

上海期货交易所结算细则

(修订版)

第一章 总 则

第一条 为规范上海期货交易所(以下简称交易所)期货交易的结算行为,保护期货交易当事人的合法权益和社会公众利益,防范和化解期货市场的风险,根据《上海期货交易所交易规则》制定本细则。

第二条 结算是指根据交易结果和交易所有关规定对会员保证金、盈亏、手续费、交割货款及其它有关款项进行计算、划拨的业务活动。

第三条 交易所的结算实行保证金制度、当日无负债结算制度和风险准备金制度等。

第四条 交易所只对会员进行结算,期货公司会员对客户进行结算。

第五条 本细则适用于交易所内的一切结算活动,交易所及其工作人员、交易所会员及其工作人员、客户和交易所指定期货保证金存管银行(以下简称存管银行)及其相关工作人员应当遵守本细则。

第二章 结算机构

第六条 结算机构是指交易所内设置的结算部门。结算机构负责交易所期货交易的统一结算、保证金管理及结算风险的防范。

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等情况；
- (五) 处理会员交易中的账款纠纷；
- (六) 办理交割结算等业务；
- (七) 按规定管理保证金。

第八条 所有在交易所交易系统中成交的合约应当通过结算机构进行统一结算。

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、账册，以备查询和核实。

第十一条 结算交割员是经会员法人授权代表会员办理结算和交割业务的人员。每一会员应当指派两名以上(含两名)的结算交割员。

结算交割员应当符合中国证券监督管理委员会(以下简称中国证监会)关于期货从业人员资格的有关规定，经交易所培训合格，取得《上海期货交易所结算交割员培训合格证书》，并经所

属会员的法人授权后取得《上海期货交易所结算交割员证》(以下简称《结算交割员证》)。

第十二条 结算交割员的业务职责:

- (一) 办理会员出入金业务;
- (二) 获取交易所提供的结算数据,并及时核对;
- (三) 办理有价证券的交存与提取手续;
- (四) 办理实物交割手续;
- (五) 办理其他结算、交割业务。

第十三条 结算交割员在交易所办理结算与交割业务时,应当出示《结算交割员证》,否则交易所不予办理。

第十四条 《结算交割员证》仅限本人使用,不得伪造、涂改、借用。

第十五条 结算机构及其工作人员应当保守交易所和会员的商业秘密。

第三章 存管银行

第十六条 存管银行是指交易所指定的、协助交易所办理期货交易结算业务的银行。

第十七条 存管银行应当符合以下条件:

- (一) 是全国性的商业银行,资金雄厚,信誉良好;
- (二) 在全国各主要城市设有分支机构和营业网点;
- (三) 拥有先进、快速的异地资金划拨手段;
- (四) 拥有保证金管理制度;
- (五) 拥有懂得期货知识、风险防范意识强的专业技术人员;

(六) 交易所认为应当具备的其他条件。

符合以上条件，并经交易所同意成为存管银行后，存管银行与交易所应当签订相应协议，明确双方的权利和义务，以规范相关业务手续。

第十八条 存管银行的权利：

(一) 开设交易所专用结算账户、会员专用资金账户及其他与结算有关的账户；

(二) 吸收交易所和会员的存款；

(三) 了解会员在交易所的资信情况。

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，对会员专用资金账户中的资金实行必要的监管措施。

第四章 日常结算

第二十条 交易所在各存管银行开设一个专用的结算账户，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账户和会员专用资金账户办理。

第二十三条 交易所对会员存入交易所专用结算账户的保证金实行分账管理，为每一会员设立明细账户，按日序时登记核算每一会员出入金、盈亏、期权权利金、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账户的保证金实行分账管理，为每一客户设立明细账户，按日序时登记核算每一客户出入金、盈亏、期权权利金、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账户中收取各项应收款项，并可以随时查询该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账户。

