

股指期货法律法规汇编

一、交易所规则	1
中国金融期货交易所交易规则	1
中国金融期货交易所违规违约处理办法	9
中国金融期货交易所交易细则	18
中国金融期货交易所结算细则	26
中国金融期货交易所结算会员结算业务细则	34
中国金融期货交易所会员管理办法	39
中国金融期货交易所信息管理办法	47
中国金融期货交易所风险控制管理办法	57
中国金融期货交易所套期保值管理办法	65
股指期货投资者适当性制度实施办法（试行）	67
二、期货法规	73
关于建立股指期货投资者适当性制度的规定（试行）	73
关于股指期货投资者适当性制度征求意见情况的说明	75
期货投资者保障基金管理暂行办法	76
期货交易管理条例	79
期货交易所管理办法	100
期货公司管理办法	118
期货公司金融期货结算业务试行办法	139
证券公司为期货公司提供中间介绍业务试行办法	147
期货公司风险监管指标管理试行办法	153
证券期货市场统计管理办法	159
期货公司董事、监事和高级管理人员任职资格管理办法	165
沪深 300 股指期货合约	177

一、交易所规则

中国金融期货交易所交易规则

第一章 总 则

第一条 为规范期货交易行为，保护期货交易当事人的合法权益和社会公共利益，根据国家有关法律、行政法规、规章和《中国金融期货交易所章程》，制定本规则。

第二条 中国金融期货交易所（以下简称交易所）根据公开、公平、公正和诚实信用的原则，组织经中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）批准的期货合约、期权合约交易。

第三条 本规则适用于交易所组织的期货、期权交易活动。交易所、会员、客户、

期货保证金存管银行及期货市场其他参与者应当遵守本规则。

第二章 品种与合约

第四条 交易所上市经中国证监会批准的交易品种。

第五条 期货合约是指由交易所统一制定的、规定在将来某一特定的时间和地点交割一定数量标的物的标准化合约。

第六条 期权合约是指由交易所统一制定的、规定买方有权在将来某一时间以特定价格买入或者卖出约定标的物(包括期货合约)的标准化合约。

第七条 期货合约主要条款包括合约标的、报价单位、最小变动价位、合约月份、交易时间、最低交易保证金、每日价格最大波动限制、最后交易日、交割方式、交易代码等。

第八条 期权合约主要条款包括合约标的、报价单位、最小变动价位、合约月份、交易时间、执行价格间距、卖方交易保证金、每日价格最大波动限制、最后交易日、执行方式、交易代码等。

第九条 合约的附件与合约具有同等法律效力。

第三章 会员管理

第十条 会员是指根据有关法律、行政法规和规章的规定，经交易所批准，有权在交易所从事交易或者结算业务的企业法人或者其他经济组织。

第十一条 交易所的会员分为交易结算会员、全面结算会员、特别结算会员和交易会员。

第十二条 交易结算会员、全面结算会员和特别结算会员具有与交易所进行结算的资格。

交易结算会员只能为其客户办理结算、交割业务。

全面结算会员可以为其客户和与其签订结算协议的交易会员办理结算、交割业务。

特别结算会员只能为与其签订结算协议的交易会员办理结算、交割业务。

第十三条 交易会员可以从事经纪或者自营业务，不具有与交易所进行结算的资格。

第十四条 会员资格的批准、变更和终止，须经交易所会员资格审查委员会预审，董事会批准，报告中国证监会，并予以公布。

第十五条 会员享有下列权利：

- (一) 在交易所从事规定的交易、结算和交割等业务；
- (二) 使用交易所提供的交易设施，获得有关期货交易的信息和服务；
- (三) 按照交易所交易规则行使申诉权；
- (四) 交易所交易规则及其实施细则规定的其他权利。

第十六条 会员应当履行下列义务：

- (一) 遵守国家有关法律、行政法规、规章和政策；
- (二) 遵守交易所的章程、交易规则及其实施细则和有关决定；
- (三) 按照规定缴纳各种费用；

- (四) 接受交易所监督管理;
- (五) 履行与交易所所签订协议中规定的相关义务;
- (六) 交易所规定应当履行的其他义务。

第十七条 申请成为交易所会员应当符合法律、行政法规、规章和交易所规定的资格条件。

第十八条 申请或者变更会员资格应当向交易所提出书面申请,在获得交易所批准后,与交易所签订相关协议。

第十九条 交易所建立会员联系人制度。会员应当设业务代表一名、业务联络员若干名,组织、协调会员与交易所的各项业务往来。

第二十条 会员出现下列情形之一的,交易所有限限制、暂停其业务或者调整、取消其会员资格:

