

关于加强期货公司客户风险控制有关工作的通知

各期货公司：

近期，期货市场发生几起因期货公司风险控制不力，客户穿仓，造成保证金缺口的风险事件，监管部门迅速行动，督促相关公司短时间内弥补了资金缺口，并严肃处理了相关公司及责任人。为防范类似风险事件的发生，切实保护投资者的合法权益，特重申以下监管要求：

一、期货公司要谨慎为本，根据市场风险状况及客户诚信记录和风险承担能力确定客户的保证金水平，严禁低于交易所标准收取保证金。

二、期货公司应严格执行追加保证金和强行平仓制度，及时化解风险，严禁客户在保证金不足的情况下进行期货交易，防止出现客户穿仓。

三、严格对期货公司关联客户的管理，禁止因关联关系而降低保证金的收取比例，放松风险控制；严禁股东或实际控制人干扰公司正常的保证金管理和风险控制。

四、期货公司必须以自有资金将交易所要求的最低结算准备金足额存放于保证金封闭圈内。当客户出现透支或穿仓时，期货公司应及时以自有资金补足。

五、期货公司董事长、总经理等高管人员以及公司风险控制人员要增强责任意识，切实履行职责。公司高管、风险控制人员正常履行职责受到干扰时，应立即向当地证监局报告。

六、期货公司要按照相关要求及时、准确、全面地向证监局、保证金监控中心报送信息，出现大额透支、穿仓时，应立即向证监局报告。

各期货公司及相关责任人员应对照有关法规、证监会和交易所的规定及本通知的要求，检查公司客户风险控制情况，发现问题应立即整改，并向证监局报告整改情况。

中国证监会及派出机构将持续深入检查各期货公司风险控制情况，发现问题将严肃处理，追究责任。

中国证券监督管理委员会

2007年2月25日