第二十八条 交易所实行保证金制度。保证金分为结算准备

金和交易保证金。

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账户中预先准备的资金，是未被合约占用的保证金。

期货公司会员结算准备金最低余额为 200 万元，以期货公司会员自有资金足额缴纳；非期货公司会员结算准备金最低余额为 50 万元。

第三十条 交易所根据会员当日结算准备金余额中的货币资金部分，以不低于中国人民银行公布的同期银行活期存款利率计算利息，并在每年 3 月、6 月、9 月、12 月存管银行支付利息日后的下一个工作日内，将利息转入会员结算准备金。具体执行利率由交易所确定、调整并公布。

第三十一条 交易保证金是指会员存入交易所专用结算账户中确保合约履行的资金，是已被合约占用的保证金。当期货合约买卖双方成交后，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分别收取交易保证金。

在下列情况下，交易所可以单边收取交易保证金：

- （一）同一客户在同一会员处的同品种期货合约双向持仓（期货合约进入最后交易日前第五个交易日闭市后除外）；
- （二）非期货公司会员在交易所同品种期货合约双向持仓（期货合约进入最后交易日前第五个交易日闭市后除外）；
- （三）交易所认为必要的其他情况。

第三十二条 各品种期货合约交易保证金的最低收取标准在期货合约中规定，不同阶段交易保证金的收取标准按《上海期货

交易所风险控制管理办法》的规定执行。

第三十三条 经交易所同意，会员可以用有价证券作为保证金。

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账户，以备随时交付保证金及有关费用。

期货公司会员除按照中国证监会的规定为客户向交易所交存保证金、进行交易结算外，保证金严禁挪作他用。

第三十五条 期货公司会员向客户收取的交易保证金不得低于交易所向会员收取的交易保证金。

第三十六条 交易所实行当日无负债结算制度。

当日无负债结算制度（又称逐日盯市），是指每一交易日闭市后，交易所按当日结算价结算所有合约的盈亏、交易保证金及手续费、税金等费用，对应收应付的款项实行净额一次划转，相应增加或减少会员的结算准备金。

第三十七条 交易所根据会员当日成交合约数量按照相关标准计收交易手续费。交易所可以根据市场情况，调整部分或者全部合约的交易手续费计收标准。

交易所可以根据下单数量、撤单数量等按照相关标准计收申报费、撤单费等费用。

具体计收标准另行公布。

第三十八条 当日有成交价格的期货合约的当日结算价，是指该合约当日成交价格按照成交量的加权平均价。

当日无成交价格的期货合约的当日结算价，按照下列方法确定：

(一) 当日闭市时交易所计算机系统中该合约有买卖双方报价的，按照最优的买方报价、卖方报价和该合约上一交易日的结算价格三者中居中的一个价格为该合约的当日结算价。

(二) 当日该合约闭市前连续五分钟报价保持停板价格，且交易所计算机系统中只有单方报价的，以该停板价格为该合约的当日结算价。

(三) 除上述第(一)、(二)项之外的其他情况，该合约的当日结算价按照下列方法确定：

1、该合约当日前一有成交的最近月份合约结算价的涨跌幅度(%)小于等于该合约当日涨跌停板的，该合约当日结算价 = 该合约上一交易日的结算价 \times ($1 \pm$ 该合约当日前一有成交的最近月份合约结算价的涨跌幅度)。

2、该合约当日前一有成交的最近月份合约结算价的涨跌幅度(%)大于该合约当日涨跌停板的，该合约当日结算价 = 该合约上一交易日的结算价 \times ($1 \pm$ 该合约的当日涨跌停板)。