- (一) 违反交易所的会员管理规定;
- (二) 不再符合会员资格条件;
- (三) 不符合中国证监会或者交易所相关规定。

第二十一条 交易所制定会员管理办法,对会员进行监督管理。

第二十二条 交易所可以根据市场发展,对会员的业务运作、风险管理、技术系统等提出要求,会员应当持续满足上述要求。

第四章 交易业务

第二十三条 期货交易是指在交易所内集中买卖期货合约、期权合约的交易活动。

第二十四条 交易日为每周一至周五(国家法定假日除外)。每一交易日各品种的交易时间安排,由交易所另行公告。

第二十五条 会员可以根据业务需要向交易所申请一个或者一个以上的席位。

第二十六条 会员在为客户开立账户前,应当向客户充分揭示期货交易风险,评估客户的风险承受能力,审慎选择客户。

第二十七条 交易所实行交易编码制度。会员应当为每一个客户单独开立专门账户、申请交易编码,不得混码交易。

根据法律、行政法规、规章和有关规定需要对资产进行分户管理的特殊法人机构,可以为其分户管理的资产向交易所申请交易编码。

第二十八条 客户可以通过书面、电话、互联网等委托方式以及中国证监会规定的其他方式,下达交易指令。

第二十九条 交易指令分为市价指令、限价指令及交易所规定的其他指令。

市价指令是指不限定价格的、按照当时市场上可执行的最优报价成交的指令。市价指令的未成交部分自动撤销。

限价指令是指按照限定价格或者更优价格成交的指令。限价指令当日有效,未成交部分可以撤销。

第三十条 会员接受客户委托指令后,应当将客户的所有指令通过交易所集中交易,不得进行场外交易。

第三十一条 买卖申报经撮合成交后,交易即告成立。符合本规则各项规定达成的

交易于成立时生效，买卖双方应当承认交易结果，履行相关义务。依照本规则达成的交易，其成交结果以交易所系统记录的成交数据为准。

第三十二条 交易指令成交后，交易所按照规定发送成交回报。

第三十三条 每日结算后，会员应当按照规定方式获取并核对成交记录。

会员有异议的，应当在当日以书面形式向交易所提出。未在规定时间内提出的，视为对成交记录无异议。

第三十四条 交易所实行套期保值额度审批制度。套期保值额度由交易所根据套期保值申请人的现货头寸、资信状况和市场情况审批。

第三十五条 会员进行期货交易，应当按照规定向交易所缴纳手续费。

第五章 结算业务

第三十六条 结算业务是指交易所根据交易结果、公布的结算价格和交易所有关规定对交易双方的交易盈亏状况进行资金清算和划转的业务活动。

第三十七条 期货交易的结算，由交易所统一组织进行。

第三十八条 交易所实行会员分级结算制度。交易所对结算会员进行结算，结算会员对其受托的交易会员进行结算，交易会员对其客户进行结算。

结算会员对其受托交易会员的期货交易承担履约责任，交易会员无法履约时，结算会员应当代为履约，并取得对违约交易会员的相应追偿权。

第三十九条 交易所实行保证金制度。保证金是交易所向结算会员收取的用于结算和担保合约履行的资金。

经交易所批准，会员可以用中国证监会认定的有价证券充抵保证金。

第四十条 保证金分为结算准备金和交易保证金。结算准备金是指未被合约占用的保证金；交易保证金是指已被合约占用的保证金。

第四十一条 结算会员向交易会员收取的保证金不得低于交易所规定的保证金标准。结算会员有权根据市场运行情况和交易会员的资信状况调整对其收取保证金的标准。

第四十二条 交易所在期货保证金存管银行开设专用结算账户，用于存放结算会员的保证金及相关款项。

结算会员应当在期货保证金存管银行开设期货保证金账户，用于存放其客户及受托交易会员的保证金及相关款项。

第四十三条 交易所与结算会员之间的期货业务资金往来应当通过交易所专用结算账户和结算会员专用资金账户办理。

第四十四条 会员应当将客户缴纳的保证金存放于期货保证金账户，并与其自有资金分别保管，不得挪用。

第四十五条 交易所实行当日无负债结算制度。

第四十六条 结算会员结算准备金余额低于规定水平且未按时补足的，如果结算准备金余额小于规定的最低余额，不得开仓；如果结算准备金余额小于零，交易所可以按照规定对其进行强行平仓。

第四十七条 交易会员只能委托一家结算会员为其办理结算交割业务，交易会员应

当与结算会员签订协议，并将协议报交易所备案。

第四十八条 交易会员和结算会员可以根据交易所规定，向交易所申请变更委托结算关系，交易所审核通过后为其办理。

第四十九条 结算会员应当建立结算风险管理制度。结算会员应当及时准确地了解客户及受托交易会员的盈亏、费用及资金收付等财务状况，控制客户及受托交易会员的风险。

第五十条 交易所应当按照有关规定提取、管理和使用风险准备金。风险准备金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损失。

第六章 交割业务

第五十一条 期货交易的交割，由交易所统一组织进行。

第五十二条 期货交割采用现金交割或者实物交割方式。

第五十三条 现金交割是指合约到期时，按照交易所的规则和程序，交易双方按照规定结算价格进行现金差价结算，了结到期未平仓合约的过程。

第五十四条 实物交割是指合约到期时，按照交易所的规则和程序，交易双方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的过程。

第七章 风险控制

第五十五条 交易所实行涨跌停板制度。涨跌停板幅度由交易所设定，交易所可以根据市场风险状况调整期货合约的涨跌停板幅度。

第五十六条 交易所实行持仓限额制度。持仓限额是指交易所规定的会员或者客户对某一合约单边持仓的最大数量。会员或者客户的套期保值、套利交易的持仓按照交易所有关规定执行。

第五十七条 交易所实行大户持仓报告制度。会员或者客户对某一合约持仓达到交易所规定的持仓报告标准或者被交易所指定必须报告的，会员或者客户应当向交易所报告。客户未报告的，会员应当向交易所报告。

交易所可以根据市场风险状况，制定并调整持仓报告标准。

第五十八条 交易所实行强行平仓制度。会员或者客户存在违规超仓、未按照规定及时追加保证金等违规行为或者交易所规定的其他情形的，交易所所有权对相关会员或者客户采取强行平仓措施。

强行平仓盈利部分按照有关规定处理，发生的费用、损失及因市场原因无法强行平仓造成的损失扩大部分由相关会员或者客户承担。

第五十九条 交易所实行强制减仓制度。期货交易出现同方向连续涨跌停板单边无连续报价或者市场风险明显增大情况的，交易所所有权将当日以涨跌停板价格申报的未成交平仓报单，以当日涨跌停板价格与该合约净持仓盈利客户按照持仓比例自动撮合成成交。

第六十条 交易所实行结算担保金制度。结算担保金是指结算会员按照交易所规定缴纳的，用于应对结算会员违约风险的共同担保资金。

第六十一条 交易所实行风险警示制度。交易所认为必要的，可以单独或者同时采

取要求会员和客户报告情况、谈话提醒、书面警示和发布风险警示公告等措施，以警示和化解风险。

第六十二条 期货交易出现同方向连续涨跌停板单边无连续报价或者市场风险明显增大情况的，经交易所董事会执行委员会审议批准，交易所可以采取调整涨跌停板幅度、提高交易保证金标准及强制减仓等风险控制措施化解市场风险。

采取上述风险控制措施后仍然无法释放风险的，交易所应当宣布进入异常情况，由交易所董事会决定采取进一步的风险控制措施。

第六十三条 结算会员无法履约时，交易所所有权采取下列措施：

- （一）暂停开仓；
- （二）按照规定强行平仓，并用平仓后释放的保证金履约赔偿；
- （三）依法处置充抵保证金的有价证券；
- （四）动用该违约结算会员缴纳的结算担保金；
- （五）动用其他结算会员缴纳的结算担保金；
- （六）动用交易所风险准备金；
- （七）动用交易所自有资金。

交易所代为履约后，取得对违约会员的相应追偿权。

第六十四条 有根据认为会员或者客户违反交易所交易规则及其实施细则并且对市场正在产生或者将产生重大影响的，为防止违规行为后果进一步扩大，交易所可以对该会员或者客户采取下列临时处置措施：

