

《中国金融期货交易所结算会员结算业务细则》 PDF转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

https://www.100test.com/kao_ti2020/326/2021_2022__E3_80_8A_E4_B8_AD_E5_9B_BD_E9_c36_326582.htm 第一章 总则第一条 为规范结算会员的期货结算行为，加强对结算会员结算业务的监督管理，根据《期货公司金融期货结算业务试行办法》和《中国金融期货交易所交易规则》，制定本细则。第二条 本细则所称结算会员结算业务是指中国金融期货交易所（以下简称交易所）特别结算会员、全面结算会员对其受托结算的交易会员办理的期货结算业务。第三条 结算会员从事期货结算业务，应当遵守法律、行政法规、规章和交易所交易规则及其实施细则，建立健全内部控制制度，审慎经营，履行诚信义务。第四条 结算会员从事期货结算业务时，应当公平对待交易会员及其客户，不得从事不正当竞争。第五条 结算会员、交易会员应当遵守本细则。第二章 结算协议第六条 交易会员应当委托结算会员为其进行结算，且只能委托一家结算会员为其进行结算。第七条 结算会员受托为交易会员结算，应当签订结算协议，并报交易所备案。第八条 结算会员与交易会员签订结算协议，应当遵守法律、行政法规、规章和交易所的规定，协议应当包括下列内容：（一）交易指令下达方式及审查或者验证措施；（二）保证金标准；（三）交易会员结算准备金最低余额；（四）风险管理措施、条件及程序；（五）结算流程；（六）手续费标准。（七）通知事项、方式及时限；（八）不可归责于协议双方当事人所造成损失的情形及其处理方式；（九）协议变更和解除；（十）违约责任；（十一）争议处理方式；（十二）双方约定的且不

违反法律、行政法规、规章规定的其他事项。第九条 结算协议期满且协议双方中的一方不再续约的，应当在协议约定期限内向另一方提出。第十条 结算协议履行期间，协议双方中的一方欲提前终止协议的，应当在协议约定期限内向另一方提出并取得一致意见。第十一条 结算会员与交易会员签订结算协议，发生下列情形之一的，应当于5个交易日内报交易所备案：（一）修改结算协议条款；（二）终止结算协议；（三）结算协议到期；（四）交易所规定的其他情形。第十二条 交易会员更换结算会员的，应当在交易会员和移出结算会员结算协议期满前30日之前向交易所申请办理更换结算会员手续。第十三条 结算会员应当保守交易会员的商业秘密。第三章 交易第十四条 交易会员应当按照交易所的规定为其客户申请交易编码。交易所将开户成功和交易编码的确认信息发送给交易会员后，交易会员应当及时告知结算会员。第十五条 交易会员注销客户交易编码的，按照前条规定的程序办理。第十六条 交易会员下达的交易指令应当通过结算会员进入交易所。结算会员可以按照结算协议的约定对交易会员的指令采取必要的限制措施。第十七条 结算会员应当按照时间优先的原则传递交易会员的交易指令。第十八条 交易会员下达的交易指令进入交易所后，结算会员应当及时将从交易所取得的委托回报和成交结果反馈给交易会员。第十九条 交易会员对委托回报和成交结果有异议的，应当在当日及时向结算会员、交易所提出。第二十条 客户申请套期保值额度的，应当向其开户的交易会员申报，交易会员对申报材料进行审核后向交易所办理申请手续。交易所对客户的套期保值申请材料进行审核，确定其套期保值额度后，应当及时将套期保值

额度告知结算会员和交易会员。第二十一条 交易会员申请套期保值额度的，直接向交易所办理申请手续。交易所对交易会员的套期保值申请材料进行审核，确定其套期保值额度后，应当及时将套期保值额度告知结算会员和交易会员。第四章 结算第二十二条 特别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，用于存放交易会员的保证金及相关款项。全面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，用于存放其客户和交易会员的保证金及相关款项。交易会员是期货公司的，应当在期货保证金存管银行开设期货保证金账户，用于存放其客户保证金及相关款项。交易会员不是期货公司的，应当在期货保证金存管银行开设期货结算账户，用于存放其保证金及相关款项。第二十三条 结算会员向交易会员收取的保证金归交易会员所有。除用于交易会员的期货交易外，任何机构或者个人不得占用、挪用。交易会员向客户收取的保证金归客户所有。除用于客户的期货交易外，任何机构或者个人不得占用、挪用。第二十四条 交易会员是期货公司的，其与结算会员的期货业务资金往来，只能通过各自的期货保证金账户办理。交易会员不是期货公司的，其与结算会员的期货业务资金往来，通过交易会员的期货结算账户和结算会员的期货保证金账户办理。第二十五条 结算会员应当对交易会员存入结算会员期货保证金账户的保证金实行分账管理，为每一交易会员设立明细账户，按日序时登记核算每一交易会员的出入金、盈亏、交易保证金、手续费等。第二十六条 结算会员为交易会员结算应当按照买入和卖出的持仓量分别收取交易保证金，且交易保证金标准不得低于交易所对该结算会员的收取标准。第二十七条 结算会