3、该合约前面所有月份合约当日均无成交，无法确定该合约当日前一有成交的最近月份合约结算价涨跌幅度的，该合约当日结算价 = 该合约上一交易日的结算价。

某期货品种新上市合约挂盘前一交易日闭市时，该期货品种所有合约在当日均无成交且无持仓的，该期货品种所有合约的当日结算价以新上市合约的挂盘基准价为基础确定。

第三十九条 期货合约均以当日结算价作为计算当日盈亏的依据。具体计算公式如下：

当日盈亏= $\sum[(\text{卖出成交价} - \text{当日结算价}) \times \text{卖出量}] + \sum[(\text{当日结算价} - \text{买入成交价}) \times \text{买入量}] + (\text{上一交易日结算价} - \text{当日结算价}) \times (\text{上一交易日卖出持仓量} - \text{上一交易日买入持仓量})$

第四十条 当日盈亏在每日结算时进行划转，当日盈利划入会员结算准备金，当日亏损从会员结算准备金中扣划。

当日结算时的交易保证金超过昨日结算时的交易保证金部分从会员结算准备金中扣划，当日结算时的交易保证金低于昨日结算时的交易保证金部分划入会员结算准备金。

手续费、税金、期权权利金等从会员的结算准备金中扣划。

盈亏、手续费、期权权利金等应当用货币资金支付。

第四十一条 结算准备金余额的具体计算公式如下：

当日结算准备金余额= 上一交易日结算准备金余额+上一交易日交易保证金 - 当日交易保证金+当日有价证券作为保证金的实际可用金额 - 上一交易日有价证券作为保证金的实际可用金额+当日盈亏+当日期权权利金收支+入金 - 出金 - 手续费等

有价证券作为保证金的实际可用金额的具体计算方法见本细则第六章的有关规定。

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。

交易所可以根据市场风险和保证金变动情况，在交易过程中进行结算并发出追加保证金通知，会员应当在通知规定的时间内补足追加保证金。未按时补足的，按前款规定处理。

第四十三条 会员划拨资金的方式：

（一）银行扣划。会员应当以书面或者交易所规定的其他方式提交出入金申请。

会员在闭市前提交的入金申请，经交易所审核后，于当日闭市结算前完成入金划转。

会员在闭市前提交的出金申请，经交易所审核后，于当日闭市结算后集中办理会员出金划转。除特殊情况外，交易期间不予办理会员出金划转。

会员在闭市结算后提交的出入金申请，于下一个交易日办理出入金划转。

（二）票据支付。会员也可以用专用资金账户开出的支票、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。

此方式只适用于会员的入金。

第四十四条 会员出金应当符合交易所规定。会员的出金标准为：

(一) 当有价证券作为保证金的实际可用金额大于等于交易保证金的 80% 时：

可出金额 = 实有货币资金 - 交易保证金 × 20% - 结算准备金最低余额

(二) 当有价证券作为保证金的实际可用金额小于交易保证金的 80% 时：

可出金额 = 实有货币资金 - (交易保证金 - 有价证券作为保证金的实际可用金额) - 结算准备金最低余额

交易所可以根据市场风险状况对会员出金标准做适当调整。

第四十五条 有下列情况之一的会员和客户，交易所可以限制会员出金：

(一) 涉嫌重大违规，经交易所立案调查的；

(二) 因投诉、举报、交易纠纷等被司法部门、交易所或其他有关部门正式立案调查，且正处在调查期间的；

(三) 交易所认为市场出现重大风险时；

(四) 交易所认为必要的其他情况。

第四十六条 当日结算完成后，会员应当通过会员服务系统获得相关的结算数据。

第四十七条 遇特殊情况造成交易所不能按时提供结算数据，交易所将另行通知提供结算数据的时间。

第四十八条 会员每天应当及时地取得交易所提供的结算数

据，做好核对工作，并将之妥善保存，该数据应当至少保存 20 年，但对有关期货交易有争议的，应当保存至该争议消除时为止。

第四十九条 会员如对结算数据有异议，应当在下一交易日开市前三十分钟以书面形式通知交易所。遇特殊情况，会员可以在下一交易日开市后二小时内以书面形式通知交易所。如在规定时间内会员没有对结算数据提出异议，则视作会员已认可结算数据的正确性。