- （一）限制入金；
- （二）限制出金；
- （三）限制开仓；
- （四）提高保证金标准；
- （五）限期平仓；
- （六）强行平仓。

前款第（一）、（二）、（三）项临时处置措施，可以由交易所总经理决定，其他临时处置措施由交易所董事会决定，并及时报告中国证监会。

第八章 异常情况处理

第六十五条 在期货交易过程中，出现下列情形之一的，交易所可以宣布进入异常情况，采取紧急措施化解风险：

- （一）因地震、水灾、火灾等不可抗力或者计算机系统故障等不可归责于交易所的原因导致交易无法正常进行；
- （二）会员出现结算、交割危机，对市场正在产生或者将产生重大影响；
- （三）出现本规则第六十二条情况并采取相应措施后仍未化解风险；
- （四）交易所规定的其他情况。

出现前款第（一）项异常情况时，交易所总经理可以采取调整开市收市时间、暂停交易等紧急措施；出现前款第（二）、（三）、（四）项异常情况时，交易所董事会可以决定采取调整开市收市时间、暂停交易、调整涨跌停板幅度、提高交易保证金、限期

平仓、强行平仓、限制出金等紧急措施。

因交易异常情况及交易所采取的相应措施造成的损失，交易所不承担责任。

第六十六条 交易所宣布进入异常情况并决定采取紧急措施前应当报告中国证监会。

第六十七条 交易所宣布进入异常情况并决定暂停交易的，暂停交易的期限不得超过3个交易日，但经中国证监会批准延长的除外。

第九章 信息管理

第六十八条 交易所期货交易信息是指期货、期权上市合约的交易行情、交易结算数据、统计资料、交易所发布的各种公告信息以及中国证监会要求披露的其他相关信息。

第六十九条 交易所期货交易信息所有权属于交易所，由交易所统一管理和发布。

第七十条 交易所发布的交易信息包括：合约名称、合约月份、开盘价、最新价、涨跌、收盘价、结算价、最高价、最低价、成交量、持仓量及其持仓变化、结算会员成交量和持仓量排名等其他需要公布的信息。

信息发布应当根据不同内容按照实时、每日、每周、每月、每年定期发布。

第七十一条 交易所应当采取有效通讯手段，建立同步报价和即时成交回报系统。

第七十二条 因不可抗力、意外事件、交易所系统被非法侵入等原因导致交易信息传输发生异常或者中断的，交易所不承担责任。

交易所的行情发布正常，但因会员、信息服务机构或者公共媒体等转发发生故障，影响会员和客户交易的，交易所不承担责任。

第七十三条 交易所、会员不得发布虚假的或者带有误导性质的信息。

第七十四条 交易所、会员和期货保证金存管银行不得泄露业务中获取的商业秘密。

经批准，交易所可以向有关监管部门或者其他相关单位提供相关信息，并执行相应的保密规定。

第七十五条 为保证交易数据的安全，交易所应当实行异地数据备份。

第七十六条 交易所管理和发布信息，有权收取相应费用。

第十章 监督管理

第七十七条 交易所依据本规则和有关规定，对与交易所期货交易有关的业务活动实施自律监督管理。

会员、客户、期货保证金存管银行及期货市场其他参与者应当接受交易所对其期货业务的监督管理。

第七十八条 交易所监督管理的主要内容为：

（一）监督、检查期货市场法律、行政法规、规章和交易规则及其实施细则的落实情况，控制市场风险；

（二）监督、检查会员业务运作及内部管理状况；

（三）监督、检查会员的财务、资信状况；

（四）监督、检查期货保证金存管银行及期货市场其他参与者与期货有关的业务活

动；

（五）调解、处理期货交易纠纷，调查处理有关违规案件；

（六）协助司法机关、行政执法机关依法执行公务；

（七）对其他违背“公开、公平、公正”原则、扰乱市场秩序、制造市场风险的行为进行监督管理。

第七十九条 交易所履行监督管理职责时，可以行使下列职权：

（一）查阅、复制与期货交易有关的信息、资料；

（二）对会员、客户、期货保证金存管银行以及期货市场其他参与者等进行调查、取证；

（三）要求会员、客户、期货保证金存管银行以及期货市场其他参与者等对被调查事项做出申报、陈述、解释、说明；

（四）交易所履行监督管理职责所必需的其他职权。

第八十条 交易所履行监督管理职责时，会员、客户、期货保证金存管银行及期货市场其他参与者应当配合。对不如实提供资料、隐瞒事实真相、故意回避调查或者妨碍交易所工作人员行使职权的单位和个人，交易所可以按照有关规定采取必要措施或者进行处理。

第八十一条 交易所每年应当对会员遵守交易所交易规则及其实施细则的情况进行抽样或者全面检查，并将检查结果上报中国证监会。

第八十二条 交易所发现会员、客户、期货保证金存管银行及期货市场其他参与者在从事期货相关业务时涉嫌违规的，应当立案调查；情节严重的，交易所可以采取相应措施防止违规行为后果进一步扩大。

第八十三条 交易所工作人员不能正确履行监督管理职责的，会员、客户、期货保证金存管银行及期货市场其他参与者有权向交易所或者中国证监会投诉、举报。经查证属实的，应当严肃处理。

第八十四条 交易所制定违规违约处理办法对违规违约行为进行处理。

第八十五条 交易所在中国证监会统一组织和协调下，与证券交易所、证券登记结算机构和期货保证金安全存管监控机构等相关机构，建立对期货市场和相关信息共享等监管协作机制。

第十一章 争议处理

第八十六条 会员、客户、期货保证金存管银行及期货市场其他参与者之间发生的有关期货业务纠纷，可以自行协商解决、提请交易所调解、向仲裁机构申请仲裁或者向人民法院提起诉讼。

第八十七条 提请交易所调解的当事人，应当提出书面调解申请。经调解达成协议后，交易所制作调解书，经双方当事人调解书上签字确认后生效。

第十二章 附 则

第八十八条 交易所可以根据本规则制定实施细则或者办法。

第八十九条 本规则由交易所董事会负责解释。

第九十条 本规则的制定和修改须经交易所股东大会通过，报中国证监会批准。

第九十一条 本规则自2010年2月20日起施行。

中国金融期货交易所违规违约处理办法

第一章 总 则

第一条 为依法对期货市场进行管理，规范期货交易行为，保障期货市场参与者的合法权益，根据《期货交易管理条例》、《期货交易所管理办法》、《中国金融期货交易所章程》和《中国金融期货交易所交易规则》等有关规定，制定本办法。

第二条 中国金融期货交易所（以下简称交易所）对参与期货交易的会员、客户、期货保证金存管银行、信息服务机构及期货市场其他参与者进行日常检查、调查、认定和处理违规违约行为，适用本办法。

