核实,并责令期货公司限期整改,整改期限最长不超过 20 个工作日。

第三十五条 经过整改,风险监管指标符合规定标准的,期货公司应当向公司注册地中国证监会派出机构报告,中国证监会派出机构应当进行验收。

期货公司风险监管指标符合规定标准的,中国证监会派出机构应当自验收合格之日起 3 个工作日内解除对期货公司采取的有关措施。

第三十六条 期货公司逾期未改正或者经过整改风险监管指标仍不符合规定标准的,中国证监会及其派出机构可以依据《期货交易管理条例》第五十九条采取监管措施。

第六章 附则

第三十七条 本办法下列用语的含义:

(一)风险监管报表,包括期货公司风险监管指标汇总表、净资本计算表、资产调整值计算表、客户分离资产报表、客户权益变动表、经营业务报表和客户管理报表等。

(二)资产、流动资产,是指期货公司除客户保证金外的自身资产。

(三)负债、流动负债,是指期货公司的对外负债,不含客户权益。

(四)重大业务,是指可能导致期货公司各项风险监管指标发生 10%以上变化的业务。

第三十八条 本办法自 2007 年 月 日起施行。本办法施行前依法设立的期货公司,不完全符合本办法规定的,应当在 2007 年 8 月 1 日之前达到本办法的要求。

证券公司为期货公司提供中间介绍业务管理暂行办法(草案)

第一章 总则

第一条 为了规范证券公司为期货公司提供中间介绍业务,防范和隔离风险,促进期货市场积极稳妥发展,根据《期货交易管理条例》,制定本办法。

第二条 本办法所称证券公司为期货公司提供中间介绍业务(以下简称介绍业务),是指证券公司接受期货公司委托,为期货公司介绍客户参与期货交易并提供其他相关服务的业务活动。

第三条 证券公司从事介绍业务,应当依照本办法的规定取得介绍业务资格,审慎经营,并对其营业部开展的介绍业务实行统一管理。

第四条 中国证券监督管理委员会(以下简称中国证监会)及其派出机构依法对证券公司的介绍业务活动实行监督管理。

相关自律性组织依法对介绍业务活动实行自律管理。

第二章 资格条件与业务范围

第五条 证券公司申请介绍业务资格,应当符合下列条件:

(一)申请日前 6 个月各项风险控制指标符合规定标准;

(二)已建立客户交易结算资金第三方存管制度;

(三)全资拥有或者控股一家期货公司,或与一家期货公司被同一机构控制,且该期货公司具有实行会员分级结算制度期货交易所的会员资格、申请日前 2 个月的风险监管指标持续符合规定的标准;

(四)配备必要的业务人员,公司总部至少有 5 名、拟开展介绍业务的营业部至少有 2 名具有期货从业人员资格的业务人员;

(五)已建立健全与介绍业务相关的业务规则、内部控制、风险隔离及合规检查等制度;

(六)具有满足业务需要的技术系统;

(七)中国证监会根据市场发展情况和审慎监管原则规定的其他条件。

第六条 本办法第五条第(一)项所称风险控制指标标准是指:

(一)净资本不低于 12 亿元;

(二)流动资产余额不低于流动负债余额(不包括客户交易结算资金和客户委托管理资金)的 150%;

(三)对外担保及其他形式的或有负债之和不高于净资产的 10%,因证券公司发债提供的反担保除外;

(四)净资本不低于净资产的 70%。

中国证监会可以根据市场发展情况和审慎监管原则对前款标准进行调整。

第七条 证券公司申请介绍业务,应当向中国证监会提交下列申请材料:

(一)介绍业务资格申请书;

(二)董事会关于从事介绍业务的决议,公司章程规定该决议由股东会做出的,应提供股东会的决议;

(三)净资本等指标的计算表及相关说明;

(四)客户交易结算资金独立存管制度实施情况说明及客户交易结算资金第三方存管制度文本;

(五)分管介绍业务的高级管理人员和相关业务人员简历、期货从业人员资格证明;

(六)关于介绍业务的业务规则、内部控制、风险隔离和合规检查等制度文本;

(七)关于技术系统准备情况的说明;

(八)全资拥有或控股期货公司或者与期货公司被同一机构控制的情况说明,该期货公司在申请日前 2 个月月末的风险监管报表;

(九)与期货公司拟签订的介绍业务委托协议文本。

第八条 中国证监会自受理申请材料之日起 20 日内,作出批准或者不批准的决定。

第九条 证券公司受期货公司委托从事介绍业务,应当提供下列服务:

(一)协助办理开户手续;

(二)提供期货行情信息、交易设施;

(三)中国证监会规定的其他服务。

证券公司不得代理客户进行期货交易、结算或交割,不得代期货公司、客户收付期货保证金,不得利用证券资金账户为客户存取、划转期货保证金。

第十条 证券公司从事介绍业务,应当与期货公司签订书面委托协议。协议应当载明下列事项:

(一)介绍业务的范围;

(二)执行期货保证金安全存管制度的措施;

(三)介绍业务对接规则;

(四)客户投诉的接待处理方式;

(五)报酬支付及相关费用的分担方式;

(六)违约责任;