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)，作为会员核查交易账簿记录的依据。

第五十二条 会员应当加强对结算交割员的管理，严格操作规范，特别要从严管理密码，以防密码被盗造成泄密。

第五十三条 发生下列情形之一的，会员提出申请，经交易所批准，可以进行移仓：

- (一) 期货公司会员因故不能从事期货经纪业务；
- (二) 会员发生合并、分立、停业、解散、破产；
- (三) 交易所规定的其他移仓情形。

发生前款规定情形的，会员应当提交移入和移出仓位的会员同意移仓申请书等移仓申请材料。其中，期货公司会员发生前款第(一)、(二)项情形的，还应当提交监管部门的批准文件、已

告知客户移仓事宜的证明材料等。

第五十四条 移仓申请经批准后，交易所将与会员约定某一交易日为移仓结算日。

第五十五条 交易所将在约定日期的当日结算完成后，为会员移仓，并提供移仓前和移仓后的相关结算报表由会员确认。

第五十六条 移仓内容包括持仓及保证金，但不包括结算准备金最低余额、当日的盈亏、交易手续费、税金等其他款项。

第五十七条 会员应当仔细核对移仓前后的持仓及资金情况，一经确认，不得更改。

第五章 实物交割结算

第五十八条 会员进行实物交割，应当按规定向交易所交纳交割手续费。具体标准在交割细则中载明。

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账户，卖方交割货款由交易所划至会员专用资金账户。

买方会员在第三交割日 14:00 前未支付交割货款的，交易所可以从该会员结算准备金中内转交割货款。

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》第二十四条确定，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、漂白硫酸盐针叶木浆和不锈钢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。

第六十一条 交易所向买方会员开具增值税专用发票，向卖方会员收取增值税专用发票。买方会员向买方客户开具增值税专用发票，向交易所收取增值税专用发票。卖方会员向交易所开具增值税专用发票，向卖方客户收取增值税专用发票。

卖方会员最迟应当在最后交易日后第五个工作日将增值税专用发票交至交易所。

第六十二条 会员迟交增值税专用发票 3 至 10 天的，每天处以货款金额 0.5‰的滞纳金；迟交 11 至 30 天，每天处以货款金额 1‰的滞纳金；超过 30 天未交增值税专用发票的，视作不交增值税专用发票，处以货款金额 20%的违约金。

第六十三条 在交割期内，买方会员按规定在 14：00 之前办妥货款事宜，交易所当日结算时清退其相应的保证金；如在 14：00 之后办妥的，交易所将在下一交易日结算时清退相应的保证金。

在交割期内，卖方会员按规定办妥标准仓单事宜，交易所当

日结算时清退其相应的保证金；如第三交割日闭市后未办妥增值税专用发票事宜，交易所当日对相应交割头寸以该合约交割结算价收取不低于 15%的保证金，该保证金在卖方会员办妥增值税专用发票事宜后清退。

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）》、《上海期货交易所燃料油期货交割实施细则》有关规定执行。

第六章 有价证券作为保证金

第六十五条 经交易所批准，会员可以将有价证券作为保证金，但亏损、费用、税金、期权权利金等均应当以货币资金结清。

第六十六条 期货公司会员的客户以有价证券作为保证金的，视为同意期货公司会员将其有价证券提交交易所作为保证金。

客户、会员以有价证券作为保证金的，视为授权交易所对相应价证券进行划转或者作质押处理。

第六十七条 经交易所批准，以下有价证券可以作为保证金：

- （一）标准仓单；
- （二）中华人民共和国财政部在境内发行的记账式国债；
- （三）交易所认定的其他有价证券。

作为保证金的有价证券具体由交易所确定并向市场公布。

第六十八条 以国债作为保证金的，每次提交的国债面值不得低于 100 万元人民币。

第六十九条 办理有价证券作为保证金的手续：

(一) 申请：客户应当通过会员办理有价证券作为保证金业务。会员办理有价证券作为保证金业务时，应当向交易所提出申请。具体办理时间由交易所另行通知。

(二) 验证交存：

1. 会员将标准仓单通过标准仓单管理系统提交交易所办理交存手续，获交易所批准后，完成标准仓单作为保证金交存业务。

2. 以国债作为保证金的，客户、非期货公司会员应当确保托管账户中存有数量足够的、无其他权利瑕疵的国债。交易所按照会员的申请委托托管机构进行国债划转或者质押登记，托管机构对国债进行划转或者质押登记后视为办理完成。

