

# 期货公司金融期货结算业务试行办法

(2007年4月19日证监发[2007]54号公布,根据2017年12月7日《中国证监会关于修改、废止〈证券公司次级债管理规定〉等十三部规范性文件的决定》修改)

## 第一章 总则

**第一条** 为了规范期货公司金融期货结算业务,维护期货市场秩序,防范风险,根据《期货交易管理条例》,制定本办法。

**第二条** 本办法所称期货公司金融期货结算业务,是指期货公司作为实行会员分级结算制度的金融期货交易所(以下简称期货交易所)的结算会员,依据本办法规定从事的结算业务活动。

**第三条** 期货公司从事金融期货结算业务,应当遵守本办法。

**第四条** 中国证监会及其派出机构依法对期货公司从事金融期货结算业务实行监督管理。

中国期货业协会和期货交易所依法对期货公司的金融期货结算业务实行自律管理。

## 第二章 业务规则

**第五条** 交易结算会员期货公司可以受托为客户办理金融期货结算业务，不得接受非结算会员的委托为其办理金融期货结算业务。

**第六条** 全面结算会员期货公司可以受托为其客户以及非结算会员办理金融期货结算业务。

**第七条** 全面结算会员期货公司为非结算会员结算，应当签订结算协议。结算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)非结算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)通知事项、方式及时限；

(七)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；

(八)协议变更和解除；

(九)违约责任；

(十)争议处理方式；

(十一)双方约定且不违反法律、行政法规规定的其他事项。

**第八条** 非结算会员的客户申请或者注销其交易编码的，由非结算会员按照期货交易所的规定办理。

**第九条** 非结算会员下达的交易指令应当经全面结算会员期货公司审查或者验证后进入期货交易所。全面结算会员期货公司可以按照结算协议的约定对非结算会员的指令采取必要的限制措施。

**第十条** 非结算会员下达的交易指令进入期货交易所后，期货交易所应当及时将委托回报和成交结果反馈给全面结算会员期货公司和非结算会员。

非结算会员对委托回报和成交结果有异议的，应当及时向全面结算会员期货公司和期货交易所提出。

**第十一条** 全面结算会员期货公司应当在期货保证金存管银行开设期货保证金账户，用于存放其客户和非结算会员的保证金。

全面结算会员期货公司的期货保证金账户应当与其自有资金账户相互独立、分别管理。

全面结算会员期货公司应当为每个非结算会员开立一个内部专门账户，明细核算。

**第十二条** 非结算会员是期货公司的，其与全面结算会员期货公司期货业务资金往来，只能通过各自的期货保证金账户办理。

非结算会员的客户出入金，只能通过非结算会员的期货保证金账户办理。

**第十三条** 全面结算会员期货公司向非结算会员收取的保证金除用于非结算会员的期货交易外，任何机构或者个人不得占用、挪用。

非结算会员向客户收取的保证金属于客户所有，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。

**第十四条** 全面结算会员期货公司和非结算会员在结算协议中约定全面结算会员期货公司的期货保证金账户中非结算会员结算准备金最低余额的，应当符合中国证监会、期货交易所的有关规定。结算准备金最低余额应当由非结算会员以自有资金向全面结算会员期货公司缴纳。

