

期货课堂：中国金融期货交易所结算细则 PDF转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

https://www.100test.com/kao_ti2020/238/2021_2022__E6_9C_9F_E8_B4_A7_E8_AF_BE_E5_c33_238642.htm 第一章 总则 第一条 为规范期货结算行为，保护期货交易当事人的合法权益和社会公共利益，防范和化解期货市场风险，保障中国金融期货交易所（以下简称交易所）期货结算的正常进行，根据《中国金融期货交易所交易规则》，制定本细则。 第二条 结算业务是指交易所根据交易结果、公布的结算价格和交易所有关规定对交易双方的交易保证金、盈亏、手续费及其它有关款项进行资金清算和划转的业务活动。 第三条 交易所的结算实行保证金制度、当日无负债结算制度、结算担保金制度和风险准备金制度等。 第四条 交易所实行会员分级结算制度。交易所对结算会员结算，结算会员对其受托的客户、交易会员结算，交易会员对其受托的客户结算。 第五条 交易所、会员、客户、期货保证金存管银行应当遵守本细则。 第二章 结算机构 第六条 结算机构是指交易所内设置的结算部和会员的结算部门。交易所结算部负责交易所期货交易的统一结算、保证金管理、结算担保金管理、风险准备金管理及结算风险的防范。 第七条 交易所结算部的主要职责为：（一）登录编制结算会员的结算账表；（二）办理资金往来汇划业务；（三）统计、登记和报告交易结算情况；（四）处理会员交易中的账款纠纷；（五）办理结算、交割业务；（六）管理保证金、结算担保金、风险准备金；（七）控制结算风险；（八）监督期货保证金存管银行与交易所的期货结算业务；（九）法律、行政法规、规章和交易所规定的其他职责。 第八条

会员应当设立结算部门。 第九条 在交易所成交的期货合约均应当通过交易所结算部进行结算。 第十条 交易所实行会员分级结算制度。交易所结算部负责交易所与结算会员之间的结算工作；结算会员的结算部门负责该结算会员与交易所、客户、交易会员之间的结算工作；交易会员的结算部门负责该交易会员和结算会员、客户之间的结算工作。 第十一条 交易所所有权检查会员的结算资料、财务报表及相关的凭证和账册。 第十二条 会员结算部门应当妥善保管结算资料、财务报表及相关凭证、账册，以备查询和核实。 第十三条 结算交割员是指经结算会员单位授权，代表结算会员办理结算和交割业务的人员。每一结算会员应当指派两名以上（含两名）的结算交割员。 结算交割员应当符合中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）关于期货从业人员资格的有关规定，经交易所培训合格，取得《中国金融期货交易所结算交割员培训合格证书》，并经所属结算会员授权后取得《中国金融期货交易所结算交割员证》（以下简称《结算交割员证》）。 第十四条 结算交割员应当履行下列职责：（一）办理结算会员出入金业务；（二）获取交易所提供的结算数据，并及时进行核对；（三）办理其他结算、交割业务。 第十五条 结算交割员在交易所办理结算与交割业务时，应当出示《结算交割员证》，否则交易所不予办理。 第十六条 《结算交割员证》仅限本人使用，不得伪造、涂改、借用。结算会员在其结算交割员发生变动时，应当及时到交易所办理相关手续。 第十七条 结算机构及其工作人员应当保守交易所和会员的商业秘密。 第三章 期货保证金存管银行 第十八条 期货保证金存管银行是与交易所签订协议，协助交易所办理期货交易结

算业务的银行。第十九条 期货保证金存管银行享有下列权利：

- （一）开设交易所专用结算账户和会员期货保证金账户；
- （二）存放用于期货交易的保证金等相关款项；
- （三）了解会员在交易所的资信情况；
- （四）法律、行政法规、规章和交易所规定的其他权利。

第二十条 期货保证金存管银行应当履行下列义务：

- （一）根据交易所提供的票据或者指令优先划转结算会员的资金；
- （二）及时向交易所通报会员在资金结算方面的不良行为和风险；
- （三）保守交易所和会员的商业秘密；
- （四）在交易所出现重大风险时，协助交易所化解风险；
- （五）向交易所提供会员期货保证金账户的资金情况；
- （六）根据交易所的要求，协助交易所核查会员资金的来源和去向；
- （七）根据中国证监会或者交易所的要求，对会员期货保证金账户中的资金采取必要的监管措施；
- （八）根据交易所交易规则及其实施细则开展业务；
- （九）法律、行政法规、规章和交易所规定的其他义务。

