附件 8

上海国际能源交易中心结算管理办法
~~细则~~
（征求意见稿）

注：红色阴影字体表示新增内容，双删除线表示删除内容。

第一章 总则

第一条 为规范上海国际能源交易中心（以下简称能源中心）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共利益，防范和化解期货市场风险，根据《上海国际能源交易中心交易规则》制定本办法~~细则~~。

第二条 结算是指根据交易结果和能源中心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~~二~~条 能源中心作为中央对手方，统一组织期货交易的结算，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~~三~~条 能源中心对会员进行结算。

期货公司会员对其客户、委托其结算的境外特殊参与者、委托其交易结算的境外中介机构（前述客户、境外特殊参与者、境外中介机构统称为“结算交割委托人”）进行结算。

境外特殊经纪参与者、境外中介机构对其客户进行结算。

第五~~四~~条 本办法~~细则~~适用于能源中心的一切结算活动，能

源中心、会员、境外特殊参与者、境外中介机构、客户、指定期货保证金存管银行（以下简称指定存管银行）及相关工作人员应当遵守本办法~~细则~~。

第二章 结算机构

第六~~五~~条 结算机构是指能源中心内设置的结算部门。结算机构负责能源中心期货交易的统一结算、保证金管理及结算风险的防范。

第七~~六~~条 结算机构具有下列主要职责：

（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~~、结汇、购汇~~等情况；

（五）处理会员交易中的账款纠纷；

（六）办理交割结算业务；

（七）按规定管理保证金；

（八）按规定办理其他结算业务。

第八~~七~~条 所有在能源中心成交的合约应当通过结算机构进行统一结算。

第九~~八~~条 能源中心可以检查会员、境外特殊参与者、境外中介机构和客户涉及能源中心期货交易的相关资料，包括交易记录、结算资料、财务报表及相关的~~、~~凭证和账册等。会员、境外特殊参与者、境外中介机构和客户应当予以配合。

第十~~九~~条 会员应当设有承担结算职能的部门，负责会员与能源中心、结算交割委托人之间的结算工作，并应当妥善保管交

易记录、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~~十~~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~~办理结算、交割业务的人员（以下简称~~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，经能源中心培训合格，通过能源中心测试，并获得~~经~~所属会员的法人~~机构~~授权后取得《上海国际能源交易中心结算交割员证》（以下简称《结算交割员证》）。

第十二~~十一~~条 结算交割员具有下列业务职责：

（一）办理所属会员~~机构~~出入金业务；

（二）获取并及时核对能源中心提供的结算数据；

（三）办理作为保证金的资产的交存与提取手续；

（四）办理交割手续；

（五）办理其他结算、交割业务。

第十三~~十二~~条 结算交割员在能源中心办理结算、交割业务时，应当出示《结算交割员证》，否则能源中心不予办理。

《结算交割员证》仅限本人使用，不得伪造、涂改、转借他人。

第十四~~十三~~条 会员应当制定结算交割员的业务操作规范。结算交割员应当妥善保管操作密码，因保管不善产生的后果由会员自行承担。

第十五~~十四~~条 结算相关主体及其工作人员应当保守与结算

业务有关的商业秘密。

第三章 日常结算

第十六~~十五~~条 能源中心按照业务需要在各指定存管银行开设不同币种的专用结算账户，用于存放会员的保证金及相关款项。

第十七~~十六~~条 会员应当按照业务需要在指定存管银行开设不同币种的保证金专用账户，用于存放保证金及相关款项。其中，会员根据能源中心要求在指定存管银行指定网点开设的保证金专用账户为会员专用资金账户。

第十八~~十七~~条 能源中心与会员之间期货业务资金的往来通过能源中心专用结算账户和会员专用资金账户办理。

第十九~~十八~~条 能源中心对会员存入能源中心专用结算账户的保证金实行分账管理，为每一会员设立内部明细账户，按日序时登记核算每一会员出入金、盈亏、交易保证金、期权权利金、手续费等。

会员每接受一家境外特殊参与者委托结算的，能源中心为会员提供另行设立受托结算内部明细账户的服务，按日序时登记核算每一境外特殊参与者出入金、盈亏、交易保证金、期权权利金、手续费等。

