

风险管理公司会员信用信息报告工作规则

第一条 为加快推动期货行业信用体系建设，引导中国期货业协会（以下简称“协会”）会员持续加强信用积累，落实《关于新时代加快完善社会主义市场经济体制的意见》《建设高标准市场体系行动方案》《关于推进行业协会商会诚信自律建设工作的意见》等相关文件精神，依据《期货交易管理条例》《证券期货市场诚信监督管理办法》等法律法规以及《中国期货业协会会员管理办法》《期货公司风险管理公司业务试点指引》《期货经营机构诚信信息管理办法》等自律规则有关规定，制定本工作规则。

第二条 本工作规则适用于依法在协会备案，并已成为协会会员的风险管理公司。

第三条 风险管理公司会员信用信息报告（以下简称“信用信息报告”），是基于风险管理公司会员合法合规情况及公司向协会报送的备案材料、经营数据等，从合规性、竞争力、专业性、稳定性等维度持续记录会员展业过程中的信用信息情况。相关具体指标及定义见附件1。

第四条 信用信息报告的主要目标是：

（一）持续、动态积累风险管理公司会员信用记录，带动行业以信用立身，实现行业信用自治。

（二）引导风险管理公司会员诚实守信，勤勉尽职，自觉提升合规风控能力和水平。

（三）促进风险管理公司会员提升经营管理的稳定性、

服务专业性和行业竞争力。

（四）引导行业相关合作机构关注风险管理公司会员的信用记录。

（五）为中国证监会及其派出机构、政府机关等相关部门开展工作提供参考。

第五条 协会充分发挥行业力量，本着依法依规、公正科学的原则，开展信用信息报告相关工作。

第六条 信用信息报告每年更新一次，将分别以表格、雷达图等形式展示（见附件2）。

风险管理公司会员可在协会自律服务系统的“会员信用信息报告”模块，查阅或下载本会员各期的信用信息报告。

第七条 风险管理公司会员应当在当期信用信息报告发送之日起10个工作日内，对报告结果予以复核。对本会员信用信息报告结果有异议的，应当在上述期限内向协会提出书面查询申请，协会在收到查询申请后将于20个工作日内予以答复。

第八条 信用信息报告不构成对风险管理公司会员持续合规经营、专业能力等情况的认可或保证。

风险管理公司会员可根据自身经营需要，将信用信息报告提供给相关合作机构。提供报告的，须确保报告内容完整，不得对内容进行节选删减等。

第九条 风险管理公司会员应按照相关要求，真实、准确、完整报送备案材料、经营数据等信息。对于隐瞒事项或者报送信息和资料有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏的，

协会将依据规定对该会员及其主要负责人视情节轻重采取相关纪律处分措施。

第十条 本工作规则自发布之日起实施。

第十一条 本工作规则解释权归中国期货业协会。

附件 1

风险管理公司会员信用信息报告指标及定义

四大维度	序号	分项指标	解释说明
合规性	1	近三年风险管理公司及其董监高受到行政处罚、行政监管措施的次数	<p>1. 定义：指近三年风险管理公司及其董监高受到中国证监会及其派出机构行政处罚及行政监管措施的次数总和。</p> <p>2. 说明：</p> <p>A. 考察期末指上一自然年末。</p> <p>B. 行政处罚、行政监管措施以正式发文为准。</p> <p>C. 同一文书中既处罚风险管理公司又处罚董监高的，记一次。</p> <p>D. 因同一事件被不同单位或部门分别处理，或因同一事件被采取不同处理形式的，分别计次。</p>
	2	近三年风险管理公司、董监高及其他工作人员受到纪律惩戒的次数	<p>1. 定义：指近三年风险管理公司、董监高及其他工作人员受到中国期货业协会纪律惩戒和交易所纪律处分的次数总和。</p> <p>2. 说明：</p> <p>A. 考察期末指上一自然年末。</p> <p>B. 交易所指上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所、上海期货交易所、郑州商品交易所、大连商品交易所、中国金融期货交易所、广州期货交易所等证券期货交易所。</p> <p>C. 交易所纪律处分指交易所根据相关规定，经过立案调查程序采取的处分、处理、处罚、惩戒等自律管理措施。</p> <p>D. 纪律惩戒和纪律处分以正式发文为准。</p> <p>E. 同一文书中既处罚风险管理公司又处罚董监高或其他工作人员的，记一次。</p> <p>F. 因同一事件被不同单位或部门分别处理，或因同一事件被采取不同处理形式的，分别计次。</p>