员和交易会员应当在结算协议中约定交易会员结算准备金最低余额。结算准备金最低余额不得低于人民币50万元，交易会员应当以自有资金缴纳。第二十八条 结算会员为交易会员结算的，应当建立并执行当日无负债结算制度。当日交易结束后，结算会员应当根据交易所公布的当日结算价，按照交易所的计算方法计算交易会员所有合约的盈亏，同时计算交易保证金及手续费、税金等费用。当日盈利划入交易会员结算准备金，当日亏损从交易会员结算准备金中扣划。交易会员账户中的交易保证金超过上一交易日结算时的交易保证金部分从结算准备金中扣划，交易保证金低于上一交易日结算时的交易保证金部分划入结算准备金。手续费、税金等费用从交易会员的结算准备金中扣划。第二十九条 结算会员应当按照结算协议的约定，为交易会员办理出入金，无正当理由不得拖延。第三十条 结算会员应当与交易会员约定结算数据收取、查询和确认的时间和方式。结算会员应当本着安全、准确、及时的原则为交易会员发送结算数据。结算会员对交易会员的所有结算科目的内容、格式、处理方式和处理日期应当与交易所保持一致。第三十一条 交易会员对结算会员发送的结算数据有异议的，应当以书面形式在结算协议约定的时间内提出；交易会员对结算数据无异议的，应当按照结算协议约定的方式确认。交易会员在结算协议约定的时间内既未对结算数据的内容确认，也未提出异议的，视为对结算数据内容的确认。交易会员有异议的，结算会员应当在结算协议约定的时间内予以核实。交易会员未在结算协议约定的时间内提出异议的，不得再提出异议。第三十二条 交易会员和结算会员可以根据《中国金融期货交易所结算细则》的规定

向交易所提出办理交易会员更换结算会员的申请。交易所批准交易会员更换结算会员的，移出结算会员、交易会员和移入结算会员应当于交易所通知的日期变更委托结算关系。第三十三条 在交易所办理交易会员更换结算会员业务过程中，交易会员和结算会员应当相互予以配合。第五章 风险管理第三十四条 结算会员对其受托的客户和交易会员进行风险管理，交易会员对其受托的客户进行风险管理。第三十五条 结算会员应当依照中国证监会、交易所的规定建立对其受托的客户和交易会员的保证金管理制度。第三十六条 结算会员可以根据交易会员的资信及市场情况调整保证金标准。第三十七条 调整期货合约交易保证金标准的，结算会员应当在当日结算时对该合约的所有持仓按照调整后的交易保证金标准进行结算。交易会员保证金不足的，应当在下一个交易日开市前追加到位。第三十八条 交易所开市前，交易会员结算准备金余额小于规定或者约定最低余额的，结算会员应当禁止其开仓。第三十九条 结算会员不得向交易会员收取结算担保金。第四十条 全面结算会员的持仓超过交易所持仓限额的，其客户、交易会员均不得同方向开仓交易；特别结算会员的持仓超过交易所持仓限额的，其交易会员不得同方向开仓交易。第四十一条 交易会员客户的持仓达到交易所规定的持仓报告标准的，客户应当通过交易会员于下一交易日收市前向交易所报告。客户未报告的，交易会员应当向交易所报告。第四十二条 结算会员应当建立并执行对交易会员的强行平仓制度。第四十三条 交易会员的结算准备金余额低于约定标准的，应当及时追加保证金或者自行平仓。交易会员未在结算协议约定的时间内追加保证金或者自行平仓的，结算会员有权将

该交易会员的持仓强行平仓。第四十四条 发生下列情形的，结算会员应当按照结算协议约定的原则和措施对交易会员及其客户的持仓采取强行平仓措施：（一）交易会员的结算准备金余额小于零且未能在结算协议约定时间内补足；（二）交易会员或者其客户发生其他应当予以强行平仓的违规违约行为。第四十五条 结算会员和交易会员在结算协议中应当约定强行平仓执行原则。强行平仓可以参照交易所的执行原则，也可以采取其他原则。第四十六条 结算会员对交易会员采取强行平仓措施的，强行平仓发生的费用、损失以及因市场原因无法强行平仓造成的损失扩大部分均由交易会员承担。交易会员承担损失后，有权向有责任的客户追偿。第四十七条 交易所根据规定进行强制减仓的，结算会员应当配合交易所实施强制减仓，化解市场风险。第四十八条 交易所根据规定宣布进入异常情况的，结算会员应当配合交易所化解市场风险。第四十九条 交易会员在期货交易中违约的，应当承担违约责任。结算会员应当先以该交易会员的保证金承担其违约责任。保证金不足的，结算会员应当以风险准备金和自有资金代为承担违约责任，并由此取得对该交易会员的相应追偿权。第五十条 结算会员认为必要的，可以对交易会员进行风险提示。第六章 监督管理第五十一条 结算会员、交易会员及其从业人员应当遵守国家有关法律、行政法规、规章和交易所交易规则及其实施细则等规定，接受中国证监会和交易所的监督和管理。第五十二条 结算会员应当谨慎、勤勉地办理期货结算业务，控制结算业务风险；建立结算业务风险隔离机制和保密制度，平等对待结算会员的客户、交易会员及其客户，防范利益冲突，不得利用结算业务关系及因此获得的

信息损害交易会员及其客户的合法权益。第五十三条 交易会员应当谨慎、勤勉地控制其客户交易风险，不得利用结算业务关系损害为其结算的结算会员及其客户的合法权益。第五十四条 交易结算会员不得为交易会员进行结算；全面结算会员、特别结算会员只能为符合规定条件的交易会员进行结算。第五十五条 结算会员应当将自有资金与受托结算的交易会员保证金分账管理，交易会员保证金应当专户存储，严禁挪用。第五十六条 结算会员不得将收取的交易会员保证金用于自身经营活动或者清偿自身债务；不得允许他人使用交易会员保证金或者用交易会员保证金为他人经营活动提供担保。第五十七条 结算会员不得以任何方式欺诈交易会员。第五十八条 结算会员、交易会员应当维护交易所的声誉，协助交易所处理各种突发或者异常事件。出现突发或者异常事件时，结算会员应当做好交易会员和客户的解释工作。第七章 附则第五十九条 违反本细则规定的，交易所按照本细则和《中国金融期货交易所违规违约处理办法》的有关规定处理。第六十条 本细则由交易所负责解释。第六十一条 本细则自2007年6月27日起实施。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