第二十~~十九~~条 期货公司会员、境外特殊经纪参与者、境外中介机构应当对保证金实行分账管理，为每一客户设立内部明细账户，按日序时登记核算每一客户出入金、盈亏、交易保证金、期权权利金、手续费等。期货公司会员通过保证金专用账户与客户的期货结算账户进行期货业务资金往来。

会员应当按照前款要求，对委托其结算的境外特殊参与者、委托其交易结算的境外中介机构的保证金实行分账管理。

第二十一~~二十~~条 能源中心~~根据本细则及其他业务规则的规定~~可以在不通知会员的情况下通过指定存管银行从会员的专用资金账户中收取~~扣划~~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。

~~能源中心可以随时查询会员专用资金账户的资金余额和往来情况。~~

第二十二~~二十一~~条 会员开立、更名、更换或者注销专用资金账户，应当向能源中心提出申请，经同意后凭能源中心结算机构签发的专用通知书~~（样本见能源中心官方网站）~~到指定存管银行办理。

第二十三~~二十二~~条 会员转让会员资格的，受让方应当重新开立专用资金账户。

第二十四~~二十三~~条 能源中心实行保证金制度。保证金分为结算准备金和交易保证金。

人民币作为能源中心结算币种。

第二十五~~二十四~~条 结算准备金是指会员为了交易结算在能源中心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。

第二十六~~二十五~~条 期货公司会员结算准备金最低余额为人民币 200 万元；非期货公司会员结算准备金最低余额为人民币 50 万元。

会员接受境外特殊参与者委托结算、接受境外中介机构委托

交易结算的，会员相应的受托结算内部明细账户的结算准备金最低余额由能源中心另行通知。

第二十七~~二十六~~条 会员结算准备金最低余额应当以人民币自有资金缴纳。

第二十八~~二十七~~条 能源中心根据会员每日交易保证金和结算准备金余额中的货币资金部分，在每年 3 月、6 月、9 月、12 月下旬指定存管银行向能源中心支付利息后，将利息转入会员的结算准备金。具体执行利率由能源中心确定、调整并公布。

第二十九~~二十八~~条 交易保证金是指会员存入能源中心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。当期货交易成交后，能源中心按照持仓合约价值的一定比率或者能源中心规定的其他方式收取交易保证金。

能源中心可以按买卖双向持仓量、净持仓量或者持仓组合收取交易保证金。

在下列情况下，能源中心可以单边收取交易保证金：

（一）同一客户在同一期货公司会员、境外特殊经纪参与者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收市后除外），按照保证金金额较大的一边收取；

（二）非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者在能源中心同品种期货合约的双向持仓（期货合约进入最后交易日前第五个交易日收市后除外），按照保证金金额较大的一边收取；

（三）能源中心认为必要的其他情况。

第三十~~二十九~~条 各~~上市~~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照

各品种期货业务细则以及《上海国际能源交易中心风险控制管理办法~~细则~~》的规定执行。

第三十一~~三十~~条 会员向结算交割委托人收取的保证金属于结算交割委托人所有，应当存放于保证金专用账户。

保证金除用于交易结算外，严禁违规挪作他用。

第三十二~~三十一~~条 会员向结算交割委托人收取的交易保证金不得低于能源中心向会员收取的交易保证金标准。

第三十三~~三十二~~条 能源中心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）是指每一交易日收市后，能源中心按照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~~税款~~等费用，对应收应付的款项实行净额划转，~~并~~相应增加或者减少会员的结算准备金。

第三十四~~三十三~~条 能源中心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~~，并可以根据市场情况，按照上市品种或者合约，对特定客户、部分或者全部会员、境外特殊参与者收取申报费等费用。能源中心另有规定的除外~~。能源中心可以根据市场情况，调整部分或者全部合约的交易手续费计收标准。

能源中心可以根据下单数量、撤单数量等对部分或者全部客户、部分或者全部会员、部分或者全部境外特殊参与者按照相关标准计收申报费等费用。

具体计收标准另行公布。

能源中心可以对会员应交纳的交易手续费进行减收，减收方案由能源中心另行制定并根据市场情况进行调整。

会员应当根据法律、行政法规、规章以及能源中心有关规定，

规范使用能源中心减收的交易手续费，不得对能源中心认定的高频交易者进行手续费减收。

第三十五~~三十四~~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）当日收市时能源中心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）当日该合约收市前连续五分钟报价保持停板价格，且能源中心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×（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）；

