

附件 2

上海期货交易所 国债作为保证金业务指引

(2025 年 11 月)

为规范会员、客户等参与上海期货交易所（以下简称上期所）国债作为保证金业务，根据《上海期货交易所交易规则》《上海期货交易所结算管理办法》等相关规定，制定本业务指引。

一、业务准备

（一）期货公司会员业务准备

1. 在中央结算公司开立专用账户并申请开展业务

期货公司会员开展国债作为保证金业务的，应在中央国债登记结算有限责任公司（以下简称中央结算公司）开立债券作为期货保证金业务专用账户，并向中央结算公司申请开通相关业务资格。具体要求和流程按照中央结算公司的有关规定办理。

2. 向上期所申请开展业务

期货公司会员开展国债作为保证金业务的，需向上期所申请，并提交加盖公章的下列材料：（1）《上海期货交易所会员国债作为保证金业务申请表》（附 1）；（2）债券作为期货保证金业务专用账户证明材料；（3）债券作为期货保证金业务专用账户开户证件复印件；（4）上期所要求的其他材料。

3. 专用账户变更或注销

期货公司会员发生债券作为期货保证金业务专用账户变更或注销的，应及时告知上期所，并提交《中央结算公司账户变更/注销告知书》（附 4）及上期所要求的其他书面材料。

（二）非期货公司会员业务准备

1. 在中央结算公司开立债券账户并申请开展业务

非期货公司会员参与国债作为期货保证金业务的，应在中央结算公司开立债券账户，并向中央结算公司申请开通相关业务资格。具体要求和流程按照中央结算公司的有关规定办理。

2. 向上期所申请开展业务

非期货公司会员参与国债作为保证金业务的，需向上期所申请，并提交加盖公章的以下材料：（1）《上海期货交易所会员国债作为保证金业务申请表》（附 2）；（2）债券账户证明材料；（3）债券账户开户证件复印件；（4）上期所要求的其他材料。

3. 债券账户变更或注销

非期货公司会员发生债券账户变更或注销的，应及时告知上期所，并提交《中央结算公司账户变更/注销告知书》（附 4）及上期所要求的其他书面材料。

（三）客户业务准备

1. 在中央结算公司开立债券账户并申请开展业务

客户参与国债作为保证金业务的，应在中央结算公司开立债券账户，并向中央结算公司申请开通业务资格，具体要求和流程按照中央结算公司的有关规定办理。

2. 向上期所申请开展业务

客户参与国债作为保证金业务的，需通过会员向上期所申请，并提交加盖公章的以下材料：(1)《上海期货交易所客户国债作为保证金业务申请表》(附 3)；(2) 债券账户证明材料；(3) 债券账户开户证件复印件；(4) 上期所要求的其他材料。上期所可以根据客户实际情况对申请材料要求进行调整。

3. 债券账户变更或注销

客户发生债券账户变更或注销的，其期货公司会员应及时告知上期所，并提交《中央结算公司账户变更/注销告知书》(附 4) 及上期所要求的其他书面材料。

(四) 境外特殊参与者、境外中介机构业务准备

境外特殊参与者、境外中介机构参与国债作为保证金业务的，应在中央结算公司开立债券账户或专用账户，并向中央结算公司申请开通业务资格。具体要求和流程按照中央结算公司的有关规定办理。境外特殊经纪参与者、境外中介机构参照期货公司会员业务准备要求；境外特殊非经纪参与者参照客户业务准备要求。

二、国债交存和提取

(一) 交存和提取申请

客户、境外中介机构、境外特殊参与者交存和提取作为保证金的国债的，应通过期货公司会员向上期所提交申请。

会员通过会员服务系统向上期所提交国债交存和提取的申请。会员应当在每个交易日 14:30 前向上期所提出国债交存或提取申请。

连续交易时间，上期所不受理国债作为保证金相关业务申请、不办理相关业务。

(二) 交存办理

上期所按照会员的申请，委托中央结算公司进行国债质押登记。期货公司会员在中央结算公司中债综合业务平台提交的质押指令中应包含会员号及客户号、境外中介机构号、境外特殊参与者号等信息；非期货公司会员在中央结算公司中债综合业务平台提交的质押指令中应包含非期货公司会员交易编码等信息。

(三) 提取办理

会员办理国债提取的，应当弥补相应的保证金。上期所于当日结算时对会员的提取申请进行审核，审核通过后委托中央结算公司进行国债解押登记，会员需通过中央结算公司中债综合业务平台对相应的解押指令进行确认。若会员未能在当日确认国债解押指令，应在下一个交易日中午 12:00 之前向上期所提交书面说明，上期所再次在中央结算公司中债综合业务平台发起国债解押指令。

三、到期处理

国债到期日前一个月的第一个交易日结算时起，上期所不再将该笔国债计入实际可用金额，并不再接受该国债交存。国债到期日前一个月的第一个交易日结算后，会员不主动提取该笔国债的，上期所可以通过中央结算公司中债综合业务平台向会员发起国债解押指令，会员应在当日中债综合业务平台关闭前确认国债解押指令。若会员未能在当日确认国债解押指令，需在第二个交易日中午 12:00 之前向上期所提交书面说明，上期所再次在中央结算公司中债综合业务平台发起国债提取指令。

