

关于发布《期货公司金融期货结算业务试行办法》的通知

证监发[2007]54号

各期货公司：

根据《期货交易管理条例》的规定，我会制定了《期货公司金融期货结算业务试行办法》，现予发布，请遵照执行。

中国证券监督管理委员会

二〇〇七年四月十九日

期货公司金融期货结算业务试行办法

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，应当经中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）批准，取得金融期货结算业务资格。

第四条 期货公司从事金融期货结算业务，应当遵守本办法。

第五条 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 资格的取得与终止

第六条 期货公司金融期货结算业务资格分为交易结算业务资格和全面结算业务资格。

第七条 期货公司申请金融期货结算业务资格，应当具备下列基本条件：

- (一)取得金融期货经纪业务资格；
- (二)具有从事金融期货结算业务的详细计划，包括部门设置、人员配置、岗位责任、金融期货结算业务管理制度和风险管理制度等；
- (三)结算和风险管理部门或者岗位负责人具有担任期货公司交易、结算或者风险管理部门或者岗位负责人 2 年以上经历；
- (四)具有满足金融期货结算业务需要的期货从业人员；
- (五)高级管理人员近 2 年内未受过刑事处罚，未因违法违规经营受过行政处罚，无不良信用记录，且不存在因涉嫌违法违规经营正在被有权机关调查的情形；
- (六)不存在被中国证监会及其派出机构采取《期货交易管理条例》第五十九条第二款、第六十条规定的监管措施的情形；
- (七)不存在因涉嫌违法违规经营正在被行政、司法机关立案调查的情形；
- (八)近 3 年内未因违法违规经营受过刑事处罚或者行政处罚。但期货公司控股股东或者实际控制人变更，高级管理人员变更比例超过 50%，对出现上述情形负有责任的高级管理人员和业务负责人已不在公司任职，且已整改完成并经期货公司住所地的中国证监会派出机构验收合格的，可不受此限制；
- (九)近 3 年内未出现严重的期货交易、结算风险事件。但期货公司控股股东或者实际控制人变更，高级管理人员变更比例超过 50%，对出现上述情形负有责任的高级管理人员和业务负责人已不在公司任职，且已整改完成并经期货公司住所地的中国证监会派出机构验收合格的，可不受此限制；
- (十)控股股东和实际控制人持续经营 2 个以上完整的会计年度；控股股东或者实际控制人为金融机构，在最近 2 年成立或者重组的，应当自成立或者重组完成之日起持续经营；
- (十一)控股股东和实际控制人近 2 年内未受过刑事处罚，未因违法违规经营受过行政处罚，且不存在因涉嫌违法违规经营正在被有权机关立案调查的情形。

第八条 期货公司申请金融期货交易结算业务资格，除应当具备本办法第七条规定的基本条件外，还应当具备下列条件：

- (一)董事长、总经理和副总经理中，至少 2 人的期货或者证券从业时间在 5 年以上，其中至少 1 人的期货从业时间在 5 年以上且具有期货从业人员资格、连续担任期货公司董事长或者高级管理人员时间在 3 年以上；
- (二)注册资本不低于人民币 5000 万元，申请日前 2 个月的风险监管指标持续符合规定的标准；
- (三)申请日前 3 个会计年度中，至少 1 年盈利且每季度末客户权益总额平均不低于人民币 8000 万元，控股股东期末净资产不低于人民币 2 亿元；或者控股股东期末净资产不低于人民币 5 亿元，控股股东不适用净资产或者类似指标的，净资产应当不低于人民币 8 亿元；
- (四)中国证监会根据审慎监管原则规定的其他条件。

第九条 期货公司申请金融期货全面结算业务资格，除应当具备本办法第七条规定的基本条件外，还应当具备下列条件：

- (一)董事长、总经理和副总经理中，至少 3 人的期货或者证券从业时间在 5 年以上，其中至少 2 人的期货从业时间在 5 年以上且具有期货从业人员资格、

连续担任期货公司董事长或者高级管理人员时间在3年以上；

(二) 注册资本不低于人民币1亿元，申请日前2个月的风险监管指标持续符合规定的标准；

(三) 申请日前3个会计年度连续盈利、每季度末客户权益总额平均不低于人民币3亿元，控股股东期末净资产不低于人民币10亿元；或者申请日前3个会计年度中，至少2年盈利且每季度末客户权益总额平均不低于人民币1亿元，控股股东期末净资产不低于人民币10亿元，控股股东不适用净资产或者类似指标的，净资产应当不低于人民币15亿元；

