

期货公司分类评价规定

(征求意见稿)

第一章 总则

第一条 为了有效实施对期货公司的监督管理，合理配置监管资源，提高监管效率，引导期货公司合规经营、稳健发展、聚焦主责、专注主业、做优做强，全面提升期货行业服务能力和竞争力，根据《中华人民共和国期货和衍生品法》《期货交易管理条例》《期货公司监督管理办法》，制定本规定。

第二条 期货公司分类是指以期货公司持续合规状况、风险管理能力为基础，结合公司市场竞争力、服务实体经济能力等，按照本规定评价和确定期货公司的类别。

期货公司分类评价采用计分制，基准分为 100 分。在基准分的基础上，根据本规定进行相应扣分和加分，以确定期货公司的综合评价得分。

第三条 期货公司分类评价坚持依法合规、客观公正原则，由中国证监会组织实施。中国证监会派出机构、期货交易所、证券交易所、中国期货市场监控中心、全国中小企业股份转让系统、中国期货业协会、中国证券投资基金业协会在中国证监会的指导下，依据本规定履行工作职责。

第四条 中国证监会建立期货公司分类监管评审机制，

组织评审委员会开展复核和评审等工作。

评审委员会由中国证监会及其派出机构、期货交易所、中国期货市场监控中心、中国期货业协会相关人员组成。

第五条 参与期货公司分类评价工作的人员应当具备相应的专业素质、业务能力和监管经验，在工作中遵守保密规定，坚持原则、廉洁奉公、勤勉尽责。

第二章 扣分指标及评价方法

第六条 期货公司分类评价扣分指标，包括持续合规状况和风险管理能力。

第七条 持续合规状况根据中国证监会及其派出机构采取的监管措施、行政处罚，证券期货行业自律组织采取的纪律处分，以及司法机关采取的刑事处罚进行评价。

第八条 期货公司在评价期内被中国证监会及其派出机构采取监管措施、行政处罚或者被司法机关刑事处罚的，按照以下原则进行扣分：

（一）被采取出具警示函的，每次扣 0.5 分；

（二）被采取责令改正、责令定期报告、责令增加内部合规检查次数、责令公开说明、责令参加培训的，每次扣 1 分；

（三）被采取监管谈话的，每次扣 1.5 分；

（四）被采取责令更换董事、监事、高级管理人员及有关业务部门、分支机构的负责人员或者限制其权利，被责令

处分有关人员的，每次扣 2 分；

（五）被采取停止核准新增业务、暂不受理行政许可相关文件的，每次扣 3 分；

（六）被采取警告行政处罚的，每次扣 4 分；

（七）被采取罚款、没收违法所得行政处罚的，每次扣 5 分；

（八）被采取限制业务活动、权利的，包含限制或者暂停部分或者全部业务、限制分配红利、限制调拨和使用自有资金或者风险准备金、限制转让公司财产或者在财产上设定其他权利、责令暂停或者终止重组活动，每次扣 6 分；

（九）被采取撤销有关业务许可、关闭分支机构的，每次扣 7 分；

（十）被采取责令停业整顿、吊销相关业务许可行政处罚的，每次扣 8 分；

（十一）被采取刑事处罚的，每次扣 10 分。

对于出现下列情形的，按本条第一款规定扣分：

（一）期货公司子公司被采取本条第一款所列示的监管措施、行政处罚或者刑事处罚的；

（二）期货公司的股东、实际控制人或者其他关联人因违反期货公司监管相关法律法规被采取本条第一款所列示的监管措施、行政处罚或者刑事处罚，且可能导致期货公司正常经营受到影响或者出现风险隐患的；