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×（1±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，且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，则该合约当日结算价 = 上一交易日该合约的结算价。

~~**第三十五条** 期货市场参与者具有下列情形之一的，能源中心可以调整当日结算价和交割结算价：~~

~~（一）期货市场参与者以自己或者实际控制关系账户为交易对象，自买自卖期货合约，严重影响交割结算价或者期权行权结果的；~~

~~（二）其他违规行为导致期货交易价格异常波动或者瞬间大幅度偏离市场价格、严重影响交割结算价或者期权行权结果的。~~

第三十六条 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=∑[（卖出成交价 - 当日结算价）×卖出量]+∑[（当日结算价 - 买入成交价）×买入量]+（上一交易日结算价 - 当日结算价）×（上一交易日卖出持仓量 - 上一交易日买入持仓量）

第三十七条 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上一交易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上一交易日结算时的交易保证金部分划入会员结算准备金。

手续费、期权权利金、税金~~税款~~等从会员结算准备金中扣划。

盈亏、费用、期权权利金、交割货款等款项应当以人民币货币资金支付。

第三十八条 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+当日资产作为保证金的实际可用金额 - 上一交易日资产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

资产作为保证金的实际可用金额的具体计算方法见本办法~~细则~~第六章的有关规定。

第三十九条 ~~当日~~结算完成后，会员在能源中心的任一内部明细账户的~~当日~~结算准备金余额低于最低余额要求时，该结算结果即视为能源中心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。

第四十条 能源中心发出追加保证金通知后，可以通过指定存管银行从会员的专用资金账户中扣划应当追加的保证金金额；未能全额扣款的，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，按照下列方法处理：

（一）会员在能源中心的任一内部明细账户的结算准备金余额大于或者等于零而低于结算准备金最低余额的，该账户对应的会员或者境外特殊参与者不得开新仓；

（二）会员在能源中心的任一内部明细账户的结算准备金小于零的，能源中心按照《上海国际能源交易中心风险控制管理办法~~细则~~》等~~的~~规定进行强行平仓等处理。

第四十一条 能源中心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保证金。未按时补足的，按前条~~本细则第四十条的~~规定处理。

第四十二条 当日结算完成后，会员在能源中心的任一内部明细账户内结算准备金中人民币资金不得低于结算准备金最低余额。低于最低余额要求的，能源中心可以从会员专用资金账户

中扣划相应的人民币资金；未能全额扣划的，会员应当在下一交易日开市前将人民币资金补足至结算准备金最低余额；未补足的，能源中心可以对专用结算账户中该会员的外汇资金和会员专用资金账户中的外汇资金通过强制换汇的方式为其补足。

第四十三条 会员划拨资金的方式包括：

（一）银行扣划。会员应当通过会员服务系统~~期货资金管理系统~~或者能源中心规定的其他方式提交出入金申请。

会员在收市前提交入金申请的，经能源中心审核后，于当日收市结算前办理入金划转。~~；~~

会员在收市前提交出金申请的，经能源中心审核后，于当日收市结算后集中办理出金划转。除特殊情况外，交易期间不予办理会员出金划转。~~；~~

会员在收市结算后提交出入金申请的，经能源中心审核后，于下一个交易日办理出入金划转。

~~交易期间不予办理浮动盈亏及相关资金的出金划转，其他资金出金需求可向能源中心申请办理。~~

~~连续交易期间，能源中心不办理出金业务。~~

（二）票据支付。经能源中心同意，会员也可以使用专用资金账户开出~~基于保证金专用账户签发~~的支票、本票和贷记凭证入金。会员用此方式划入的资金，经指定存管银行确认到账后，能源中心将在不迟于确认时间~~到账~~的下一节交易前增加会员在能源中心内的结算准备金。

此方式只适用于会员的入金。

第四十四条 会员出金应当符合能源中心规定。出金标准为：

（一）作为保证金的资产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）作为保证金的资产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 - 作为保证金的资产的实际可用金额） - 结算准备金最低余额