第三条 交易所根据公平、公正的原则，以事实为依据，依照国家法律、行政法规、规章和本办法，对期货市场的违规违约行为进行调查、认定和处理。

违规行为涉嫌犯罪的，移交司法机关处理。

第四条 交易所调查、认定和处理违规违约行为，应当做到事实清楚、证据确凿、程序规范、适用规定准确、处理决定适当。

第二章 日常检查与立案调查

第五条 日常检查是指交易所根据其各项规章制度，对会员、客户、期货保证金存管银行、信息服务机构及期货市场其他参与者的业务活动进行的定期和不定期监督检查。

第六条 交易所履行监管职责时，可以行使下列职权：

- （一）查阅、复制与期货交易有关的信息、资料；
- （二）对会员、客户、期货保证金存管银行、信息服务机构等单位 and 人员进行调查、取证；
- （三）要求会员、客户、期货保证金存管银行、信息服务机构等被调查者申报、陈述、解释、说明有关情况；
- （四）查询会员的期货保证金账户；
- （五）检查会员的交易、结算及财务等技术系统；
- （六）制止、纠正、处理违规违约行为；
- （七）交易所履行监管职责所必需的其他职权。

第七条 会员、客户、期货保证金存管银行、信息服务机构及期货市场其他参与者应当接受交易所的监督检查，配合交易所履行监管职责，如实提供交易所要求提供的文件和资料。

第八条 交易所受理书面或者口头投诉、举报。受理口头投诉、举报应当制作笔录或者录音。

第九条 投诉人、举报人应当身份真实、明确；除法律、行政法规和规章另有规定外，交易所应当为投诉人、举报人保密。

第十条 交易所对日常检查工作中发现的、投诉举报的、监管部门和司法机关等单位移交的或者通过其他途径获得的线索进行审查，认为涉嫌违规的，应当予以立案调查。

第十一条 对已经立案的案件，交易所指定专人负责调查。

第十二条 调查取证应当由两名以上调查人员参加，并出示合法证件或者交易所的证明文件。

第十三条 调查人员认为自己与本案存在利害关系或者其他可能影响案件公正处理情形的，应当申请回避。

被调查人员认为调查人员与本案存在利害关系或者其他可能影响案件公正处理情形的，有权申请有关人员回避。

交易所认为调查人员应当回避的，决定其回避。

第十四条 证据包括书证、物证、视听资料、电子记录、证人证言、当事人陈述、调查笔录、鉴定结论等能够证明案件真相的一切材料。

证据应当经过调查核实方能作为定案的根据。

第十五条 询问被调查人应当制作调查笔录。调查笔录应当交被调查人核对，核对无误后由被调查人和调查人员签名。被调查人拒绝签名的，调查人员应当注明原因。

书证、物证的提取应当制作提取笔录，注明提取的时间和地点，并由被调查人签名。被调查人拒绝或者无法签名的，由见证人签名。

视听资料、电子记录的收集应当注明收集或者制作的时间、地点、方式、使用的设备及保存的条件，并由被调查人或者见证人签名。

调查取证时需要复制原件的，应当注明原件的保存单位（或者个人）和出处，由原件保存单位（或者个人）签注“与原件核对无误”，并由其盖章或者签名。

鉴定结论应当由中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）或者交易所认可的鉴定单位做出，并由鉴定单位和鉴定人签字盖章。

第十六条 会员、客户、期货保证金存管银行和信息服务机构及期货市场其他参与者涉嫌违规，经交易所立案调查的，在确认违规行为之前，为防止违规后果进一步扩大，保障处理决定的执行，交易所可以对被调查人采取下列临时处置措施：

- （一）暂停受理申请开立新的交易编码；
- （二）限制入金；
- （三）限制出金；
- （四）限制开仓；
- （五）降低持仓限额；
- （六）提高保证金标准；
- （七）限期平仓；
- （八）强行平仓。

采取前款第（一）至（五）项临时处置措施，可以由交易所总经理决定；其他临时

处置措施由交易所董事会决定，并及时报告中国证监会。

第十七条 交易所工作人员在日常检查和立案调查过程中，应当严格遵守保密制度，不得滥用职权。

违反前款规定的，交易所根据不同情节给予相应处分。

第三章 违规违约处理

第十八条 会员具有下列违反会员管理规定情形之一的，责令改正，并可以根据情节轻重，采取谈话提醒、书面警示、通报批评、公开谴责、限制开仓、强行平仓、暂停或者限制业务、调整或者取消会员资格等措施：

- (一) 以欺骗手段获取会员资格或者在资格变更中具有违规情形；
- (二) 未按照规定的期限和要求向交易所履行报告义务；
- (三) 任用不具备资格的期货从业人员；
- (四) 违反交易所会员联系人制度规定；
- (五) 不按照规定缴纳各种费用；
- (六) 违反交易所会员管理规定的其他情形。

第十九条 会员或者客户具有下列违反交易管理规定情形之一的，责令改正，并可以根据情节轻重，采取谈话提醒、书面警示、通报批评、公开谴责、限制开仓、强行平仓、暂停或者限制业务、调整或者取消会员资格等措施：

- (一) 为未按照规定履行开户手续的客户进行期货交易；
- (二) 未按照规定履行审核义务，为不符合开户条件的客户办理开户手续；
- (三) 违反交易指令和交易编码管理规定；
- (四) 利用席位窃取商业秘密或者破坏交易所系统；
- (五) 私下转包、转租或者转让席位；
- (六) 违反交易所应急交易厅管理规定；
- (七) 违反交易所交易管理规定的其他情形。

上述违规行为同时构成违约的，应当按照相关协议中关于违约责任条款的约定，向交易所支付惩罚性违约金。没有违规所得或者违规所得不满10万元的，支付50万元以下惩罚性违约金；违规所得10万元以上的，支付违规所得1倍以上5倍以下惩罚性违约金。

会员有本条所列行为的，交易所可以给予责任人暂停从事交易所期货业务的处理；情节严重的，取消其从事交易所期货业务的资格。

第二十条 会员具有下列欺诈客户行为之一的，责令改正，并可以根据情节轻重，采取谈话提醒、书面警示、通报批评、公开谴责、限制开仓、强行平仓、暂停或者限制业务、调整或者取消会员资格等措施：

- (一) 未按照规定向客户揭示风险；
- (二) 向客户做获利保证或者在经纪业务中与客户约定分享利益、共担风险；
- (三) 未按照规定接受客户委托或者未按照客户委托内容擅自进行期货交易；
- (四) 隐瞒重要事项或者使用其他不正当手段，诱骗客户发出交易指令；
- (五) 向客户提供虚假成交回报；
- (六) 未将客户交易指令下达到交易所；