(七)中国证监会规定的其他事项。

双方可以在协议中约定前款规定以外的其他事项,但不得违反法律、行政法规和本办法的规定,不得损害客户的合法权益。

证券公司按照委托协议对期货公司承担介绍业务受托责任。基于期货经纪合同的责任由期货公司直接对客户承担。

第十一条 证券公司与期货公司签订、变更或者终止委托协议的,双方应当在 5 个工作日内报各自所在地的中国证监会派出机构备案。

第三章 业务规则

第十二条 证券公司只能接受其全资拥有或控股的、或者被同一机构控制的期货公司的委托从事介绍业务,不能接受其他期货公司的委托从事介绍业务。

第十三条 证券公司应当按照合规、审慎经营的原则,制定并有效执行介绍业务规则、内部控制、合规检查等制度,确保有效隔离介绍业务与其他业务的风险。

第十四条 期货公司与证券公司应当建立介绍业务的对接规则,明确办理开户、行情和交易系统的安装维护、客户投诉的接待处理等业务的协作程序和规则。

第十五条 证券公司与期货公司应当独立经营,保持财务、人员、经营场所等分开隔离。

第十六条 证券公司应当根据内部控制和风险隔离制度的规定,指定有关负责人和有关部门负责介绍业务的经营管理。

证券公司应当配备足够的具有期货从业人员资格的业务人员,不得任用不具有期货从业人员资格的业务人员从事介绍业务。

证券公司从事介绍业务的工作人员不得进行期货交易。

第十七条 证券公司应当在其经营场所显著位置或其网站,公开下列信息:

(一)受托从事的介绍业务范围;

(二)从事介绍业务的管理人员和业务人员的名单和照片;

(三)期货公司期货保证金账户信息、期货保证金安全存管方式;

(四)客户开户和交易流程、出入金流程;

(五)交易结算结果查询方式;

(六)中国证监会规定的其他信息。

中国证监会及其派出机构可以根据审慎监管原则,要求证券公司调整相关信息的公开方式。

第十八条 证券公司为期货公司介绍客户时,应当向客户明示其与期货公司的介绍业务委托关系,解释期货交易的方式、流程及风险,不得作获利保证、共担风险等承诺,不得虚假宣传,误导客户。

第十九条 证券公司应当建立完备的协助开户制度,对客户的开户资料和身份真实性等进行审查,向客户充分揭示期货交易风险,解释期货公司、客户、证券公司三者之间的权利义务关系,告知期货保证金安全存管要求。

证券公司应当及时将客户开户资料提交期货公司,期货公司应当复核后与客户签订期货经纪合同,办理开户手续。

第二十条 证券公司介绍其控股股东、实际控制人等开户的,证券公司应当将其期货账户信息报中国证监会派出机构备案,并按照中国证监会的规定履行信息披露义务。

第二十一条 证券公司不得代客户下达交易指令,不得利用客户的交易编码、资金账号或期货结算账户进行期货交易,不得代客户接收、保管或者修改交易密码。

第二十二条 证券公司不得直接或者间接为客户从事期货交易提供融资或担保。

第二十三条 期货、现货市场行情发生重大变化或者客户可能出现风险时,证券公司及其分支机构可以协助期货公司向客户提示风险。

第二十四条 证券公司应当协助维护期货交易系统的稳定运行,保证期货交易数据传送的安全和独立。

第二十五条 证券公司应当在营业场所妥善保存有关介绍业务的凭证、单据、账簿、报表、合同、记录、数据信息等资料。

证券公司保存上述文件资料的期限不得少于 20 年。

第二十六条 证券公司应当建立并有效执行介绍业务的合规检查制度。

证券公司应当定期对介绍业务规则、内部控制、风险隔离等制度的执行情况和营业部介绍业务的开展情况进行检查,每半年向中国证监会派出机构报送合规检查报告。

发生重大事项的,证券公司应当在 2 个工作日内向中国证监会派出机构报告。

第四章 监督管理与法律责任

第二十七条 中国证监会及其派出机构按照审慎监管原则,对证券公司从事的介绍业务进行现场检查和非现场检查。

第二十八条 证券公司应当按照中国证监会的规定披露介绍业务的相关信息,报送介绍业务的相关文件、资料及数据信息。

第二十九条 证券公司取得介绍业务资格后不符合本办法第五条、第六条规定条件的,中国证监会及其派出机构可以责令其限期整改;经限期整改仍不符合条件的,中国证监会有权依法撤销其介绍业务资格。

第三十条 证券公司从事介绍业务不符合本办法第三章业务规则的,中国证监会及其派出机构可以采取责令限期整改、监管谈话、出具警示函等监管措施;逾期未改正,其行为可能危及期货公司的稳健运行、损害客户合法权益的,中国证监会可以责令期货公司终止与该证券公司的介绍业务关系。

第三十一条 证券公司因其他业务涉嫌违法违规或者出现重大风险被暂停、限制业务或者撤销业务资格的,中国证监会可以责令期货公司终止与该证券公司的介绍业务关系。

第三十二条 证券公司有下列行为之一的,给予警告,可单处或并处 3 万元以下罚款,对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予警告,并处 3 万元以下罚款:

(一)未将介绍业务与其他经营业务分开或有效隔离;

(二)未将财务、人员、经营场所与期货公司分开隔离。

第三十三条 证券公司有下列行为之一的,视情节轻重,按照《期货交易管理条例》第七十条进行处罚,对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予警告,并处 1 万元以上 5 万元以下罚款:

(一)未经许可擅自开展介绍业务;

(二)对客户未充分揭示期货交易风险,进行虚假宣传,误导客户;

(三)代理客户进行期货交易、结算或交割;

(四)收付、存取或者划转期货保证金;

(五)为客户从事期货交易提供融资或者担保;

(六)未按规定审查客户的开户资料和身份真实性;

(七)代客户下达交易指令;

(八)利用客户的交易编码、资金账号或期货结算账户进行期货交易;

(九)拒绝、阻碍中国证监会及其派出机构依法履行职责。

第五章 附则

第三十四条 本办法自 2007 年 月 日起施行。