（三）期货公司因违反反洗钱法律法规被采取监管措施、行政处罚、刑事处罚的。

期货公司的股东被中国证监会及其派出机构采取限制股东权利的，每次扣4分，被采取责令转让股权的，每次扣5分。

期货公司分支机构被采取本条第一款所列示的监管措施、行政处罚或者刑事处罚，或者因违反反洗钱法律法规被采取监管措施、行政处罚、刑事处罚的，按本条第一款规定减半扣分。

第九条 期货公司的董事、监事、高级管理人员以及实际履行高级管理人员职责的人员在评价期内因对公司违法违规负有责任被中国证监会及其派出机构采取监管措施、行政处罚，或者被司法机关刑事处罚的，按照以下原则进行扣分：

- （一）被采取出具警示函的，每次扣0.5分；
- （二）被采取责令改正、责令参加培训的，每次扣1分；
- （三）被采取监管谈话的，每次扣1.5分；
- （四）被采取认定为不适当人选的，每次扣2分；
- （五）被采取警告行政处罚的，每次扣4分；
- （六）被采取罚款、没收违法所得行政处罚的，每次扣5分；
- （七）被采取期货市场禁入行政处罚的，每次扣8分；
- （八）被采取刑事处罚的，每次扣10分。

对于出现下列情形的，按本条第一款规定扣分：

- （一）期货公司子公司的董事、监事和高级管理人员以及实际履行高级管理人员职责的人员被采取本条第一款所

列示的监管措施、行政处罚或者刑事处罚的；

（二）期货公司股东、实际控制人的相关责任人因违反期货公司监管相关法律法规，被采取本条第一款所列示的监管措施、行政处罚或者刑事处罚，且可能导致期货公司正常经营受到影响或者出现风险隐患的。

期货公司、子公司除董事、监事和高级管理人员以及实际履行高级管理人员职责人员以外的工作人员，分支机构负责人及工作人员被采取本条第一款所列示的监管措施、行政处罚或者刑事处罚的，按本条第一款规定减半扣分，合计最高扣 5 分。

第十条 期货公司及其子公司被中国期货业协会、期货交易所等按照《中华人民共和国期货和衍生品法》规定履行自律管理职责的组织采取纪律处分的，每次扣 0.5 分。期货公司及其子公司管理的资产管理产品被采取纪律处分的，每次扣 0.25 分。

期货公司及其子公司的董事、监事和高级管理人员，以及实际履行高级管理人员职责的人员被采取纪律处分的，每次扣 0.5 分。期货公司及其子公司除上述人员以外的工作人员，分支机构负责人及工作人员被纪律处分的，按上述规定减半扣分，合计最高扣 5 分。

第十一条 期货公司及其分支机构、子公司，期货公司的股东、实际控制人、其他关联人及其相关责任人，期货公司及其子公司的董事、监事和高级管理人员、从业人员及工作人员被采取纪律处分、监管措施、行政处罚、刑事处罚的

次数，按照被出具相关决定书、判决书的数量确定。

第十二条 期货公司及其分支机构、子公司，期货公司的股东、实际控制人、其他关联人及其相关责任人，期货公司及其子公司的董事、监事和高级管理人员、从业人员及工作人员因同一事项被采取多项纪律处分、监管措施、行政处罚、刑事处罚的，按本规定扣分最高的项目进行扣分；因整改不到位再次被采取纪律处分、监管措施、行政处罚、刑事处罚的，分别计算，合并扣分；因同一事项被采取多项纪律处分、监管措施、行政处罚、刑事处罚的，以往评价期已被扣分但未达到已采取措施的最高扣分分值的，按已采取措施的最高扣分分值与以往评价期已扣分值的差额扣分。

期货公司违规行为被采取纪律处分、监管措施、行政处罚、刑事处罚的，无论控股股东或者实际控制人是否发生变更，均应按相应的规定予以扣分。

期货公司被采取的纪律处分、监管措施、行政处罚、刑事处罚发生在评价期内的，在本评价期进行评价；纪律处分、监管措施、行政处罚、刑事处罚发生在评价期外，但涉及的违法违规行为发生在评价期内，且中国证监会及其派出机构和期货业协会、期货交易所等自律组织认为有必要纳入本评价期评价的，做出说明后可以纳入本评价期评价。