(七) 其他欺诈客户的行为。

上述违规行为同时构成违约的，依照本办法第十九条第二款的规定处理。

会员有本条所列行为的，对责任人依照本办法第十九条第三款的规定处理。

第二十一条 全面结算会员、特别结算会员有下列行为之一的，责令改正，并可以根据情节轻重，采取谈话提醒、书面警示、通报批评、公开谴责、限制开仓、强行平仓、暂停或者限制业务、调整或者取消会员资格等措施：

(一) 未按照规定接受交易会员委托或者未按照交易会员委托内容擅自进行期货交易；

(二) 未将交易会员的交易指令下达到交易所；

(三) 向交易会员提供虚假成交回报；

(四) 违反交易所交易管理规定的其他行为。

上述违规行为同时构成违约的，依照本办法第十九条第二款的规定处理。

全面结算会员、特别结算会员有本条所列行为的，对责任人依照本办法第十九条第三款的规定处理。

第二十二条 会员或者客户有下列影响期货交易价格行为之一的，责令改正，并可以根据情节轻重，采取谈话提醒、书面警示、通报批评、公开谴责、限制开仓、强行平仓、暂停或者限制业务、调整或者取消会员资格等措施：

(一) 单独或者合谋，集中资金优势、持仓优势或者利用信息优势联合或者连续买卖合约，影响期货交易价格；

(二) 蓄意串通，按照事先约定的时间、价格和方式相互进行期货交易，影响期货交易价格或者期货交易量；

(三) 以自己为交易对象，自买自卖，影响期货交易价格或者期货交易量；

(四) 为影响期货市场行情囤积相关现货；

(五) 操纵相关现货市场价格而影响期货交易价格；

(六) 不以成交为目的或者明知申报的指令不能成交，仍恶意或者连续输入交易指令企图影响期货价格，扰乱市场秩序、转移资金或者进行利益输送；

(七) 利用内幕信息或者国家秘密进行期货交易或者泄露内幕信息影响期货交易；

(八) 通过其他方式影响期货交易价格的行为。

上述违规行为同时构成违约的，依照本办法第十九条第二款的规定处理。

会员有本条所列行为的，对责任人依照本办法第十九条第三款的规定处理。

第二十三条 会员或者客户在进行套期保值额度申请和套期保值交易时，有欺诈或者违反交易所规定行为的，责令改正，并可以根据情节轻重，采取谈话提醒、书面警示、通报批评、公开谴责、限制开仓、强行平仓、暂停或者限制业务、调整或者取消会员资格等措施。

上述违规行为同时构成违约的，依照本办法第十九条第二款的规定处理。

会员有本条所列行为的，对责任人依照本办法第十九条第三款的规定处理。

第二十四条 会员具有下列违反结算管理规定行为之一的，责令改正，并可以根据情节轻重，采取谈话提醒、书面警示、通报批评、公开谴责、限制开仓、强行平仓、暂停或者限制业务、调整或者取消会员资格等措施：

- (一) 未将自有资金与客户资金分户存放;
- (二) 未对客户保证金实行分账管理;
- (三) 无正当理由拖延客户出入金;
- (四) 向客户收取的交易保证金低于规定标准;
- (五) 允许客户在保证金不足时开仓交易;
- (六) 挪用或者擅自允许他人挪用客户资金或者套用不同账户资金;
- (七) 任用不具备期货从业人员资格的人员办理结算交割业务;
- (八) 未按照规定向客户提供有关成交结果、资金结算报表;
- (九) 未按照规定设立结算部门;
- (十) 未实行当日无负债结算制度;
- (十一) 违反中国证监会期货保证金安全存管监控的有关规定;
- (十二) 未按照规定提取、管理和使用风险准备金;
- (十三) 伪造、涂改或者未按照规定保存期货交易、结算、交割资料;
- (十四) 违反交易所结算管理规定的其他行为。

上述违规行为同时构成违约的,依照本办法第十九条第二款的规定处理。

会员有本条所列行为的,对责任人依照本办法第十九条第三款的规定处理。

第二十五条 结算会员具有下列违反结算管理规定行为之一的,责令改正,并可以根据情节轻重,采取谈话提醒、书面警示、通报批评、公开谴责、限制开仓、强行平仓、暂停或者限制业务、调整或者取消会员资格等措施:

- (一) 未按时足额缴纳保证金;
- (二) 交易结算会员私下为交易会员进行结算;
- (三) 未按照规定向交易所足额缴纳结算担保金;
- (四) 任用不具备结算交割员资格的人员办理结算交割业务;
- (五) 结算交割员未按照规定办理结算交割业务;
- (六) 在申请结算交割员资格时采取虚假、欺骗和不正当手段;
- (七) 伪造、涂改、借用结算交割员证件;
- (八) 违反交易所结算管理规定的其他行为。

上述违规行为同时构成违约的,依照本办法第十九条第二款的规定处理。

结算会员有本条所列行为的,对责任人依照本办法第十九条第三款的规定处理。

第二十六条 全面结算会员、特别结算会员受托为交易会员结算,具有下列违反结算管理规定行为之一的,责令改正,并可以根据情节轻重,采取谈话提醒、书面警示、通报批评、公开谴责、限制开仓、强行平仓、暂停或者限制业务、调整或者取消会员资格等措施:

- (一) 违反规定受托为不符合规定条件的交易会员进行结算;
- (二) 未与交易会员签订结算协议,或者未将结算协议向交易所报备,自行为交易会员进行结算;
- (三) 未对交易会员保证金实行分账管理;
- (四) 允许交易会员在保证金不足的情况下进行开仓交易;
- (五) 向交易会员收取的最低结算准备金低于交易所规定标准;

- (六) 向交易会员收取的保证金低于交易所保证金标准;
- (七) 挪用交易会员保证金, 或者违规划转交易会员保证金;
- (八) 未对交易会员执行当日无负债结算制度;
- (九) 向交易会员收取结算担保金;
- (十) 在结算协议有效期内, 擅自终止为交易会员结算;
- (十一) 违反交易所结算管理规定的其他行为。

上述违规行为同时构成违约的, 依照本办法第十九条第二款的规定处理。

全面结算会员、特别结算会员有本条所列行为的, 对责任人依照本办法第十九条第三款的规定处理。

第二十七条 期货保证金存管银行未履行法定或者约定义务的, 责令改正, 并可以根据情节轻重, 采取谈话提醒、书面警示、通报批评、公开谴责、暂停或者终止交易所期货保证金存管业务等措施。