(四) 中国证监会根据审慎监管原则规定的其他条件。

第十条 期货公司申请金融期货结算业务资格，应当向中国证监会提交下列申请材料：

(一) 金融期货结算业务资格申请书；

(二) 加盖公司公章的营业执照复印件和金融期货经纪业务资格证明文件；

(三) 股东会或者董事会关于期货公司申请金融期货结算业务资格的决议文件；

(四) 从事金融期货结算业务的计划书；

(五) 《高级管理人员情况表》、《主要部门负责人情况表》和《从业人员情况表》；

(六) 申请日前2个月月末的期货公司风险监管报表，及申请日前2个月的风险监管指标持续符合规定标准的书面保证；

(七) 经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计的前3个会计年度财务报告；申请日在下半年的，还应当提供经审计的半年度财务报告；

(八) 申请日前3个会计年度每季度末客户权益总额情况表；

(九) 经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计的控股股东最近一期的财务报告；

(十) 律师事务所就期货公司是否符合本办法第七条第(五)项、第(七)项至第(十一)项规定的条件，以及股东会或者董事会决议是否合法出具的法律意见书；

(十一) 存在本办法第七条第(八)项或者第(九)项规定情形的，还应当提供期货公司住所地的中国证监会派出机构出具的整改验收合格的专项意见书；

(十二) 中国证监会规定的其他材料。

第十一条 中国证监会在受理金融期货结算业务资格申请之日起3个月内，作出批准或者不批准的决定。

第十二条 期货公司取得金融期货结算业务资格后，应当向期货交易所申请相应结算会员资格。

期货公司取得金融期货结算业务资格之日起6个月内，未取得期货交易所结算会员资格的，金融期货结算业务资格自动失效。

第十三条 只取得金融期货经纪业务资格的期货公司，可以向期货交易所申请非结算会员资格。

第十四条 取得金融期货结算业务资格的期货公司在终止金融期货结算业务前，应当结清相关期货业务，并依法返还客户的保证金和其他资产。受托为非结算会员结算的，还应当返还非结算会员的保证金和其他资产。

第三章 业务规则

第十五条 取得期货交易所交易结算会员资格的期货公司(以下简称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。

第十六条 取得期货交易所全面结算会员资格的期货公司(以下简称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。

第十七条 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。

第十八条 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。

第十九条 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。

第二十条 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。

第二十一条 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。

第二十二条 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。

第二十三条 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。

第二十四条 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。

第二十五条 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。

第二十六条 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。

第二十七条 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。

第二十八条 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。

第二十九条 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。

第三十条 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。

第三十一条 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。

第三十二条 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。

第三十三条 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。

第三十四条 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。

第三十五条 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。

第三十六条 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。

第三十七条 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。

第三十八条 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。

第四章 监督管理

第三十九条 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。

第四十条 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。

第四十一条 期货公司被期货交易所接纳为会员、暂停或者终止会员资格的，应当在收到期货交易所的通知文件之日起3个工作日内向期货公司住所地的中国证监会派出机构报告。

第四十二条 全面结算会员期货公司与非结算会员签订、变更或者终止结算协议的，应当在签订、变更或者终止结算协议之日起3个工作日内向协议双方住所地的中国证监会派出机构、期货交易所和期货保证金安全存管监控机构报告。

第四十三条 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。

第四十四条 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。

第四十五条 全面结算会员期货公司应当在定期报告中向中国证监会派出机构报告下列事项：

- (一) 非结算会员名单及其变化情况；
- (二) 金融期货结算业务所涉及的内部控制制度的执行情况；
- (三) 金融期货结算业务所涉及的风险管理制度的执行情况；
- (四) 中国证监会规定的其他事项。

第四十六条 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。

第四十七条 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。

第五章 附则

第四十八条 本办法自发布之日起施行。