**第十五条** 全面结算会员期货公司应当按照结算协议约定的保证金标准向非结算会员收取保证金。

全面结算会员期货公司向非结算会员收取的保证金，不得低于期货交易所向全面结算会员期货公司收取的保证金标准。

**第十六条** 全面结算会员期货公司应当建立并执行当日无负债结算制度。

期货交易所对全面结算会员期货公司结算后，全面结算会员期货公司应当根据期货交易所结算结果及时对非结算会员进行结算，并出具交易结算报告。

全面结算会员期货公司对非结算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期货交易所保持一致。

全面结算会员期货公司应当确保交易结算报告真实、准确和完整。

**第十七条** 非结算会员向期货交易所支付的手续费，由期货交易所从全面结算会员期货公司期货保证金账户中划拨。

**第十八条** 除下列情形外，全面结算会员期货公司不得划转非结算会员保证金：

(一)依据非结算会员的要求支付可用资金；

(二)收取非结算会员应当交存的保证金；

(三)收取非结算会员应当支付的手续费、税款及其他费用；

(四)双方约定且不违反法律、行政法规规定的其他情形。

**第十九条** 非结算会员应当按照结算协议约定的时间和方式查询交易结算报告。

**第二十条** 非结算会员对交易结算报告的内容有异议的，应当在结算协议约定的时间内书面向全面结算会员期货公司提出异议；非结算会员对交易结算报告的内容无异议的，应当按照结算协议约定的方式确认。非结算会员在结算协议约定的时间内既未对交易结算报告的内容确认，也未提出异议的，视为对交易结算报告内容的确认。

非结算会员有异议的，全面结算会员期货公司应当在结算协议约定的时间内予以核实。

**第二十一条** 全面结算会员期货公司应当按照中国证监会、期货交易所的规定，建立对非结算会员的保证金管理制度。

全面结算会员期货公司可以根据非结算会员的资信及市场情况调整保证金标准。

**第二十二条** 全面结算会员期货公司应当按照期货交易所的规定，建立并执行对非结算会员的限仓制度。

**第二十三条** 非结算会员客户的持仓达到期货交易所规定的持仓报告标准的，客户应当通过非结算会员向期货交易所报告。客户未报告的，非结算会员应当向期货交易所报告。

**第二十四条** 非结算会员的结算准备金余额低于规定或者约定最低余额的，应当及时追加保证金或者自行平仓。非结算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，全面结算会员期货公司有权对该非结算会员的持仓强行平仓。

**第二十五条** 非结算会员的结算准备金余额小于零并未能在约定时间内补足的，全面结算会员期货公司应当按照约定的原则和措施对非结算会员或者其客户的持仓强行平仓。

除前款规定外，全面结算会员期货公司可以与非结算会员在结算协议中约定应予强行平仓的其他情形。

**第二十六条** 期货交易所开市前，非结算会员结算准备金余额小于规定或者约定最低余额的，全面结算会员期货公司应当禁止其开仓。

**第二十七条** 非结算会员在期货交易中违约的，应当承担违约责任。

全面结算会员期货公司先以该非结算会员的保证金承担该非结算会员的违约责任；保证金不足的，全面结算会员期货公司应当以风险准备金和自有资金代为承担违约责任，并由此取得对该非结算会员的相应追偿权。

**第二十八条** 全面结算会员期货公司认为必要的，可以对非结算会员进行风险提示。

### 第三章 监督管理

**第二十九条** 全面结算会员期货公司、交易结算会员期货公司应当按照《期货交易所管理办法》和期货交易所交易规则及其实施细则的规定行使结算会员的权利，履行结算会员的义务。

**第三十条** 全面结算会员期货公司、交易结算会员期货公司应当以自有资金向期货交易所缴纳结算担保金。

全面结算会员期货公司不得向非结算会员收取结算担保金。

**第三十一条** 全面结算会员期货公司应当建立并实施风险管理、内部控制等制度，保证金融期货结算业务正常进行，确保非结算会员及其客户资金安全。

**第三十二条** 全面结算会员期货公司应当谨慎、勤勉地办理金融期货结算业务，控制金融期货结算业务风险；建立金融期货结算业务风险隔离机制和保密制度，平等对待本公司客

户、非结算会员及其客户，防范利益冲突，不得利用结算业务关系及由此获得的信息损害非结算会员及其客户的合法权益。

非结算会员应当谨慎、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全面结算会员期货公司及其客户的合法权益。

**第三十三条** 全面结算会员期货公司调整非结算会员结算准备金最低余额的，应当在当日结算前向期货交易所和期货保证金安全存管监控机构报告。

**第三十四条** 全面结算会员期货公司应当按规定向期货保证金安全存管监控机构报送非结算会员及非结算会员客户的相关信息。

## 第四章 附则

**第三十五条** 本办法自发布之日起施行。