上述违规行为同时构成违约的, 依照本办法第十九条第二款的规定处理。

第二十八条 会员或者客户具有下列违反风险控制管理规定行为之一的, 责令改正, 并可以根据情节轻重, 采取谈话提醒、书面警示、通报批评、公开谴责、限制开仓、强行平仓、暂停或者限制业务、调整或者取消会员资格等措施:

- (一) 利用分仓等手段, 规避交易所的持仓限额, 超量持仓;
- (二) 未按照交易所规定履行大户报告义务;
- (三) 会员未按照规定采取强行平仓措施;
- (四) 违反风险警示制度有关要求;
- (五) 违反交易所风险控制管理制度的其他行为。

上述违规行为同时构成违约的, 依照本办法第十九条第二款的规定处理。

会员有本条所列行为的, 对责任人依照本办法第十九条第三款的规定处理。

第二十九条 会员、客户、信息服务机构、期货保证金存管银行及期货市场其他参与者具有下列违反信息管理规定行为之一的, 责令改正, 并可以根据情节轻重, 采取谈话提醒、书面警示、通报批评、公开谴责、限制开仓、强行平仓、暂停或者限制业务、调整或者取消会员资格等措施:

- (一) 会员未将交易所发布的即时行情和公告信息等市场信息及时在营业场所公布;
- (二) 未经交易所授权, 擅自发布、传输和传播交易所信息;
- (三) 未经交易所授权, 擅自出售、转让或者转接交易所信息;
- (四) 未经交易所授权, 将交易所信息用于信息经营协议载明用途之外;
- (五) 未经交易所授权, 擅自对交易信息进行增值开发或者未履行约定的增值开发成果备案义务;
- (六) 发现传输或者传播的交易信息内容有错误, 未按照规定处理;
- (七) 违反保密义务, 擅自公开不宜公开的信息;
- (八) 违反交易所信息管理规定的其他行为。

上述违规行为同时构成违约的, 依照本办法第十九条第二款的规定处理。

会员有本条所列行为的, 对责任人依照本办法第十九条第三款的规定处理。

第三十条 会员、客户、期货保证金存管银行、信息服务机构及期货市场其他参与者有下列行为之一的，责令改正，并可以根据情节轻重，采取谈话提醒、书面警示、通报批评、公开谴责、限制开仓、强行平仓、暂停或者限制业务、调整或者取消会员资格等措施：

- （一）拒不配合交易所日常检查、立案调查；
- （二）进行虚假性、误导性或者遗漏重要事实的申报、陈述、解释或者说明；
- （三）提供虚假的文件、资料或者信息。

会员有本条所列行为的，对责任人依照本办法第十九条第三款的规定处理。

第三十一条 被采取市场禁止进入措施的，应当自决定生效之日起20个交易日了结持仓和相关债权债务，在市场禁止进入期限内不得从事本交易所的期货业务。

第三十二条 多种违规行为并存的，分别定性，数罚并用，多次违规的，从重或者加重处理。

会员、客户、期货保证金存管银行、信息服务机构及期货市场其他参与者的违规行为已经受到有关监管机构处罚的，交易所在决定处理时可以免除或者减轻处理。

第三十三条 交易所工作人员违反有关规定的，按照法律、行政法规、规章和交易所内部规章制度处理。

第四章 裁决与执行

第三十四条 交易所对违规行为调查核实后，事实清楚、证据确凿的，依照交易所章程、交易规则及本办法规定予以裁决。

第三十五条 交易所做出裁决，应当制作处理决定书。处理决定书应当包括下列内容：

- （一）当事人的姓名或者名称、住所；
- （二）违规事实和证据；
- （三）处理的种类和依据；
- （四）处理决定的履行方式和期限；
- （五）申请复议的途径和期限；
- （六）做出处理决定的日期。

第三十六条 处理决定书可以通过邮寄、传真、公告等方式送达当事人，并同时分送有关协助执行部门，处理决定书自送达之日起生效。

按照中国证监会的规定需要抄报违规处理情况的，同时抄报中国证监会。

第三十七条 交易所实行复议制度。

当事人对处理决定不服的，可以于处理决定书生效之日起10日内向交易所书面申请复议，复议期间不停止决定的执行。

交易所应当于收到复议申请书之日起30日内做出复议决定，复议决定为终局决定。

第三十八条 处理决定中包括惩罚性违约金的，当事人应当在处理决定书生效之日起5日内将惩罚性违约金如数缴纳至交易所指定的银行账户。逾期不缴纳的，当事人是结算会员的，交易所从结算会员专用资金账户中划付；当事人不是结算会员的，有关结算会员应当协助交易所划拨其在该结算会员处的资金。

对会员工作人员的惩罚性违约金，由会员代缴。

第五章 纠纷调解

第三十九条 会员、客户、期货保证金存管银行及期货市场其他参与者之间发生期货交易纠纷的，可以自行协商解决，也可以提请交易所调解。

第四十条 交易所的调解机构为交易所董事会下设的调解委员会，其常设办事机构设在交易所监查部门。

第四十一条 调解应当在事实清楚、责任明确的基础上依据国家有关期货交易的法律、行政法规、规章和交易所的规则进行。

第四十二条 当事人向调解委员会提出调解申请，应当自其知道或者应当知道其合法权益被侵害之日起30日内提出。

第四十三条 当事人申请调解应当符合下列条件：

- (一) 有调解申请书；
- (二) 有具体的事实、理由和请求；
- (三) 属于调解委员会的受理范围。

第四十四条 当事人向调解委员会申请调解，应当提交书面申请和有关材料。

调解申请书应当写明下列事项：

- (一) 当事人的姓名、性别、年龄、职业、工作单位和住所，或者单位名称、住所和法定代表人或者负责人的姓名、职务；
- (二) 调解的事实、理由和请求；
- (三) 有关证据。

第四十五条 当事人根据有关规定负有举证的责任。调解委员会认为必要时，可以调查收集证据。

第四十六条 调解委员会应当在查明事实，分清是非和当事人自愿的基础上调解，促使当事人相互谅解，达成协议。

第四十七条 经调解达成的协议应当记录在案，并制作调解书，经双方当事人签收后生效。

第四十八条 调解书应当写明下列内容：

- (一) 双方当事人的名称、住所、法定代表人或者负责人的姓名及职务；
- (二) 争议的事项和请求；
- (三) 协议结果。

第四十九条 调解委员会应当在受理调解后30日内结案；到期未结案的，调解委员会应当向当事人说明理由。双方当事人要求继续调解的，调解委员会应当继续调解。一方要求终止调解的，应当终止调解。