第十三条 风险管理能力根据以下标准进行评价：

（一）风险监管指标未达到监管标准的，每月/每项扣 2 分；

（二）期货保证金重大预警，经核实为期货公司原因的，

每次扣 1 分；期货保证金一般预警，经核实为期货公司原因的，每次扣 0.25 分；

（三）因期货公司风险控制不到位导致的错单和穿仓损失金额合计超过当期提取的风险准备金额 10%的，扣 1 分；

（四）期货公司累计发生 3 次及以上一般级别网络安全事件且公司负有责任的，扣 0.5 分；期货公司发生较大及以上级别网络安全事件且公司负有责任的，每次扣 0.5 分；

（五）审计报告及审阅报告被出具非无保留审计意见或审阅意见的，每次扣 3 分。

风险监管指标以期货公司报送的月度风险监管报表为基础进行评价。中国证监会及其派出机构在日常监管中发现风险监管指标未持续达到监管标准的，按照本条第一款第（一）项予以扣分。期货公司风险管理子公司风险控制指标未达到监管标准的，按本条第一款第（一）项予以扣分。

期货公司变更实际控制人并增资，自变更实际控制人行政许可申请获得我会受理至核准期间发生不达标的，可豁免本条第一款第（一）项扣分。但变更不予核准或终止审查、变更后无实际控制人或者变更后未及时增资的除外。

期货公司存在本条第一款、第二款规定情形，同时因相同原因被采取监管措施的，按分值高者扣分。

第十四条 期货公司主动上报中国证监会及其派出机构尚未发现的违规行为，并被采取监管措施的，经中国证监会派出机构认可并做出说明后可以减半扣分。期货公司在评价期内自行纠正上述主动上报的违规行为，及时消除不良影

响，积极堵塞管理漏洞，反映出期货公司合规风控管理制度健全且有效执行的，经中国证监会派出机构认可，并由派出机构做出说明后可以不予扣分。

期货公司及其子公司自行查处董事、监事和高级管理人员、从业人员及工作人员违规并主动上报自律组织采取纪律处分，并自行纠正上述主动上报的违规行为，及时消除不良影响，积极堵塞管理漏洞的，经自律组织认可，并由自律组织做出说明后可以豁免纪律处分扣分。

期货公司在开展自评工作时，存在遗漏、隐瞒等情况的，对应扣分的遗漏、隐瞒事项双倍扣分。

第三章 加分指标及评价方法

第十五条 期货公司分类评价加分指标，包括市场竞争力、服务实体经济能力、专项评价和特殊情形激励。

第十六条 市场竞争力指标根据期货公司在评价期内的业务发展、盈利能力、资本实力等进行评价，按照以下原则加分：

（一）期货公司期货经纪业务手续费净收入排名位于前10%（含）、10%至20%（含）、20%至30%（含）、30%至40%（含）、40%至50%（含）的，分别加2分、1.5分、1分、0.75分、0.5分。期货公司评价期内商品期货及期权手续费率或金融期货及期权手续费率低于全行业平均水平50%的，减半加分；

（二）期货公司资产管理产品日均持仓保证金排名位于前 10%（含）、10%至 20%（含）、20%至 40%（含）、40%至 60%（含）、60%至 80%（含）的，分别加 1 分、0.8 分、0.6 分、0.4 分、0.2 分；

（三）期货公司及风险管理子公司期货做市交易业务综合排名位于前 10%（含）、10%至 20%（含）、20%至 40%（含）、40%至 60%（含）、60%至 80%（含）的，分别加 1 分、0.8 分、0.6 分、0.4 分、0.2 分；

（四）期货公司及风险管理子公司衍生品交易服务实体经济规模排名位于前 10%（含）、10%至 20%（含）、20%至 40%（含）、40%至 60%（含）、60%至 80%（含）的，分别加 1 分、0.8 分、0.6 分、0.4 分、0.2 分；

