附件2

上海期货交易所结算细则

（修订案）

**第七条** 结算机构的主要职责：

（一）控制结算风险；

（二）登录和编制会员的结算帐账表；

（三）办理资金往来汇划业务；

（四）统计、登记和报告交易结算情况；

（五）处理会员交易中的帐账款纠纷；

（六）办理交割结算业务；

（七）按规定管理保证金。

**第九条** 交易所可以检查会员的结算资料、财务报表及相关的凭证和帐账册，会员应当予以配合。

**第十条** 会员应当设立结算部门。期货公司会员结算部门负责会员与交易所、会员与客户之间的结算工作；非期货公司会员结算部门负责会员与交易所之间的结算工作。

结算部门应当妥善保管结算资料、财务报表及相关凭证、帐账册，以备查询和核实。

**第十八条** 存管银行的权利：

（一）开设交易所专用结算帐账户、会员专用资金帐账户及其他与结算有关的帐账户；

**第十九条** 存管银行的义务：

（一）根据交易所提供的票据或数据优先划转会员的资金，并及时将资金划转结果和相关帐账户变动信息反馈给交易所；

（二）保守交易所和会员的商业秘密；

（三）在交易所出现重大风险时，应当协助交易所化解风险；

（四）接受交易所对其期货保证金存管业务进行监督。

1．向交易所提供会员专用资金帐账户的资金情况；

2．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；

3．向交易所及时通报会员在资金结算方面的不良行为和风险；

4．向交易所及时通报会员标准仓单的质押情况；

5．根据中国证监会或交易所的要求，对会员专用资金帐账户中的资金实行必要的监管措施。

**第二十条** 交易所在各存管银行开设一个专用的结算帐账户，用于存放会员的保证金及相关款项。

**第二十一条** 会员应当在存管银行开设专用资金帐账户，用于存放保证金及相关款项。

**第二十二条** 交易所与会员之间期货业务资金的往来通过交易所专用结算帐账户和会员专用资金帐账户办理。

**第二十三条** 交易所对会员存入交易所专用结算帐账户的保证金实行分帐账管理，为每一会员设立明细帐账户，按日序时登记核算每一会员出入金、盈亏、交易保证金、手续费等。

**第二十四条** 期货公司会员对客户存入会员专用资金帐账户的保证金实行分帐账管理，为每一客户设立明细帐账户，按日序时登记核算每一客户出入金、盈亏、交易保证金、手续费等。

**第二十五条** 交易所可以在不通知会员的情况下通过存管银行从会员的专用资金帐账户中收取各项应收款项，并可以随时查询该帐账户的资金余额和往来情况。

**第二十六条** 会员开立、更名、更换或注销专用资金帐账户，应当向交易所提出申请，经同意后凭交易所结算机构签发的《专用通知书》到存管银行办理。

**第二十七条** 会员转让会员资格，受让方应当重新开立专用资金帐账户。

**第二十九条** 结算准备金是指会员为了交易结算在交易所专用结算帐账户中预先准备的资金，是未被合约占用的保证金。

**第三十一条**  交易保证金是指会员存入交易所专用结算帐账户中确保合约履行的资金，是已被合约占用的保证金。当买卖双方成交后，交易所按持仓合约价值的一定比率或交易所规定的其他方式向双方收取交易保证金。

**第三十四条** 期货公司会员代理客户交易，向客户收取的保证金属于客户所有，应当存放于会员专用资金帐账户，以备随时交付保证金及有关费用。

**第四十二条** 结算完毕后，会员的结算准备金低于最低余额时，该结算结果即视为交易所向会员发出的追加保证金通知，两者的差额即为追加保证金金额。

交易所发出追加保证金通知后，可以通过存管银行从会员的专用资金帐账户中扣划。若未能全额扣款成功，会员应当在下一交易日开市前补足至结算准备金最低余额。未补足的，若结算准备金余额大于零而低于结算准备金最低余额，不得开新仓；若结算准备金余额小于零，则交易所将按《上海期货交易所风险控制管理办法》的规定进行处理。

**第四十三条** 会员划拨资金的方式：

（二）票据支付。会员也可以用专用资金帐账户开出的支票、本票和贷记凭证入金。会员用此方式划入的资金，经存管银行确认到帐账后，交易所将在不迟于确认时间的下一节交易前增加会员在交易所内的结算准备金。

**第五十条** 交易所在交易结算完成后，将会员资金的划转数据传递给有关存管银行。存管银行应当及时将划帐账结果反馈给交易所。

**第五十一条** 交易所将在每月的第一个交易日向会员提供上月的《上海期货交易所资金结算表》（加盖结算专用章）、《上海期货交易所发票》（手续费），作为会员核查交易帐账簿记录的依据。

**第五十九条** 交割货款结算实行一收一付，先收后付的方法。交割货款的收付可以选择使用内转或银行划转方式办理。使用内转方式的会员最迟应当在第三交割日14:00前向交易所提交《会员交割货款内转申请》，交易所在会员结算准备金中内转交割货款。使用银行划转方式的会员，其买方交割货款可以用贷记凭证、本票、支票或交易所认可的其他方式划入交易所专用结算帐账户，卖方交割货款由交易所划至会员专用资金帐账户。

**第六十条** 交割结算的基准价为该期货合约最后交易日的结算价，但燃料油期货交割结算的基准价按照《上海期货交易所燃料油期货交割实施细则（试行）》第二十二四条确定，黄金期货交割结算的基准价按照《上海期货交易所黄金期货交割实施细则（试行）》第二十四条确定，天然橡胶期货交割结算的基准价按照《上海期货交易所交割细则》相关规定确定，石油沥青期货交割结算的基准价按照《上海期货交易所石油沥青期货交割实施细则（试行）》相关规定确定。交割商品计价以交割结算基准价为基础，再加上不同等级商品质量升贴水以及非基准交割仓库与基准交割仓库的升贴水。

**第六十四条** 黄金期货、燃料油期货交割结算、出入库溢短结算及发票流程按照《上海期货交易所黄金期货交割实施细则（试行）》第五章相关规定执行。、《上海期货交易所燃料油期货交割实施细则》有关规定执行。

**第七十一条** 交易所按照会员在交易所专用结算帐账户中的实有货币资金的4倍（配比乘数）确定会员以有价证券充抵保证金的最大配比金额。交易所可以根据市场风险情况和会员的资信情况调整各会员的配比乘数。

附件一：

专 用 通 知 书

(样本)

No：

\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 银行\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_：

现有本所会员\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_（会员号：\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ ) 前来贵行办理专用资金帐账户的开户 / 销户 / 更名手续，请予接待，并请在办完手续的当天将所附回执返还我部。

 特此通知。

 上海期货交易所结算部

 年 月 日

附：更名会员的新名称（ ）

No：

回 执

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 业 务 | 开户 / 销户 /更名 | 户 名 |  |
| 会员号 |  | 帐账 号 |  |
| 银 行 |  | 原户名 |  |
| 启用/ 销户日期 |  | 期货保证金存管银行业务章年 月 日 |
| 经 办 人 |  |
| 填写说明：1. 业务栏请勾划相应内容2. 更名时应当填写原户名3. 开户、更名时填写与会员约定的启用日期，销户时填写销户日期 |