

# 期货风险管理公司做市业务过渡期相关安排

## 一、设置过渡期 36 个月

1. 过渡期内，在期货公司取得期货做市交易业务牌照之前，其下设已在协会备案做市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开展做市业务。
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 个月内了结做市业务，不得新增做市品种。

## 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做市业务进行行政监管；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做市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. 期货公司期货做市交易业务牌照的申请流程相关事项，见证监会有关规定。
2. 期货公司报备或开立做市账户相关事项，由上交所、深交所和中国期货市场监控中心另行通知。中国证券登记结算修订与期货公司的结算参与者协议。
3. 期货公司与其下设风险管理公司在交易所相关品种的做

市业务资格变更相关事项，由上交所、深交所、上期所、郑商所、大商所、中金所、广期所另行通知。

4. 期货公司与其下设风险管理公司之间的做市账户变更及持仓迁移相关事项，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。

5. 在上述安排明确的基础上，各公司应当制定完善可行的做市业务调整方案，统筹考虑风险隔离、场地、设备、技术系统、网络环境、人员变动及考核等因素，做好承接做市业务相关协议签署，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做市业务风险的监管指标。在取得期货做市交易业务牌照并完成业务调整后，应当计提做市业务风险资本准备，并按照规定填报月度、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，计提做市业务风险资本准备。

附件：做市业务过渡期内工作流程图