第四章 日常结算

第二十一条 交易所在期货保证金存管银行开设专用结算账户，用于存放结算会员的保证金及相关款项。

第二十二条 结算会员应当在期货保证金存管银行开设期货保证金账户，用于存放保证金及相关款项。

第二十三条 结算会员在交易所所在地的期货保证金存管银行开设的期货保证金账户称为专用资金账户。交易所与结算会员之间期货业务资金的往来通过交易所专用结算账户和结算会员专用资金账户办理。

第二十四条 交易所对结算会员存入交易所专用结算账户的保证金实行分账管理，为各结算会员设立明细账户，按日序时登记核算每一结算会员出入金、盈亏、交易保证金、手续费等。

第二十五条 结算会员对客户、交易会员存入结算会员保证金账户的

保证金实行分账管理，为每一客户、交易会员设立明细账户，按日序时登记核算出入金、盈亏、交易保证金、手续费等。

第二十六条 交易会员只能委托一家特别结算会员或者全面结算会员为其进行结算。

第二十七条 交易所实行结算担保金制度。结算担保金是指由结算会员依交易所规定缴纳的，用于应对结算会员违约风险的共同担保资金。

第二十八条 交易所在银行开立结算担保金专用账户，对结算会员缴纳的结算担保金进行专户管理。结算会员应当在交易所指定的银行开立结算担保金专用账户，用于与交易所结算担保金专用账户之间进行结算担保金缴纳、调整的资金划转。结算担保金的缴纳、调整的标准按照《中国金融期货交易所风险控制管理办法》及其他相关规定执行。

第二十九条 交易所在结算担保金专用账户下为每一结算会员设立明细账户，并按照中国证监会和交易所有关规定进行管理，所得收入在扣除必要费用和税费后依照相关规定返还结算会员。交易所按照季度核算每一结算会员的结算担保金变化。

第三十条 交易所、结算会员应当按照有关规定和期货保证金存管银行签订期货保证金存管协议。交易所所有权在不通知结算会员的情况下通过期货保证金存管银行从结算会员专用资金账户中收取各项应收款项，并且有权随时查询该账户的资金情况。

第三十一条 结算会员开立、更名、更换或者注销专用资金账户，应当凭交易所签发的专用通知书到期货保证金存管银行办理。

第三十二条 交易所实行保证金制度。保证金分为结算准备金和交易保证金。

第三十三条 结算准备金是指结算会员在交易所专用结算账户中预先准备的资金，是未被合约占用的保证金。

第三十四条 结算会员的结算准备金最低余额标准为人民币200万元

，应当以自有资金缴纳。交易所所有权根据市场情况调整结算会员结算准备金最低余额标准。第三十五条 交易所根据结算会员每日结算准备金余额中的货币资金部分，以不高于交易所与银行协商确定的利率标准计算利息，在每年的3月下旬、6月下旬、9月下旬、12月下旬将利息划入结算会员专用资金账户或者转入结算会员结算准备金。第三十六条 交易保证金是指结算会员存入交易所专用结算账户中确保履约的资金，是已被合约占用的保证金。当买卖双方成交后，交易所按照保证金标准向双方收取交易保证金。交易所按照买入和卖出的持仓量分别收取交易保证金。第三十七条 交易保证金的收取标准按照《中国金融期货交易所风险控制管理办法》的有关规定执行。第三十八条 结算会员向客户、交易会员收取交易保证金的标准不得低于交易所向结算会员收取交易保证金的标准。交易会员向客户收取交易保证金的标准不得低于结算会员向交易会员收取交易保证金的标准。第三十九条 交易所实行当日无负债结算制度。当日交易结束后，交易所按照当日结算价对结算会员结算所有合约的盈亏、交易保证金及手续费、税金等费用，对应收应付的款项实行净额一次划转，相应增加或者减少结算准备金。100Test 下载频道开通，各类考试题目直接下载。详细请访问 www.100test.com