四大维度	序号	分项指标	解释说明
竞争力	3	最近三年度期货公司分类评价结果	<p>1. 定义：指最近三年度控股风险管理公司的期货公司的分类评价结果。</p> <p>2. 说明：</p> <p>A. 考察期末指上一自然年末。</p> <p>B. 控股风险管理公司的期货公司指其出资额占风险管理公司资本总额 50%以上或其持有的股份占风险管理公司股本总额 50%以上的期货公司。</p>
	4	近一年风险管理公司平均净资产	<p>1. 定义：指近一年风险管理公司的平均净资产。</p> <p>2. 说明：</p> <p>A. 考察期初指上一自然年初。</p> <p>B. 考察期末指上一自然年末。</p> <p>C. 平均净资产=（期初净资产+期末净资产）/2。</p>
	5	风险管理公司实收资本	<p>1. 定义：指考察期末，风险管理公司的实收资本。</p> <p>2. 说明：考察期末指上一自然年末。</p>
	6	近一年风险管理公司净利润	<p>1. 定义：指近一年风险管理公司的净利润总和。</p> <p>2. 说明：考察期末指上一自然年末。</p>
专业性	7	近一年期现业务服务产业客户数量	<p>1. 定义：指已与风险管理公司签订仓单服务业务或现货贸易类协议或合同的客户中，在近一年发生交易的客户数量。</p> <p>2. 说明：</p> <p>A. 考察期末指上一自然年末。</p> <p>B. 期现业务指基差贸易业务和仓单服务业务。</p>
	8	近一年场外衍生品业务月均持仓客户数量	<p>1. 定义：指近一年风险管理公司场外衍生品业务月均持仓客户数量。</p> <p>2. 说明：</p> <p>A. 考察期末指上一自然年末。</p> <p>B. 场外衍生品业务持仓客户数量指截至月底，签订的交易确认书尚未完全终止的（部分终止的纳入统计）客户数量。</p>

四大维度	序号	分项指标	解释说明
专业性	9	近一年期现业务规模及市场占有率	<p>1. 定义：指近一年风险管理公司期现业务的规模及其占全行业期现业务规模的比重。</p> <p>2. 说明：</p> <p>A. 考察期末指上一自然年末。</p> <p>B. 期现业务规模指基差贸易业务规模与仓单服务业务规模的总和。</p> <p>C. 全行业期现业务规模指所有在中国期货业协会备案的风险管理公司开展期现业务的规模总和。</p> <p>D. 基差贸易业务规模=基差贸易业务贸易金额=基差贸易业务现货采购金额+基差贸易业务现货销售金额。</p> <p>E. 仓单服务业务规模=仓单服务业务服务金额=仓单质押业务新增质押金额+仓单约定购回业务买入金额+仓单约定购回业务卖出金额+仓单串换业务成交金额。</p>
	10	近一年商品类场外衍生品业务规模及市场占有率	<p>1. 定义：指近一年风险管理公司商品类场外衍生品业务的规模及其占全行业商品类场外衍生品业务规模的比重。</p> <p>2. 说明：</p> <p>A. 考察期末指上一自然年末。</p> <p>B. 全行业商品类场外衍生品业务规模指所有在中国期货业协会备案的风险管理公司开展商品类场外衍生品业务的规模总和。</p> <p>C. 近一年商品类场外衍生品业务规模=近一年商品类场外衍生品业务月均持仓名义本金。</p>
	11	近一年场外衍生品业务规模及市场占有率	<p>1. 定义：指近一年风险管理公司场外衍生品业务的规模及其占全行业场外衍生品业务规模的比重。</p> <p>2. 说明：</p> <p>A. 考察期末指上一自然年末。</p> <p>B. 全行业场外衍生品业务规模指所有在中国期货业协会备案的风险管理公司开展场外衍生品业务的规模总和。</p> <p>C. 近一年场外衍生品业务规模=近一年场外衍生品业务月均持仓名义本金。</p>