第五十条 调解不成的，当事人可以依法提请仲裁机构仲裁或者向人民法院提起诉讼。

第六章 附 则

第五十一条 本办法所称“以上”、“以下”均含本数。

第五十二条 本办法由交易所负责解释。

第五十三条 本办法自2010年2月20日起实施。

中国金融期货交易所交易细则

第一章 总 则

第一条 为规范期货交易行为，保护期货交易当事人的合法权益，保障中国金融期货交易所（以下简称交易所）期货交易的顺利进行，根据《中国金融期货交易所交易规则》，制定本细则。

第二条 交易所、会员、客户应当遵守本细则。

第二章 品种与合约

第三条 交易所上市品种为股票指数以及经中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）批准的其他期货品种。

第四条 股指期货合约主要条款包括合约标的、合约乘数、报价单位、最小变动价位、合约月份、交易时间、每日价格最大波动限制、最低交易保证金、最后交易日、交割日期、交割方式、交易代码、上市交易所等。

第五条 沪深300股指期货合约的合约标的为中证指数有限公司编制和发布的沪深300指数。

第六条 沪深300股指期货合约的合约乘数为每点人民币300元。股指期货合约价值为股指期货指数点乘以合约乘数。

第七条 沪深300股指期货合约以指数点报价。

第八条 沪深300股指期货合约的最小变动价位为0.2指数点，合约交易报价指数点为0.2点的整数倍。

第九条 沪深300股指期货合约的合约月份为当月、下月及随后两个季月。季月是指3月、6月、9月、12月。

第十条 沪深300股指期货合约的最后交易日为合约到期月份的第三个周五，最后交易日即为交割日。最后交易日为国家法定假日或者因异常情况等原因未交易的，以下一交易日为最后交易日和交割日。

到期合约交割日的下一交易日，新的月份合约开始交易。

第十一条 沪深300股指期货合约的交易时间为交易日9：15-11：30（第一节）和13：00-15：15（第二节），最后交易日交易时间为9：15-11：30（第一节）和13：00-15：00（第二节）。

第十二条 沪深300股指期货合约的每日价格最大波动限制是指其每日价格涨跌停板幅度，为上一交易日结算价的±10%。

第十三条 沪深300股指期货合约的最低交易保证金为合约价值的12%。

第十四条 沪深300股指期货合约到期时采用现金交割方式。

第十五条 沪深300股指期货合约的交易单位为“手”，期货交易以交易单位的整

数倍进行。

第三章 席位管理

第十六条 席位是指会员参与交易所期货交易，享有及行使相关交易权利，并接受交易所监管、服务及相关业务管理的基本单位。会员可以根据业务需要向交易所申请一个或者一个以上的席位。

第十七条 会员申请席位，应当具备下列条件：

- （一）经营状况良好，无严重违法违规记录；
- （二）通讯、资金划拨条件符合交易所要求；
- （三）配备符合交易所要求的业务系统及相关专业人员；
- （四）具有健全的规章制度和交易管理办法；
- （五）业务系统的建设和管理符合国家、行业和交易所相关技术管理规范的要求。

第十八条 会员申请席位，应当提交下列材料：

- （一）近两年期货交易基本情况；
- （二）包含申请席位的理由、条件、可行性论证等内容的申请报告；
- （三）机构、人员现状及拟负责交易管理事务的主要人员的名单、简历、专业背景等基本情况；

- （四）交易管理的业务制度（包括数据安全管理制度）；
- （五）计算机系统、通讯系统（包括通讯线路）、系统软件、应用软件等配置清单；
- （六）交易所要求提供的其他材料。

第十九条 交易所在收到符合要求的申请报告和有关材料之日起15个工作日内，对申请报告做出书面批复。

第二十条 会员应当在收到交易所同意其席位申请的批复后5个工作日内，与交易所签订席位使用协议。无故逾期的，视为放弃。

第二十一条 席位使用费按年收取。席位年申报量不超过20万笔的，年使用费为人民币2万元；席位年申报量超过20万笔的，年使用费为人民币3万元。申报量是指买入、卖出以及撤销委托笔数的总和。

席位撤销时，已收取的席位使用费不予退还。

第二十二条 会员交易设施安装和系统调试完成后，达到交易所规定标准且符合开通条件的，方可投入使用。

第二十三条 会员应当加强席位管理和交易业务系统维护，主要设施需要更换或者作技术调整时，应当事先征得交易所同意。席位迁移出原登记备案地，应当事先报交易所审批。交易所所有权对席位的使用情况进行监督检查。

第二十四条 会员有下列情形之一的，席位予以撤销：

- （一）申请撤销席位并经交易所核准；
- （二）私下转包、转租或者转让席位；
- （三）管理混乱、存在严重违规行为或者经查实已不符合开通条件；
- （四）利用席位窃密或者破坏交易所系统；
- （五）会员资格终止；

(六) 交易所认为其不适宜拥有席位。

第二十五条 由于交易系统、通讯系统等交易设施发生故障，致使10%以上的会员不能正常交易的，交易所应当暂停交易，直至故障消除为止。

第四章 价格

第二十六条 交易所应当及时发布开盘价、收盘价、最高价、最低价、最新价、涨跌、最高买价、最低卖价、申买量、申卖量、结算价、成交量、持仓量等与交易有关的信息。

第二十七条 开盘价是指某一期货合约经集合竞价产生的成交价格。集合竞价未产生成交价格的，以集合竞价后第一笔成交价为开盘价。

第二十八条 收盘价是指某一期货合约当日交易的最后一笔成交价格。

第二十九条 最高价是指一定时间内某一期货合约成交价中的最高成交价格。

第三十条 最低价是指一定时间内某一期货合约成交价中的最低成交价格。

第三十一条 最新价是指某一期货合约在当日交易期间的即时成交价格。

第三十二条 涨跌是指某一期货合约在当日交易期间的最新价与上一交易日结算价之差。

第三十三条 最高买价是指某一期货合约当日买方申请买入的即时最高价格。

第三十四条 最低卖价是指某一期货合约当日卖方申请卖出的即时最低价格。

第三十五条 申买量是指某一期货合约当日交易所交易系统中未成交的最高价位申请买入的下单数量。

第三十六条 申卖量是指某一期货合约当日交易所交易系统中未成交的最低价位申请卖出的下单数量。

第三十七条 结算价是指某一期货合约当日一定时间内成交价格按照成交量的加权平均价。结算价是进行当日未平仓合约盈亏结算和计算下一交易日交易价格限制的依据。

第三十八条 成交量是指某一期货合约在当日所有成交合约的单边数量。

第三十九条 持仓量是指期货交易者的持有的未平仓合约的单边数量。

第五章 指令与成交

第四十条 交易指令分为市价指令、限价指令及交易所规定的其他指令。

市价指令是指不限定价格的、按照当时市场上可执行的最优报价成交的指令。市价指令的未成交部分自动撤销。

限价指令是指按照限定价格或者更优价格成交的指令。限价指令在买入时，必须在其限价或者限价以下的价格成交；在卖出时，必须在其限价或者限价以上的价格成交。限价指令当日有效，未成交部分可以撤销。