四、应急处理

若期货公司会员、非期货公司会员无法通过会员服务系统完成国债

交存和提取等操作，应填写并提交《上海期货交易所国债交存/提取应急申请表》(附 5)。

五、业务手续费

国债作为保证金的手续费率年化 0.05%，手续费以每日结算后国债折后金额为基数计费，按月收取。

上期所可以根据市场运行情况对手续费标准进行调整。

- 附：1. 上海期货交易所会员国债作为保证金业务申请表
(期货公司会员专用)
2. 上海期货交易所会员国债作为保证金业务申请表
(非期货公司会员专用)
3. 上海期货交易所客户国债作为保证金业务申请表
4. 中央结算公司账户变更/注销告知书
5. 上海期货交易所国债交存/提取应急申请表

附 1

上海期货交易所 会员国债作为保证金业务申请表 (期货公司会员专用)

申请日期		会员全称			
会员号		会员简称			
会员专用 账户信息	登记机构	中央结算公司			
	账户全称				
	账户号码				
	公司证件	营业执照	证件号		
联系人 1		办公电话		手机	
联系人 2		办公电话		手机	
1、本公司承诺遵守国债作为保证金业务的有关法律法规和业务规则。 2、本公司同意将本公司提交上期所的国债作为保证金。 3、本公司不履行或不能完全履行交易保证金债务和相关债务时，本公司同意上期所处置相关国债，所得款项用于清偿本公司的交易保证金债务和相关债务。 会员单位公章： 年 月 日					

以下由上期所填写					
经办人		复核人		日期	

附 2

**上海期货交易所
会员国债作为保证金业务申请表
(非期货公司会员专用)**

申请日期		会员全称			
会员号		会员简称			
会员债券 账户信息	登记机构	中央结算公司			
	账户全称				
	账户号码				
	公司证件	营业执照		证件号	
联系人 1		办公电话		手机	
联系人 2		办公电话		手机	

1、本公司承诺遵守国债作为保证金业务的有关法律法规和业务规则，愿意承担本公司的相关责任。

2、本公司同意将本公司提交上期所的国债作为保证金。

3、本公司不履行或不能完全履行交易保证金债务和相关债务时，本公司同意上期所处置相关国债，所得款项用于清偿本公司的交易保证金债务和相关债务。

会员单位公章：

年 月 日

以下由上期所填写					
经办人		复核人		日期	

附 3

上海期货交易所 客户国债作为保证金业务申请表

申请日期		会员全称			
会员号		会员简称			
期货客户号		期货客户名			
客户债券 账户信息	登记机构	中央结算公司			
	账户全称				
	账户号码				
	公司证件		证件号		
联系人 1		办公电话		手机	
联系人 2		办公电话		手机	
客户	1、本公司/机构委托_____（会员简称）办理国债作为保证金有关事项，本公司/机构承诺遵守国债作为保证金业务的有关法律法规和业务规则，愿意承担本公司/机构的相关责任。 2、本公司/机构同意将国债提交_____（会员简称）作为保证金，本公司/机构不履行或不能完全履行交易保证金债务和相关债务时，本公司/机构同意_____（会员简称）处置相关国债，所得款项用于清偿本公司/机构的交易保证金债务和相关债务。 3、本公司/机构同意_____（会员简称）将本公司/机构的国债提交上期所作为保证金，_____（会员简称）不履行或不能完全履行交易保证金债务和相关债务时，本公司/机构同意上期所处置相关国债，所得款项用于清偿_____（会员简称）的交易保证金债务和相关债务。 4、本公司/机构在此郑重声明：本表及附件（如有）由本公司/机构经授权人员填写，内容真实、准确、完整。 签字或盖章： 年 月 日				
会员	本公司保证按照客户意愿办理有关国债作为保证金业务，本公司承诺遵守国债作为保证金业务的有关法律法规和业务规则，并核验本表及附件（如有）内容真实、准确、完整。 会员单位公章： 年 月 日				

以下由上期所填写					
经办人		复核人		日期	

附 4

中央结算公司账户变更/注销告知书

☐ 期货公司会员 ☐ 非期货公司会员 ☐ 客户	
会员号	
会员简称	
客户号	
客户名称	
告 知 事 项	
☐ 账户变更 ☐ 账户注销	
账 户 变 更	
原账户信息：	
新账户信息：	
账 户 注 销	
注销账户全称：	
注销账户号码：	
注销原因：	
会员单位公章： 经办人： 联系方式： 年 月 日	

以下由上期所填写					
经办人		复核人		日期	

附 5

上海期货交易所国债交存/提取应急申请表

上海期货交易所：

由于我单位不能通过会员服务系统正常办理国债作为保证金相关业务，故申请通过应急方式进行办理。我单位保证所发送的应急申请表内容真实、准确、完整、有效。

申请日期		会员号		会员简称	
经办人		联系电话			
☐ 交存申请			☐ 提取申请		
期货公司会员填写：					
期货客户号		期货客户名称			
非期货公司会员填写：					
交易编码		会员全称			
托管机构账户信息：					
托管机构	中央结算公司				
账户全称					
账户号码					
国债全称	国债代码	面额 (单位：万元)	到期日	中债登系统指令 编号 (若有)	
(可自行添加行)					
经办人签字或盖章： 联系电话： 复核人签字或盖章： 联系电话： 会员单位公章： 年 月 日					

以下由上期所填写					
经办人		复核人		日期	