3. 其他有价证券的验证交存应当符合交易所的规定。

第七十条 作为保证金的有价证券的市值按以下方法计算：

(一) 标准仓单作为保证金的，每日结算时，交易所以该标准仓单对应品种最近交割月份期货合约的当日结算价为基准价计算其市值。

当日闭市前，先以前一交易日该标准仓单对应品种最近交割月份期货合约的结算价为基准价计算其市值。

(二) 国债作为保证金的，国债的基准价取托管机构估值数据的较小值，交易所每日结算时以前一交易日该国债基准价的净价确定其市值。交易所所有权对国债的基准价进行调整。

(三) 其他有价证券作为保证金的，其市值计算的基准价由交易所核定。

第七十一条 作为保证金的有价证券的市值按照折扣比率计算后的金额称为折后金额。有价证券的折扣比率由交易所确定、调整并公布，其中标准仓单、国债的折后金额不高于其市值的80%。

交易所每日结算时，按规定的基准价调整作为保证金的有价证券市值和折后金额。

第七十二条 交易所按照会员在交易所专用结算账户中的实有货币资金的4倍（配比乘数）确定会员有价证券作为保证金的最大配比金额。

交易所按照有价证券折后金额和最大配比金额中的较低金额作为会员有价证券作为保证金的实际可用金额。会员办妥作为保证金使用的有价证券交存手续后，交易所将该笔有价证券的实际可用金额计入会员结算准备金。

交易所在每日结算时，根据以上原则自动调整会员有价证券作为保证金的实际可用金额。

第七十三条 交易所所有权根据市场状况调整有价证券作为保证金的基准价、折扣比率、配比乘数，由交易所另行通知。

第七十四条 国债作为保证金期间发生兑息的，利息归国债所有人所有，并按照托管机构有关规定办理。

第七十五条 有价证券作为保证金的期限不得超过交易所规定的该有价证券的有效期限。届满后仍需作为保证金的，应当重新办理手续。

第七十六条 国债作为保证金的，国债到期日前一个月的第

一个交易日结算时起，交易所不再将该国债计入实际可用金额计算。会员应当在国债到期日之前办理提取或者解除质押手续。

第七十七条 出现下列情况之一的，交易所可以取消有关会员有价证券作为保证金的额度：

（一）会员提取和运用资金出现较大风险并有可能危及交易所合法权益的；

（二）作为保证金的有价证券出现瑕疵或者发生重大风险的；

（三）交易所认为必要的其他情形。

交易所取消会员有价证券作为保证金的额度后，会员保证金不足的，应当予以补足。

第七十八条 会员办理有价证券提取或者解除质押的，应当弥补相应的保证金。具体办理时间由交易所另行通知。

第七十九条 办理有价证券作为保证金的，会员应当向交易所缴纳手续费。手续费由交易所按不高于中国人民银行公布的同期贷款利率计算收取。具体计费金额和收费标准由交易所确定、调整并公布。

有价证券作为保证金业务中托管机构收取的有关费用，按照托管机构的有关规定执行。

第八十条 当会员不履行或不能完全履行交易保证金债务时，交易所所有权处置作为保证金的有价证券，从所得的款项中优先受偿交易保证金债务和相关债务。会员应当承担处置作为保证金的有价证券时产生的损失及费用。