（五）期货公司期货交易咨询业务净收入排名位于前 10%（含）、10%至 20%（含）、20%至 40%（含）、40%至 60%（含）、60%至 80%（含）的，分别加 0.5 分、0.4 分、0.3 分、0.2 分、0.1 分；

（六）期货公司净资产排名位于前 10%（含）、10%至 20%（含）、20%至 40%（含）、40%至 60%（含）、60%至 80%（含）的，分别加 2 分、1.5 分、1 分、0.75 分、0.5 分；

（七）期货公司月均剩余净资本排名位于前 10%（含）、10%至 20%（含）、20%至 40%（含）、40%至 60%（含）、60%至 80%（含）的，分别加 2 分、1.5 分、1 分、0.75 分、0.5 分；

（八）期货公司净利润排名位于前 10%（含）、10%至 20%（含）、20%至 30%（含）、30%至 40%（含）、40%至 50%（含）的，分别加 2 分、1.5 分、1 分、0.75 分、0.5 分；

（九）期货公司子公司净利润排名位于前 10%（含）、10%至 20%（含）、20%至 30%（含）、30%至 40%（含）、40%至 50%（含）的，分别加 1 分、0.8 分、0.6 分、0.4 分、0.2 分。期货公司设立多家子公司的，按照子公司加总净利润进行排名。

在对本条第一款第（一）项至第（九）项指标开展初评期间，期货公司无法提供审计数据、对应指标无数据或者为负数的，对应的市场竞争力指标不予加分。期货公司、分支机构及子公司开展业务过程中存在违法违规行为，导致被采取本规定第八条第一款第（五）项至第（十一）项所列示的监管措施或者发生重大风险的，对应业务的市场竞争力指标不予加分。期货公司及子公司因本规定第十三条第一款第（一）项被扣分的，本条第一款第（七）项不予加分。

第十七条 服务实体经济能力指标，根据期货公司在评价期内通过期货市场服务产业客户及中长期资金客户的情况进行评价，按照以下原则加分：

（一）产业客户日均持仓大于零且日均持仓排名位于前 20%（含）、20%至 40%（含）、40%至 60%（含）、60%至 80%（含）、80%至 100%（含）的，分别加 2 分、1.5 分、1 分、0.75 分、0.5 分；

(二) 中长期资金客户日均持仓大于零且日均持仓排名位于前 20% (含)、20%至 40% (含)、40%至 60% (含)、60%至 80% (含)、80%至 100% (含) 的, 分别加 1 分、0.8 分、0.6 分、0.4 分、0.2 分;

(三) 中国证监会认可的其他评价内容。

第十八条 中国证监会可以组织相关单位对期货公司服务国家战略、党建与文化建设、信息技术建设等方面进行专项评价, 按照以下原则加分:

(一) 服务国家战略专项评价中, 排名位于参与本项评价的公司前 20% (含)、20%至 40% (含)、40%至 60% (含)、60%至 80% (含)、80%至 100% (含) 的, 分别加 1 分、0.8 分、0.6 分、0.4 分、0.2 分;

(二) 党建与文化建设专项评价中, 排名位于参与本项评价的公司前 20% (含)、20%至 40% (含)、40%至 60% (含)、60%至 80% (含)、80%至 100% (含) 的, 分别加 1 分、0.8 分、0.6 分、0.4 分、0.2 分;

(三) 信息技术建设专项评价中, 排名位于参与本项评价的公司前 20% (含)、20%至 40% (含)、40%至 60% (含)、60%至 80% (含)、80%至 100% (含) 的, 分别加 1 分、0.8 分、0.6 分、0.4 分、0.2 分。

