

深圳期货监管通讯

2024年第二季度

深圳证监局

2024年7月12日

【本期导读】

近期，证监会主席吴清在2024陆家嘴论坛开幕式上发表主旨演讲，指出要坚决贯彻党中央、国务院决策部署，狠抓新“国九条”的落地见效，突出强本强基、严监严管，全力以赴推动资本市场高质量发展。深圳证监局认真贯彻落实新“国九条”要求和证监会工作部署，坚守资本市场工作的政治性、人民性，组织辖区期货公司开展学习贯彻新“国九条”主题系列宣传报道，联合举办深市上市公司高管期货及衍生品业务高级研修班，认真开展期货公司风险摸排工作。此外，对于近期部分期货公司出现的互联网营销违规、信息技术治理不到位等问题，本期予以通报警示。同时，对辖区招商期货和中信期货探索运用天气衍生品服务乡村振兴经验进行介绍，供学习交流。投稿邮箱：szjgctx@csrc.gov.cn。

目 录

【政策导向】	3
【监管动态】	4
一、深圳期货行业锚定高质量发展积极落实新“国九条”意见	4
二、深圳证监局联合多家单位举办深市上市公司高管期货及衍生品业务高级研修班	4
三、深圳证监局统筹高效推进期货公司风险摸排工作	5
【案例警示】	5
一、部分期货分支机构互联网营销多项违规被采取责令改正监管措施	6
二、部分期货公司信息技术治理不到位被监管问责	6
【经验交流】	6
辖区期货公司创新运用天气衍生品 探索助力乡村振兴新路径	6

【政策导向】

一、4月30日，中共中央政治局召开会议，分析研究当前经济形势和经济工作。会议强调要切实巩固和增强经济回升向好态势，要实施好积极的财政政策和稳健的货币政策。要因地制宜发展新质生产力，加强国家战略科技力量布局。要坚定不移深化改革扩大开放，完善市场经济基础制度。要持续防范化解重点领域风险，持续推动中小金融机构改革化险。要扎实推进绿色低碳发展，持续有力开展“碳达峰十大行动”。要切实保障和改善民生，织密扎牢社会保障网。

二、6月19日，2024陆家嘴论坛召开，吴清主席围绕资本市场高质量发展发表讲话。一是积极主动拥抱新质生产力发展。要提升多层次市场的服务覆盖面和精准度，壮大耐心资本，从制度机制以及理念上解决包容创新的问题。二是大力推动上市公司提升投资价值。进一步引导上市公司树立积极主动回报投资者的意识，支持上市公司运用各种资本市场工具增强核心竞争力。三是坚持把保护投资者贯穿于资本市场制度建设和监管执法全过程。必须把强监管放在更加突出的位置，不断提升资本市场内在稳定性。

三、近日，证监会召开资本市场做好金融“五篇大文章”专题座谈会。会议指出，做好金融“五篇大文章”，既是推动高质量发展的迫切需要，也是切实提升金融服务实体经济质效的重要内容。下一步，证监会将加快改革完善相关基础制度和机制，为经济社会发展重大战略、重点领域、薄弱环节

节提供更高质量的产品和服务，多措并举活跃并购重组市场，健全股、债、期等多层次市场体系，更好服务新质生产力发展和中国式现代化建设。

四、6月21日，红枣、玻璃期权在郑州商品交易所上市交易。

【监管动态】

一、深圳期货行业锚定高质量发展积极落实新“国九条”意见

近日，深圳证监局指导辖区期货公司在《期货日报》开展连续多日的学习贯彻新“国九条”主题系列宣传报道，突出了行业锚定高质量发展，服务产业企业、农业发展和国家战略方面呈现出的多元化服务能力和成效。一是助力提升产业企业发展韧性。深圳多家期货公司结合产业客户需求，制定专项方案做好材料保供和产品保值，保障企业稳健经营，平稳渡过产业“逆风期”。二是探索促进农业稳定发展新模式。深圳多家期货公司围绕乡村振兴目标，在边境之地、边陲小城做大做优“保险+期货”项目，采用价差期权的组合结构降低权利金费用。三是持续加强服务国家战略力度。深圳期货公司发挥专业风险管理能力，积极服务科技创新企业，协助搭建风险管理平台，实现风险防控自动化、智能化，提高价格波动风险防范能力。