四大维度	序号	分项指标	解释说明
专业性	12	近一年期货做市业务规模及市场占有率	<p>1. 定义：指近一年风险管理公司期货做市业务的规模及其占全行业期货做市业务规模的比重。</p> <p>2. 说明：</p> <p>A. 考察期末指上一自然年末。</p> <p>B. 全行业期货做市业务规模指所有在中国期货业协会备案的风险管理公司开展期货做市业务的规模总和。</p> <p>C. 期货做市业务规模=期货做市业务交易额=期货做市业务成交额。</p>
	13	近一年期权做市业务规模及市场占有率	<p>1. 定义：指近一年风险管理公司期权做市业务的规模及其占全行业期权做市业务规模的比重。</p> <p>2. 说明：</p> <p>A. 考察期末指上一自然年末。</p> <p>B. 全行业期权做市业务规模指所有在中国期货业协会备案的风险管理公司开展期权做市业务的规模总和。</p> <p>C. 期权做市业务规模=期权做市业务交易额=场内期权做市业务买入交易额+场内期权做市业务卖出交易额。</p>
稳定性	14	近三年风险管理公司被暂停备案业务的次数	<p>1. 定义：指近三年风险管理公司被中国期货业协会暂停各项已备案业务的次数总和。</p> <p>2. 说明：</p> <p>A. 考察期末指上一自然年末。</p> <p>B. 多次被暂停同一项备案业务的，暂停次数予以加总。被暂停多项备案业务的，暂停次数予以加总。</p> <p>C. 暂停业务的纪律惩戒或申诉委员会审议决定以正式发文为准。</p> <p>D. 根据《期货公司风险管理公司业务试点指引》第十七条规定，暂停新增业务的，纳入本项计次范围。</p>
	15	近三年风险管理公司董事长（执行董事）、高级管理人员发生变更的次数	<p>1. 定义：指近三年风险管理公司董事长（执行董事）、高级管理人员发生变更的次数总和。</p> <p>2. 说明：</p> <p>A. 考察期末指上一自然年末。</p> <p>B. 发生变更指相关人员在该公司降职或从该风险管理公司离职。</p>

附件 2

风险管理公司会员信用信息报告结果展示方案 (附样本案例)