第十九条 期货公司在评价期内与其他期货公司进行合并并且在评价期内已获中国证监会核准的, 存续公司在本评价期和下一评价期分别加 2 分。

在本评价期, 被合并公司其他所有扣分、加分指标, 均

不纳入存续公司评价。

第二十条 期货公司配合监管部门对其他期货公司开展风险处置工作，经公司住所地中国证监会派出机构上报中国证监会认可的，加1分。

第二十一条 期货公司最近3个评价期内（含当前评价期）持续合规状况和风险管理能力满分的，加2分。期货公司经营不满3年的，不适用本条规定。

第四章 公司类别

第二十二条 根据期货公司评价计分的高低，将期货公司分为A（AAA、AA、A）、B（BBB、BB、B）、C（CCC、CC、C）、D、E等5类11个级别。

（一）A类公司持续合规状况、风险管理能力、市场竞争力、服务实体经济能力的综合评价在行业内最高，能够较好控制业务风险；

（二）B类公司持续合规状况、风险管理能力、市场竞争力、服务实体经济能力的综合评价在行业内较高，能够控制业务风险；

（三）C类公司持续合规状况、风险管理能力、市场竞争力、服务实体经济能力的综合评价在行业内一般，风险管理能力与业务规模基本匹配；

（四）D类公司持续合规状况、风险管理能力、市场竞争力、服务实体经济能力的综合评价在行业内较低，潜在风

险可能超过公司可承受范围；

（五）E类公司潜在风险已经变为现实风险，已被采取风险处置措施。

对本评价期内新设立且没有经营记录的期货公司，不纳入本年度评价范围，按照基准分对应的分类评级运用分类评价结果。

第二十三条 A（AAA、AA、A）、B（BBB、BB、B）、C（CCC、CC、C）、D等4类10个级别的公司，由中国证监会每年结合行业发展状况和以前年度分类结果，根据全部期货公司评价计分的分布情况，按照一定的分值区间确定。

第二十四条 被依法采取责令停业整顿，指定其他机构托管、接管等风险处置措施的期货公司，定为E类公司。

第二十五条 期货公司在评价期内存在以下情形的，中国证监会可视情节轻重将公司类别下调1至3个级别；情节严重的，评为D类：

（一）股东虚假出资或者抽逃出资；

（二）超范围经营；

（三）占用、挪用客户资产；

（四）开展业务严重违规，引发重大风险或者造成恶劣影响；

（五）恶意规避监管，包括向监管部门报送的材料有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，不配合现场检查或者调查，隐藏违规事实等。

第二十六条 期货公司未在规定日期之前上报自评结

果的，将公司类别下调 1 个级别；未在确定分类结果期限之前上报自评结果的，评为 D 类。

第二十七条 期货公司在持续经营过程中，期货公司状况发生重大变化且足以导致分类类别调整的，中国证监会有关根据有关情况及时对相关期货公司的分类进行调整。期货公司在持续经营过程中，业务规模、财务状况、股权结构等方面情况的重大变化，不属于调整事由。

上述分类调整属于调高期货公司类别的，E 类公司最高可调至 C 类 C 级，D 类公司最高可调至 C 类 CCC 级，A、B、C 类公司不予调高类别。

期货公司申请调整分类类别的，应当经公司住所地中国证监会派出机构同意后以派出机构名义上报中国证监会。

第二十八条 期货公司合并的，合并后的存续公司在上一年评价期内不存在本规定第二十四条所列违规情形，合并后的存续公司可以自收到中国证监会核准期货公司合并的批复文件之日起，申请将其上一年分类结果调整为原合并各方分类结果中的较高者。合并后的存续公司申请调整分类类别的，应当经公司住所地中国证监会派出机构同意后以派出机构名义上报中国证监会。

第五章 组织实施

第二十九条 期货公司分类评价采取期货公司自评、相关单位初评、评审委员会复核和评审、中国证监会确定评价

结果的方法。

第三十条 期货公司分类评价每年开展 1 次。持续合规状况、风险管理能力和持续合规风控满分激励等的评价指标以上一年度 5 月 1 日至本年度 4 月 30 日为评价期。其余评价事项以上一年度 1 月 1 日至 12 月 31 日为评价期。涉及财务数据、经营数据的，原则上以上一年度经审计报表为准。