实有货币资金是指实有人民币资金和折成人民币的外汇资金的合计数，外汇资金的折算方法由本办法~~细则~~第六章规定。

能源中心可以根据市场风险状况和允许使用的外汇种类对出金标准做适当调整。

第四十五条 会员、境外特殊参与者、境外中介机构或者~~和~~客户具有下列情形之一的，能源中心可以限制会员出金，要求会员限制境外特殊参与者、境外中介机构出金，以及要求会员、境外特殊经纪参与者、境外中介机构配合限制客户出金：

（一）涉嫌重大违规，经能源中心立案调查的；

（二）因投诉、举报、交易纠纷等被司法部门、能源中心或者其他有关部门正式立案调查，且正处于调查期间的；

（三）能源中心认为市场出现重大风险的；

（四）能源中心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 遇特殊情况造成能源中心不能按时提供结算数

据的，能源中心将另行通知提供结算数据的时间。

第四十八条 会员每天应当及时获取能源中心提供的结算数据，做好核对工作，并将之妥善保存，该结算数据应当至少保存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 会员对结算数据的正确性有异议的，应当在不晚于下一交易日开市前三十分钟以书面形式通知能源中心。遇特殊情况的，会员可以在下一交易日开市后二小时内以书面形式通知能源中心。

能源中心将及时予以处理和反馈。

会员在规定时间内没有对结算数据提出异议的，视为该会员认可结算数据。

第五十条 结算完成后，能源中心将会员的资金划转数据传递给有关指定存管银行。指定存管银行应当及时~~进行处理并~~将划账结果反馈给能源中心。

第五十一条 能源中心在每月的第一个交易日向会员提供上月的资金结算表（加盖结算专用章）、上海国际能源交易中心~~手续费~~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 会员具有以下情形之一的，该会员及其结算交割委托人可以申请移仓，经能源中心批准后予以办理：

（一）因故不能从事期货相关业务的；

（二）发生合并、分立、停业、解散、破产的；

（三）变更委托结算关系的；

（四）能源中心规定的其他移仓情形。

能源中心可以要求提供移入和移出仓位的会员同意移仓的声明书、客户同意移仓的声明书、变更委托结算关系声明书、相关持仓的详细清单等一项或者多项移仓申请材料。

~~在会员破产但未提出申请等特殊情况下，为保护客户权益，能源中心可以启动应急预案，办理客户移仓。~~

第五十三条 在会员破产但未提出申请等特殊情况下，为保护客户权益，能源中心可以启动应急预案，办理客户移仓。

第五十四~~五十三~~条 移仓申请经批准后，能源中心与会员可以约定某一交易日为移仓结算日。

第五十五~~五十四~~条 移仓内容限于持仓及交易保证金。当日的盈亏、手续费、税款、结算准备金最低余额等其他款项不属于移仓内容~~，应当由移出仓位的会员结清~~。

第五十六~~五十五~~条 能源中心将在移仓结算日结算完成后办理移仓，并向相关会员提供移仓前和移仓后的相关结算报表。

相关会员应当核对并确认相关结算报表，一经确认，不得更改。

第四章 交割结算

第五十七~~五十六~~条 合约可以采用实物交割方式或现金交割方式。

采用实物交割方式的，交易双方按照能源中心的规则和程序，通过该合约所载标的物所有权的转移，了结到期未平仓合约。

采用现金交割方式的，合约最后交易日收市后，能源中心以交割结算价为基准，划付持仓双方的盈亏，了结到期未平仓合约。

第五十八~~五十七~~条 交割结算的基准价为该期货合约最后交

易日的结算价，各品种期货业务细则另有规定的，按照其规定执行。~~交割结算价是期货合约交割结算的基准价，计算方式由《上海国际能源交易中心交割细则》规定。~~

第五十九~~五十八~~条 会员进行交割，应当按规定向能源中心交纳交割手续费。~~能源中心可以向参与交割的买方会员、卖方会员收取交割手续费，具体标准由《上海国际能源交易中心交割细则》规定。~~

第六十~~五十九~~条 采用实物交割方式的，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者银行划转方式办理。使用内转方式的会员应当在第三交割日 14:00 前向能源中心提交内转申请，能源中心在会员结算准备金中内转交割货款。~~。买方会员未在第三交割日 14:00 前支付交割货款的，能源中心可以从其结算准备金中直接内转交割货款。~~使用银行划转方式的会员，买方交割货款可以以贷记凭证、本票、支票或者能源中心认可的其他方式划入能源中心专用结算账户，卖方交割货款由能源中心划至会员专用资金账户。