第七章 风险与责任

第八十一条 会员对其在交易所成交的合约负有承担风险的责任。

第八十二条 风险防范实行两级负责制。交易所防范会员的风险，会员防范客户的风险。

第八十三条 会员不能履行合约责任时，交易所可以对其采取下列保障措施：

- (一) 动用会员的结算准备金；
- (二) 暂停开仓交易；
- (三) 按规定强行平仓，直至用平仓后释放的保证金能够履约为止；
- (四) 将交存的有价证券变现，用变现所得履约赔偿。

第八十四条 如采取前条措施后会员仍欠资金，交易所将按以下步骤履约赔偿：

- (一) 取消会员资格，用该会员的会员资格费抵偿；
- (二) 经理事会批准，动用风险准备金进行履约赔偿；
- (三) 动用交易所的自有资产进行履约赔偿；
- (四) 通过法律程序继续对该会员追偿。

第八十五条 交易所实行风险准备金制度。风险准备金是指由交易所设立，用于为维护期货市场正常运转提供财务担保和弥补因交易所不可预见风险带来的亏损的资金。

第八十六条 风险准备金的来源：

- (一) 交易所按向会员收取手续费收入(含向会员优惠减收

部分) 20%的比例, 从管理费用中提取;

(二) 符合国家财政政策规定的其他收入。

当风险准备金余额达到交易所注册资本 10 倍时, 经中国证监会批准后可以不再提取。

第八十七条 风险准备金应当单独核算, 专户存储, 除用于弥补风险损失外, 不得挪作他用。

第八十八条 风险准备金的动用应当经交易所理事会批准, 报告中国证监会后按规定的用途和程序进行。

第八章 附 则

第八十九条 违反本细则规定的, 交易所按《上海期货交易所违规处理办法》的有关规定处理。

第九十条 有关连续交易的结算, 上海期货交易所连续交易细则有特殊规定的, 从其规定。

第九十一条 交易所对期权结算业务有特别规定的, 适用其规定。

第九十二条 本细则解释权属上海期货交易所。

第九十三条 本细则自 2020 年 10 月 9 日起实施。

[附一: 《专用通知书》\(样本\)](#)

[附二: 《客户专项授权书》\(样本\)](#)

[附三: 上海期货交易所所有价证券交存清单\(样本\)](#)

[附四: 上海期货交易所所有价证券提取清单\(样本\)](#)

[附五: 上海期货交易所指定期货保证金存管银行名单](#)

附一：

专用通知书
(样本)

No:

_____ 银行 _____ :

现有本所会员 _____ (会员号: _____) 前来贵行
办理专用资金账户的开户 / 销户 / 更名手续, 请予接待, 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 | | 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 | | | |

附二：

客户专项授权书

上海期货交易所：

兹专项委托_____（会员）持本单位的有价证券（名称_____数量_____），前来办理有价证券作为保证金的有关事项，用于履行该会员在交易所的保证金债务和相关债务。请予以办理为盼！

特此证明。

声明：本人（本单位）已仔细阅读《上海期货交易所结算细则》有关有价证券的条款，了解并愿意承担本人（本单位）的相关责任。

单位(公章) _____

法定代表人(签字) _____

_____年_____月_____日

附三：

上海期货交易所所有价证券交存清单
(样本)

存

No:

会员号： 会员名称： 有价证券名称：

| 起止编号 | 数量 | 牌号 | 仓库 | 商(质) 检有效期 | 到期日 |
|------|----------|----|----|-----------|-----|
| | | | | | |
| | | | | | |
| | | | | | |
| | | | | | |
| | | | | | |
| | | | | | |
| | | | | | |
| | | | | | |
| | | | | | |
| | | | | | |
| | | | | | |
| | | | | | |
| 总计 | 张 吨（或千克） | | | | |
| 备注 | | | | | |

会员

交易所

结算交割员：

经办人：

复核人：

会员单位（盖章）：

经办部门（盖章）：

年 月 日

附四：

上海期货交易所所有价证券提取清单
(样本)