二、深圳证监局联合多家单位举办深市上市公司高管期货及衍生品业务高级研修班

近日，深圳证监局联合郑州商品交易所、中国上市公司协会、资本市场学院举办“深市上市公司高管期货及衍生品业务高级研修班”，来自全国17个省（市区）近80家上市公司150余名高管及业务人员参加培训。相关负责人在致辞环节表示，上市公司通过期货和衍生品有效管理风险，与期货市场进行有机结合，正是金融充分发挥服务实体经济功能，落实资本市场高质量发展的重要体现。研修班邀请了各方专家就“新国九条”意见及内容、大宗商品形势、企业运用期货市场管理风险模式、套期保值会计等进行了深入分析，上市公司对期货和衍生品市场认识进一步增强。

三、深圳证监局统筹高效推进期货公司风险摸排工作

近期，深圳证监局集中力量开展2024年期货公司专项排查工作，统筹发挥协作优势，确保专项排查摸得全、查得深、有效果。一是主动沟通，多方统筹检查力量。协同广期所、监控中心、中期协等“五位一体”单位建立联合检查组，确保检查力量到位。二是统筹安排，提高检查工作效率。一方面提前向辖区期货公司下发自查通知和自查底稿，督促开展自查自纠。另一方面梳理年度检查任务，保障充足现场检查时间，查一家、理一家、报一家。三是分类处理，确保取得工作实效。截至6月底，深圳证监局已完成辖区14家期货公司的专项排查。对公司内控管理方面问题，督促公司即查即改；对发现的违规问题，及时采取措施，尽快消除风险隐患。

【案例警示】

一、部分期货分支机构互联网营销多项违规被采取责令改正监管措施

部分期货分支机构由于存在互联网业务管控不到位、宣传内容存在误导性表述、不符合期货交易咨询从业条件的员工发布期货交易咨询建议等问题，被采取责令改正的行政监管措施。辖区各期货经营机构应当建立健全互联网营销内控制度，明确营销渠道、营销内容、第三方合作平台资质等管理规范，采取有效措施加强从业人员执业行为的监测管理，切实保障合规展业。

二、部分期货公司信息技术治理不到位被监管问责

某期货公司存在未及时向当地证监局报告网络安全事件、机房值班人员未按公司规定流程启动交易系统等问题。另一家期货公司存在主席交易系统上线后未开展压力测试的问题。上述行为反映出部分期货公司信息技术治理存在漏洞，可能影响公司业务连续性及客户资金安全，被分别采取责令改正和警示函监管措施。辖区各期货经营机构应当建立健全网络和信息技术管理制度体系，严格履行网络安全事件报告义务，对重要信息系统应当按规定开展压力测试，切实保障公司稳健运营及交易者资金安全。

【经验交流】

辖区期货公司创新运用天气衍生品 探索助力乡村振兴新路径

近年来极端天气事件频发，导致农业生产的不稳定性增

加。为提升农企农户抗风险能力，降低极端天气带来的损失，深圳辖区期货公司立足期货和衍生品特长，积极探索服务乡村振兴新模式。2024年，辖区招商期货、中信期货相继推出挂钩大商所“中央气象台—大商所温度指数”的冻灾指数衍生品工具，其中招商期货落地湖北的“天气衍生品+保险”项目共承保400亩茶园，提供风险保障金额40万元，每亩茶叶最高可获得1000元的赔偿，满足了农户应对冬季低温寒潮天气的避险需求。中信期货落地河南的“天气衍生品+保险”为全国首单主粮作物冻灾指数保险，为小麦种植农户稳产稳收提供了有力保障。下一步，深圳证监局将引导辖区期货公司持续探索服务乡村振兴新模式，以专业优势助力农业稳产增产、农民稳收增收。