买方会员未在第三交割日 14:00 前支付交割货款的，能源中心可以从其结算准备金中直接内转交割货款。

第六十一~~六十~~条 采用实物交割方式的，买方、卖方以期货合约的交割结算价为基础，再加上因交割商品的品级、质量、产地、交割地等不同由能源中心确定的交割升贴水进行交割结算。

第六十二~~六十一~~条 采用实物交割方式的，交割结算时的发票开具应当执行国家有关规定。

能源中心向买方会员开具发票，向卖方会员收取发票。会员

接受委托结算的，买方会员向其结算交割委托人开具发票，向能源中心收取发票；卖方会员向能源中心开具发票，向其结算交割委托人收取发票。

卖方会员最迟应当在最后交割日 15:00 前将发票交至能源中心。

第六十三~~六十二~~条 采用实物交割方式的，卖方会员迟交发票 3 至 10 天的，每天应当缴纳货款金额 0.5‰的滞纳金；迟交 11 至 30 天的，每天应当缴纳货款金额 1‰的滞纳金；超过 30 天未交发票的，视为不交发票，应当缴纳货款金额 15%的违约金。

第六十四~~六十三~~条 采用实物交割方式的，卖方会员在第一交割日 15:00 前办妥标准仓单事宜的，能源中心当日结算时清退其相应的保证金。

买方会员在第三交割日 14:00 前办妥货款事宜的，能源中心当日结算时清退其相应的保证金；在 14:00 后办妥的，能源中心将在下一交易日结算时清退其相应的保证金。

卖方会员在第三交割日 14:00 前未办妥发票事宜的，能源中心当日对相应交割持仓以该合约交割结算价收取不低于 15%的保证金。在第四、五交割日 14:00 前办妥发票事宜的，能源中心当日结算时清退其相应的保证金；在 14:00 后办妥的，能源中心将在下一交易日结算时清退其相应的保证金。

第六十五~~六十四~~条 各品种期货业务细则对于交割结算、出入库溢短结算及发票流程另有规定的，按照其规定执行。~~《上海国际能源交易中心交割细则》对交割结算和发票流程另有规定的，按照相关规定执行。~~

第五章 委托结算

第六十六~~六十五~~条 境外中介机构委托期货公司会员或者境外特殊经纪参与者进行交易结算的，应当与其签订委托代理协议，并应当在办理业务前向能源中心备案。

期货公司会员与境外中介机构的委托代理业务应当遵守《上海国际能源交易中心会员管理办法~~细则~~》的相关规定。境外特殊经纪参与者与境外中介机构的委托代理业务应当遵守《上海国际能源交易中心境外特殊参与者管理办法~~细则~~》的相关规定。

第六十七~~六十六~~条 境外特殊参与者应当且只能委托一家会员进行结算。

第六十八~~六十七~~条 会员与委托其结算的境外特殊参与者应当签署包括下列内容的委托结算的协议：

（一）结算准备金最低余额和交易保证金收取标准；

（二）办理作为保证金的资产及其费用标准；

（三）风险管理措施、条件及程序；

（四）账户类型及管理模式、结算流程，包括结算数据收取、查询和确认的时间和方式；

（五）手续费标准；

（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）其他事项。

第六十九~~六十八~~条 会员通过保证金专用账户与委托其结算的境外特殊参与者、委托其交易结算的境外中介机构的期货结算账户进行期货业务资金往来。

会员受托为境外中介机构交易结算或者为境外特殊经纪参与者结算的，可以以境外中介机构或者境外特殊经纪参与者的名义在内部开设综合资金账户，允许其将一个及以上境外客户的资金合并在综合资金账户中。会员对境外中介机构或者境外特殊经纪参与者通过综合资金账户进行统一结算和风险控制。

第七十~~六十九~~条 具有下列情形之一的，能源中心可以为会员和委托其结算的境外特殊参与者办理委托结算关系变更手续：

（一）委托结算的协议期满后不再续约的；

（二）委托结算的协议提前解除的；

（三）会员因故不能为境外特殊参与者进行结算的；

（四）能源中心认定的其他情形。

第七十一~~七十~~条 具有第七十~~六十九~~条第一项情形的，境外特殊参与者、移入和移出委托结算的会员应当在协议期满前第10个交易日以前，向能源中心提交下列材料办理委托结算关系变更手续：