风险管理公司会员信用信息报告结果将分别以表格、雷达图展示本会员每个指标所处行业区间/排名。

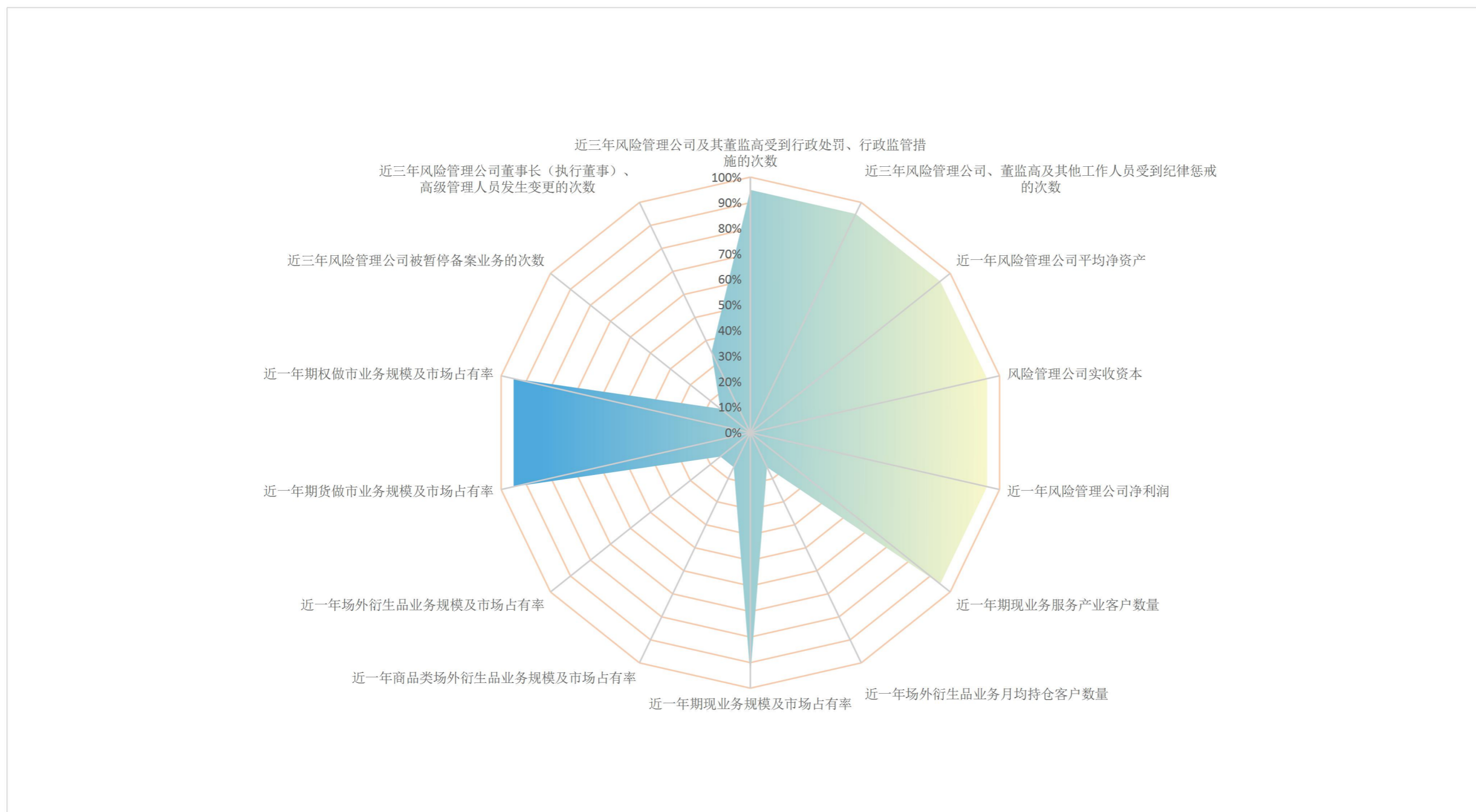
表格展示：

机构名称：XX 有限公司

四大维度	序号	分项指标	具体数值	所处行业区间或排名	行业中位数
合规性	1	近三年风险管理公司及其董监高受到行政处罚、行政监管措施的次数	0 次	90%-100%	0 次
	2	近三年风险管理公司、董监高及其他工作人员受到纪律惩戒的次数	1 次	90%-100%	2 次
竞争力	3	最近三年度期货公司分类评价结果	AA、AA、AA		
	4	近一年风险管理公司平均净资产	6000 万元	5/94	1000 万元
	5	风险管理公司实收资本	5000 万元	5/94	2000 万元
	6	近一年风险管理公司净利润	4000 万元	5/94	3000 万元
专业性	7	近一年期现业务服务产业客户数量	200 户	90%-100%	100 户
	8	近一年场外衍生品业务月均持仓客户数量	20 户	10%-20%	100 户
	9	近一年期现业务规模及市场占有率	1600 万元/5%	90%-100%	800 万元
	10	近一年商品类场外衍生品业务规模及市场占有率	100 万元/0.5%	10%-20%	400 万元
	11	近一年场外衍生品业务规模及市场占有率	100 万元/0.5%	10%-20%	600 万元
	12	近一年期货做市业务规模及市场占有率	800 万元/5%	90%-100%	400 万元
	13	近一年期权做市业务规模及市场占有率	800 万元/5%	90%-100%	400 万元
稳定性	14	近三年风险管理公司被暂停备案业务的次数	1 次	10%-20%	0 次
	15	近三年风险管理公司董事长（执行董事）、高级管理人员发生变更的次数	7 次	30%-40%	4 次

注：表格将列示本会员每个指标的具体数值、所处行业区间或排名、行业中位数，其中区间间隔取 10%。另，所提供样本案例数据仅供理解使用，并非行业真实情况，特此说明。

雷达图展示



注：图中所有数值均是取对应的所处行业区间的中值。越靠近外围（100%），表示指标数值在行业越靠前。**特别地**，各合规性指标、稳定性指标发生次数越少，越靠近外围（100%）。