

中国金融期货交易所结算会员 结算业务细则

(2007年6月27日实施 2010年2月20日第一次修订
2019年12月14日第二次修订)

第一章 总则

第一条 为规范结算会员的期货结算行为，加强对结算会员的监督管理，根据《期货交易管理条例》、《期货交易管理条例实施办法》及《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是指在中国金融期货交易所（以下简称交易所）注册，取得结算会员资格，接受交易所委托，为其受托交易会员办理的期货结算业务。

第三条 本细则所称结算会员是指在中国金融期货交易所注册，取得结算会员资格，接受交易所委托，为其受托交易会员办理的期货结算业务。

第二章 结算关系的确立与变更

第四条 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。

第五条 交易会员应当与结算会员签订结算协议，明确双方的权利义务关系。

第六条 交易会员应当与结算会员签订结算协议，明确双方的权利义务关系。

家期，的规则。本协议应当包括下列内容：
内容：

(一) 交易保证金及保证金或履约担保

(二) 保证金标准；

(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。

第七条 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) 解除结算协议；

(三) 交易所规定的其他情形。

第八条 交易会员和结算会员变更结算关系，应当根据《中国金融期货交易所结算细则》及相关规定办理手续，相关会员应当相互配合。

第三章 交易

第九条 会员应当遵守有关法律、行政法规和交易所规则，按照有关规定办理，并及时告知结算会员。

第十条 会员下达的交易指令应当通过结算会员的审查或者验证后进入交易所。

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。

第十一条 结算会员传递交易会员的交易指令，应当遵守时间优先的原则。

第十二条 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。

第十三条 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。

第四章 结算

第十四条 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。

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，用于存放其客户的保证金

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。

第十五条 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，任何机构或个人不得占用、挪用。

第十六条 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。

第十七条 结算会员应当对交易会员存入结算会员期
明细账户，按日序时登记核算每一交易会员的出入金、盈亏、期权权利金、交易保证金、手续费等。

第十八条 结算会员为交易会员结算应当根据交易保证金标准和持仓合约价值收取交易保证金，且交易保证金标准不得低于交易所对结算会员的收取标准。

第十九条 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限额，结算准备金最低限额不得低于人民币 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。

当日收市后，结算会员应当根据交易所公布的当日结算价，按照交易所的结算办法计算当日会员所占有的权益，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一交易日的交易保证金部分划入结算准备金。

当日盈利扣除手续费、税金等费用后从交易会员的结算准备金中扣划。

第二十一条 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。

第二十二条 结算会员应当与交易会员约定结算数据收取、核对和确认的时间和方式。结算会员应当遵守准确、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。

第二十三条 交易会员应当在结算会员发送结算数据当日予以书面确认。交易会员应当在结算协议约定的时间内，对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。

交易会员应当在结算协议约定的时间内对交易会员发送的

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。

第五章 风险管理

第二十四条 结算会员对其客户和受托交易会员进行风险管理，交易会员对其客户进行风险管理。

第二十五条 结算会员应当依照中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）和交易所的规定建立对其客户、受托交易会员的监控系统。

第二十六条 结算会员应当根据交易会员的违约情况和市场情况调整保证金标准。

第二十七条 结算会员调整受托交易会员的交易保证金标准的，应当在当日结算时，对交易会员相关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。

第二十八条 交易所开市前，交易会员结算准备金余额不得低于交易所规定的最低金额。结算会员应当将其平仓，且

第二十九条 结算会员不得向交易会员收取结算准备金。

第三十条 全面结算会员的持仓达到或者超过交易所持仓限额的，其客户、受托交易会员均不得同方向开仓交易；

托交易会员不得同方向开仓交易。

第三十一条 结算会员应当遵守下列强行平仓交易会员的持仓限额和持仓比例。

第三十二条 交易会员的结算准备金余额小于零且未能在规定的时间内补足时，结算会员应当立即强行平仓，并依法处置未平仓合约。

第三十三条 交易会员的结算准备金余额小于零且未能在规定的时间内补足时，结算会员应当立即强行平仓，并依法处置未平仓合约。

第三十三条 交易会员的结算准备金余额小于零且未能在规定的时间内补足时，结算会员应当立即强行平仓，并依法处置未平仓合约。

除前款规定外，结算会员可以与交易会员在结算协议中约定应当予以强行平仓的其他情形。

第三十四条 结算会员和交易会员在强行平仓时，应当遵循下列原则，也可以采取其他原则。

第三十五条 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。

第三十六条 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，并由此取得对该交易会员的相应追偿权。

~~第二十六条~~ 结算会员认为必要的，可以对交易会员进行平仓处理。

第六章 监督管理

第三十八条 结算会员、交易会员及其从业人员应当遵守有关法律、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管理。

~~第二十六条~~ 结算会员应当谨慎、勤勉地办理期货结算业务，公平对待结算会员的客户、交易会员及其客户，防范利益冲突，保守交易会员的商业秘密，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。

第四十条 ~~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

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。

第四十二条 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担保。

第四十三条 ~~结算会员~~

的解释工作。

第四十四条

依照有关法律、行政法规、规章及交易所规则，加强交易会员交易行为的合法合规性管理。

第七章 附则

第四十五条

“本细则所称会员是指符合《交易所章程》规定的条件，经交易所核准，取得会员资格，并依法开展业务的自然人、法人或者其他组织。”

第四十六条 本细则由交易所负责解释。

第四十七条 本细则自 2019 年 12 月 23 日起实施。