（一）变更委托结算关系申请书；

（二）境外特殊参与者和移入受托结算的会员签订的委托结算的协议；

（三）能源中心规定的其他材料。

能源中心收到完整材料后，在10个交易日内对申请材料进

行审核。审核通过的，能源中心通知变更委托结算关系的约定结算日。

第七十二~~七十一~~条 具有第七十~~六十九~~条第~~（二）~~、~~（三）~~项情形的，境外特殊参与者、移入和移出委托结算的会员除提交第七十一~~七十~~条规定的材料外，还应当提交解除原委托结算关系的协议。能源中心收到完整材料后，在 10 个交易日内对申请材料进行审核。审核通过的，能源中心通知变更委托结算关系的约定结算日。

第七十三~~七十二~~条 能源中心在约定结算日结算后办理委托结算关系变更，对持仓、相应的交易保证金及结算准备金等其他款项进行移转，并提供移转清单。移入和移出受托的会员应当对移转清单核对确认，境外特殊参与者应当委托移入和移出的会员进行确认。

在约定结算日结算后，市场出现重大风险或者能源中心认定的其他情形的，能源中心可以暂停办理委托结算关系变更手续。

境外特殊参与者、移入和移出委托结算的会员应当配合办理委托结算关系变更手续。在委托结算关系变更完成之前，移出委托结算的会员对其代为结算的持仓负有履约义务。

第六章 作为保证金的资产

第七十四~~七十三~~条 客户、境外中介机构、境外特殊参与者以资产作为保证金的，视为同意期货公司会员将其资产提交能源中心作为保证金。

客户、境外特殊参与者、境外中介机构、会员以资产作为保证金的，视为授权能源中心对相应资产进行划转或者作质押处

理。

第七十五~~七十四条~~ 经能源中心批准，以下资产可以作为保证金：

（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）外汇资金（币种类别、折算方式和适用范围等由能源中心另行公布）；

（四）能源中心认定的其他资产。

作为保证金的资产具体由能源中心确定并向市场公布。

第七十六~~七十五条~~ 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。

第七十七~~七十六条~~ 办理有价证券作为保证金的手续：

（一）申请：客户、境外特殊参与者、境外中介机构应当通过期货公司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，应当向能源中心提出申请。具体办理时间由能源中心另行通知。

（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能源中心办理交存手续，获能源中心批准后，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、境外特殊非经纪参与者、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。能源中心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能源中心的规定。

第七十八~~七十七~~条 作为保证金的资产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，能源中心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。

当日收市前，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，能源中心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。能源中心有权对国债的基准价进行调整。

（三）其他资产作为保证金的，其市值计算的基准价由能源中心核定。

第七十九~~七十八~~条 作为保证金的资产的市值按照折扣比率计算后的金额称为折后金额。具体的折扣比率由能源中心确定、调整并公布，其中标准仓单、国债等有价证券的折后金额不高于其市值的 80%。[1]

能源中心每日结算时，按规定的基准价调整作为保证金的资产市值和折后金额。

第八十~~七十九~~条 能源中心按照会员在能源中心任一内部明细账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。

能源中心按照有价证券的折后金额和最大配比金额中的较

[1] 关于折扣比率，能源中心正在做相应修订。能源中心将根据两个业务的进展情况，酌情调整。

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，能源中心将该笔有价证券的实际可用金额计入会员结算准备金。

能源中心在每日结算时，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。

第八十一~~八十条~~ 能源中心有权根据市场状况调整资产作为保证金的基准价、折扣比率、配比乘数，由能源中心另行通知。

第八十二~~八十一条~~ 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。

第八十三~~八十二条~~ 有价证券作为保证金的期限不得超过能源中心规定的该有价证券的有效期。届满后仍需作为保证金的，应当重新办理手续。

第八十四~~八十三条~~ 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，能源中心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。