No:

会员号： 会员名称： 有价证券名称：

| 起止编号 | 数量 | 牌号 | 仓库 | 商(质) 检有效期 | 到期日 |
|------|-----------|----|----|-----------|-----|
| | | | | | |
| | | | | | |
| | | | | | |
| | | | | | |
| | | | | | |
| | | | | | |
| | | | | | |
| | | | | | |
| | | | | | |
| | | | | | |
| | | | | | |
| 总计 | 张 吨 (或千克) | | | | |
| 备注 | | | | | |

会员 交易所

结算交割员： 经办人：

复核人：

会员单位 (盖章)：

经办部门(盖章)：

年 月 日

附五：

上海期货交易所指定期货保证金存管银行名单

| | | | |
|--------|-----------------|----|----------|
| 中国工商银行 | | | |
| 经办行 | 中国工商银行上海市期货大厦支行 | | |
| 地址 | 上海市浦电路500号一楼 | 电话 | 68401033 |

| | | | |
|------|---------------|----|----------|
| 交通银行 | | | |
| 经办行 | 交通银行上海市期货大厦支行 | | |
| 地址 | 上海市浦电路500号一楼 | 电话 | 68401026 |

| | | | |
|--------|-----------------|----|----------|
| 中国建设银行 | | | |
| 经办行 | 中国建设银行上海市期货大厦支行 | | |
| 地址 | 上海市浦电路500号一楼 | 电话 | 68401040 |

| | | | |
|------|---------------|----|----------|
| 中国银行 | | | |
| 经办行 | 中国银行上海市期货大厦支行 | | |
| 地址 | 上海市浦电路500号二楼 | 电话 | 68402458 |

| | | | |
|--------|-----------------|----|----------|
| 中国农业银行 | | | |
| 经办行 | 中国农业银行上海市期货大厦支行 | | |
| 地址 | 上海市浦电路500号一楼 | 电话 | 68400986 |

| | | | |
|----------|-----------------|----|----------|
| 上海浦东发展银行 | | | |
| 经办行 | 上海浦东发展银行期交所支行 | | |
| 地址 | 上海市浦电路577号1楼02A | 电话 | 50495573 |

| | | | |
|------|-------------------|--|--|
| 兴业银行 | | | |
| 经办行 | 兴业银行股份有限公司上海交易所支行 | | |

| | | | |
|----|------------------------------|----|----------|
| 地址 | 上海市浦电路555号中国钻石交易中心大厦一层#103单元 | 电话 | 50203692 |
|----|------------------------------|----|----------|

| | | | |
|--------|------------------------|----|----------|
| 中国光大银行 | | | |
| 经办行 | 中国光大银行股份有限公司上海期交所支行 | | |
| 地址 | 上海市世纪大道1589号长泰国际金融大厦1楼 | 电话 | 58310167 |

| | | | |
|------|--------------------|----|----------|
| 招商银行 | | | |
| 经办行 | 招商银行股份有限公司上海世纪大道支行 | | |
| 地址 | 招商银行上海世纪大道1589号 | 电话 | 58449005 |

| | | | |
|------|-------------------|----|----------|
| 中信银行 | | | |
| 经办行 | 中信银行股份有限公司上海浦电路支行 | | |
| 地址 | 上海市浦电路438号双鸽大厦首层 | 电话 | 50192613 |

| | | | |
|--------|---------------------|----|----------|
| 中国民生银行 | | | |
| 经办行 | 中国民生银行股份有限公司上海期交所支行 | | |
| 地址 | 上海市浦电路577号葛洲坝大厦1楼 | 电话 | 50125497 |

| | | | |
|------|----------------------|----|----------|
| 平安银行 | | | |
| 经办行 | 平安银行股份有限公司上海交易所支行 | | |
| 地址 | 上海市向城路288号SOHO世纪广场1楼 | 电话 | 58666527 |