第三十一条 期货公司应当按照本规定进行自评，上报以下材料：

（一）对照持续合规状况、风险管理能力和特殊情形激励的评价指标与标准，如实反映公司实际情况及被采取的纪律处分、监管措施、行政处罚、刑事处罚等，经公司法定代表人和公司经营管理负责人、首席风险官签署确认后，上报公司住所地中国证监会派出机构；

（二）按照中国期货市场监控中心、中国期货业协会的要求上报涉及市场竞争力和专项评价指标计算的数据和材料。

第三十二条 中国证监会派出机构根据日常监管掌握的情况，对期货公司持续合规状况、风险管理能力和特殊情形激励的自评结果进行初评和评价计分。

中国期货市场监控中心汇总计算期货公司服务实体经济能力指标、市场竞争力指标得分。

中国期货业协会汇总计算期货公司专项评价指标得分。

中国期货业协会应当将每项专项评价结果向期货公司公示，公示时间不少于 5 个工作日。期货公司对公示结果有

异议的，可以在公示期内向中国期货业协会书面申请复核。

第三十三条 在初评过程中，中国证监会派出机构应当就有关问题进行核查，并与期货公司核对情况，确认事实。中国期货市场监控中心、中国期货业协会应当对相关数据进行校验并就数据差异与期货公司核实，发现重大异常应当通报中国证监会派出机构，中国证监会派出机构应当核查反馈。

期货交易所、全国中小企业股份转让系统、中国期货业协会、中国证券投资基金业协会对期货公司及其子公司、资产管理产品采取纪律处分的，应当通报期货公司住所地中国证监会派出机构。

第三十四条 中国证监会对其派出机构、中国期货市场监控中心、中国期货业协会上报的初评材料进行复核，并根据复核结果评审确定期货公司的具体分值和类别的初步结果，书面告知期货公司。

第三十五条 期货公司因不可抗力等特殊情形，认为有必要申请扣分豁免的，应当提交相应证明材料，经公司住所地中国证监会派出机构同意后以派出机构名义上报中国证监会。

第三十六条 期货公司对复核和评审确定的持续合规状况、风险管理能力和特殊情形激励的评价结果有异议的，可在收到分类结果通知之日起 10 个工作日内提出书面申诉。期货公司提出书面申诉的，应当经公司住所地中国证监会派出机构同意后以派出机构名义上报中国证监会。

第三十七条 申诉期结束后，期货公司分类结果由中国证监会确定并生效。

第六章 分类结果的使用

第三十八条 中国证监会按照分类监管原则，对不同类别的期货公司在监管资源分配、现场检查和非现场检查频率等方面予以差异化安排，对不同类别期货公司按照不同的标准计算风险监管指标。

第三十九条 期货公司分类结果可以作为期货公司及其子公司增加业务类型的审慎性条件。

第四十条 期货公司分类结果将作为确定新业务试点范围和推广顺序的依据。

第四十一条 期货公司分类结果将作为确定期货交易者保障基金不同缴纳比例的依据。

第四十二条 期货公司分类结果主要供中国证监会及其派出机构、期货交易所、中国期货市场监控中心、中国期货业协会等使用。

期货公司不得将分类结果用于广告、宣传、营销等商业目的。

第七章 附则

第四十三条 本规定下列用语的含义：

（一）期货公司子公司，是指期货公司依法设立的风险管理子公司、资产管理子公司和境外子公司；

（二）期货公司子公司高级管理人员，是指子公司的总经理、副总经理以及实际履行上述职务的人员；

（三）纪律处分，是指具有自律管理职责的机构依据其业务规则或自律规则，采取的警告、通报批评、公开谴责、强行平仓、暂停或者限制交易、暂停或者限制业务、罚款、惩罚性违约金、没收违规所得、市场禁入、暂停或者取消会员资格等纪律处分或纪律惩戒措施；

（四）期货保证金重大预警，是指由于期货公司保证金封闭圈内自有资金不足或者保证金出现缺口等事项而导致的预警，以及中国期货市场监控中心认定的其他重大预警情形；期货保证金一般预警，是指除重大预警以外的其他预警；