第八十五~~八十四条~~ 出现下列情况之一的，能源中心可以取消有关会员资产作为保证金的额度：

（一）会员、境外特殊参与者、境外中介机构提取和运用资金出现较大风险并有可能危及能源中心合法权益的；

（二）作为保证金的资产出现瑕疵或者发生重大风险的；

（三）能源中心认为必要的其他情形。

能源中心取消会员资产作为保证金的额度后，会员保证金不足的，应当给予补足。

第八十六~~八十五条~~ 会员办理资产提取或者解除质押的，应当弥补相应的保证金。具体办理时间由能源中心另行通知。

第八十七~~八十六条~~ 办理资产作为保证金的，会员应当向能源中心交纳手续费。手续费由能源中心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能源中心确定、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。

第八十八~~八十七条~~ 当会员不履行或者不能完全履行交易保证金债务和相关债务时，能源中心有权处置作为保证金的资产，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资产时产生的损失及费用。

第八十九~~八十八条~~ 能源中心处置作为保证金的有价证券的，可以按照有价证券的市场流动性、有效期限、处置效率等因素选择需要处置的有价证券。

有价证券的处置方式为拍卖、变卖和协议折价等，能源中心可以根据情况确定处置方式，具体处置由能源中心自行办理或者委托托管机构按照有关规定办理。

使用拍卖、变卖等公开处置方式时，能源中心可以公布会员交存至能源中心的全部有价证券，由市场参与者根据公布的有价证券提交申购意向。

第七章 风险与责任

第九十~~八十九条~~ 会员对应当履行其在能源中心成交的合约相关义务和责任，承担相关风险。

能源中心按照交易规则、结算规则组织期货交易，完成的结算交割、收取的保证金或其他作为保证金使用的资产，以及采取的违约处理措施，不因会员进入破产程序而被撤销或者无效。

会员进入破产程序，能源中心仍可以按照交易规则、结算规则及其业务规则~~实施细则~~，对该会员未了结的合约进行净额结算。

能源中心因资不抵债被接管或者进入破产程序的，会员可按照能源中心交易规则、结算规则及其业务规则~~实施细则~~或者依据其与能源中心的合同约定，终止所有未了结的合约，并进行净额结算。

第九十一~~九十~~条 风险防范实行分级负责制。能源中心对会员进行风险管理；会员对其结算交割委托人进行风险管理；期货公司会员、境外特殊经纪参与者、境外中介机构对其客户进行风险管理。

第九十二~~九十一~~条 会员不能履行合约相关义务和责任的，能源中心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~~强行~~平仓后释放的保证金能够履行合约相关义务和责任为止；

（四）将交存的作为保证金使用的资产~~处置~~变现，用变现所得履行合约相关义务和责任。

第九十三~~九十二~~条 如采取前条措施~~采取本细则第九十一条措施~~后会员仍无法履行合约相关义务和责任的，能源中心按以下

步骤履行合约相关义务和责任：

（一）动用风险准备金；

（二）动用能源中心的自有资产；~~。~~

（三）通过法律程序继续对会员进行追偿。

~~能源中心履行合约相关义务和责任后，通过法律程序对会员进行追偿。~~

第九十四~~九十四条~~ 能源中心实行风险准备金制度。风险准备金是指由能源中心设立，用于为维护期货市场正常运转~~、~~提供财务担保以及弥补因能源中心不可预见~~的~~风险~~所~~带来的亏损的资金~~损失~~。

第九十五~~九十四条~~ 风险准备金的来源包括：

（一）能源中心按照向会员收取手续费收入 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中国证监会和其他监管机构规定的标准时，经中国证监会批准后可以不再提取。

第九十六~~九十五条~~ 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。

第九十七~~九十六条~~ 风险准备金的动用应当经能源中心董事会批准，报告中国证监会后按规定的用途和程序进行。

第八章 附则

第九十八条 各品种期货业务细则另有规定的，按照其规定执行。

第九十九~~九十七条~~ 能源中心对于期权结算业务~~合约结算~~另

有规定的，适用其规定。~~，未有明确规定的，适用本细则。本细则中的“期货市场”“期货业务”“期货相关业务”“期货交易”等表述，包括期权业务及相关活动，另有规定的除外。~~

第一百条 违反本办法细则规定的，能源中心按《上海国际能源交易中心违规处理办法~~实施细则~~》的有关规定处理。

第一百零一~~九十八~~条 本办法细则解释权属能源中心。

第一百零二~~九十九~~条 本办法细则自 年 月 日~~2026 年 6 月 21 日~~起实施。