（五）错单损失，是指期货公司会计年度内因风险控制不到位导致的错单亏损汇总金额，错单盈利不能抵销错单亏损；穿仓损失，是指期货公司会计年度内因风险控制不到位发生的、截至会计年度次年4月30日前未向客户追索成功的穿仓损失金额；

（六）网络安全事件级别，是指按照《证券期货业网络安全事件报告与调查处理办法》标准确定的级别；

（七）经纪业务手续费净收入，是指期货公司经审计的年度监管报表的经纪业务手续费净收入；

（八）手续费率，是指手续费收入/成交金额。其中，手续费收入，是指期货公司向客户收取的交易手续费减去期货

交易场所向期货公司收取的交易手续费，以及期货公司净留存的期货交易场所手续费减收之和。全行业平均水平，是指全行业手续费收入的算术平均值与全行业成交金额的算术平均值之比；

（九）资产管理产品日均持仓保证金，是指期货公司及其子公司管理的资产管理产品评价期内因从事期货、期权交易而被占用的保证金日均值，保证金占用按照期货交易所、证券交易所公布的保证金收取标准和方法计算；

（十）做市交易业务综合排名，是指按以下方法确定的排名：在单个做市品种上，根据期货交易所、证券交易所确定的该品种做市商年度排名，排名第一的做市商得分为评价期末该品种所有做市商的数量，其他做市商得分按照排名每下降一名递减 1 分。若期货公司在评价期内未开展该品种做市业务，则在该品种做市上得分为 0。期货公司在单个做市品种上的得分按照上述规定计算。将期货公司在各个做市品种上的得分相加后的总分进行排名，即为期货公司做市业务综合排名；

（十一）衍生品交易服务实体企业规模排名，是指期货公司及风险管理子公司衍生品交易业务客户日均保证金占用、日均开仓权利金收支两项指标分别排名后加权计算的最终排名，两项指标排名权重各为 50%。其中客户日均保证金占用为对手方保证金占用并减去客户已使用授信规模的日均值，日均开仓权利金收支为权利金收支金额汇总轧差后的日均值。两项指标的数据来源均为中国期货市场监控中心场

外衍生品交易报告库客户资金表。计算时均不包含与期货公司及其子公司、证券公司、保险公司、商业银行、公募基金、私募基金、信托公司等机构开展的衍生品交易业务；

（十二）交易咨询业务净收入，是指期货公司经审计的年度监管报表的交易咨询业务净收入；

（十三）净资产，是指期货公司经审计的年度监管报表的所有者权益；

（十四）月均剩余净资本，是指每月期货公司净资本减去当月风险资本准备后，取 12 个月的算术平均值。1-11 月数据取自期货公司月度监管报表，12 月数据取自期货公司经审计的年度监管报表；

（十五）期货公司净利润，是指期货公司经审计的年度财务报表的净利润；

（十六）子公司净利润，是指期货公司子公司经审计的年度财务报表或监管报表中的净利润；

（十七）产业客户，是指按以下方法确定的客户：一般单位客户开户时，根据其营业执照上标明的经营范围，在开户系统中确定行业分类，再由期货交易所将不同期货及期权品种与行业分类进行逐一关联，由此筛选出与品种关联的一般单位客户即为该品种的产业客户。产业客户不包括特定程序化报备客户；

（十八）产业客户日均持仓，是指按以下方法计算的持仓：本评价期内期货公司所有产业客户每个交易日商品期货、期权持仓量累计值/评价期内的交易日天数；

（十九）中长期资金客户，是指参与金融期货、期权品种交易的保险公司、公募基金、养老金、银行自营、银行理财、信托公司；

（二十）中长期资金客户日均持仓，是指按以下方法计算的持仓：本评价期内期货公司所有中长期资金客户每个交易日金融期货、期权持仓量累计值/评价期内的交易日天数；

（二十一）评价期的交易日天数以境内期货交易所、证券交易所发布的交易日为准。

第四十四条 本规定自公布之日起施行。