第四十一条 市价指令只能和限价指令撮合成交，成交价格等于即时最优限价指令的限定价格。

第四十二条 交易指令的报价只能在合约价格限制范围内，超过价格限制范围的报价为无效报价。

交易指令申报经交易所确认后生效。

第四十三条 交易指令每次最小下单数量为1手，市价指令每次最大下单数量为50手，限价指令每次最大下单数量为100手。

第四十四条 会员、客户使用或者会员向客户提供可以通过计算机程序实现自动批量下单或者快速下单等功能的交易软件的，会员应当事先报交易所备案。

会员、客户采取可能影响交易所系统安全或者正常交易秩序的方式下达交易指令的，交易所可以采取相关措施。

第四十五条 股指期货竞价交易采用集合竞价和连续竞价两种方式。集合竞价是指在规定时间内接受的买卖申报一次性集中撮合的竞价方式，连续竞价是指对买卖申报逐笔连续撮合的竞价方式。

第四十六条 集合竞价在交易日9:10-9:15进行，其中9:10-9:14为指令申报时间，9:14-9:15为指令撮合时间。

集合竞价指令申报时间不接受市价指令申报。

集合竞价指令撮合时间不接受指令申报。

第四十七条 期货连续竞价交易按照价格优先、时间优先的原则撮合成交。以涨跌停板价格申报的指令，按照平仓优先、时间优先的原则撮合成交。

第四十八条 集合竞价采用最大成交量原则，即以此价格成交能够得到最大成交量。高于集合竞价产生的价格的买入申报全部成交；低于集合竞价产生的价格的卖出申报全部成交；等于集合竞价产生的价格的买入或者卖出申报，根据买入申报量和卖出申报量的多少，按照少的一方的申报量成交。

第四十九条 开盘集合竞价中的未成交指令自动参与连续竞价交易。

第五十条 限价指令连续竞价交易时，交易所系统将买卖申报指令以价格优先、时间优先的原则进行排序，当买入价大于、等于卖出价则自动撮合成交。撮合成交价等于买入价(bp)、卖出价(sp)和前一成交价(cp)三者中居中的一个价格。即：

当 $bp \geq sp \geq cp$, 则：最新成交价=sp

$bp \geq cp \geq sp$, 最新成交价=cp

$cp \geq bp \geq sp$, 最新成交价=bp

集合竞价未产生成交价的，以上一交易日收盘价为前一成交价，按照上述办法确定第一笔成交价。

第五十一条 新上市合约的挂盘基准价由交易所确定并提前公布。挂盘基准价是确定新合约上市首日涨跌停板幅度的依据。

第六章 交易编码

第五十二条 交易编码是客户、从事自营业务的交易会员进行期货交易的专用代码。交易编码由十二位数字构成，前四位为会员号，后八位为客户号。

第五十三条 客户在不同的会员处开户的，其交易编码中客户号应当相同。交易所另有规定的除外。

第五十四条 符合中国证监会及交易所规定的会员和客户，可以根据从事套期保值交易、套利交易、投机交易等不同目的分别申请客户号。

第五十五条 会员应当对客户开户申请材料的真实性、准确性和完整性进行审核，并根据期货市场客户开户管理的相关规定录入客户资料，办理相关手续。

第五十六条 证券公司、基金公司、合格境外机构投资者等根据法律、行政法规、规章和有关规定需要对资产进行分户管理的特殊法人机构，可以为其分户管理的资产向交易所申请开立交易编码。

第五十七条 特殊法人机构申请开户，应当填写《中国金融期货交易所特殊法人机构交易编码申请表》（见附件），提交相关申请材料，并确保所提供材料内容的真实性、准确性和完整性。

第五十八条 会员应当对特殊法人机构的申请材料进行审核，并与特殊法人机构及其托管人共同到交易所办理相关手续，经交易所审核通过后，为其开立交易编码。

第五十九条 会员、客户申请交易编码，应当根据交易所的规定缴纳相关费用。

第六十条 会员应当建立客户开户档案，并应当自期货经纪合同终止之日起至少保存20年。

第六十一条 存在下列情形之一的，交易所可以注销交易编码：

- （一）客户备案资料不真实；
- （二）客户被认定为市场禁止进入者；
- （三）客户申请注销；
- （四）交易所认定的其他情形。

第六十二条 客户提供虚假的资料或者会员协助客户使用虚假资料开户的，交易所所有权责令会员限期平仓，平仓后注销该客户的交易编码，同时按照《中国金融期货交易所违规违约处理办法》的有关规定进行处理。

第七章 附 则

第六十三条 违反本细则规定的，交易所按照本细则和《中国金融期货交易所违规违约处理办法》的有关规定处理。

第六十四条 本细则由交易所负责解释。

第六十五条 本细则自2010年2月20日起实施。

中国金融期货交易所特殊法人机构交易编码申请表

会员名称							
会员号	中金所		上期所		郑商所		大商所
特殊法人机构交易编码开立申请（申请单位填写）							
特殊法人机构名称							
特殊法人机构英文全称							
法定代表人	姓名				联系电话		
	证件号码				证件类型		
营业执照号码				组织机构代码			
机构性质				注册资本（币种）			
税务登记号				Email			
联系电话				邮政编码			
联系地址							
特殊法人机构类型（资产类型）	<input type="checkbox"/> 证券公司 <input type="checkbox"/> 自营 <input type="checkbox"/> 集合资产管理 <input type="checkbox"/> 定向资产管理 <input type="checkbox"/> 基金公司 <input type="checkbox"/> 封闭式基金 <input type="checkbox"/> 开放式基金（不包括ETF） <input type="checkbox"/> 保本基金 <input type="checkbox"/> ETF <input type="checkbox"/> 特定客户资产管理 <input type="checkbox"/> 合格境外机构投资者 <input type="checkbox"/> 其他						
分户管理资产名称							
期货公司内部资金账号							
申请交易编码目的	<input type="checkbox"/> 套期保值 <input type="checkbox"/> 套利 <input type="checkbox"/> 投机						
交易编码对应名称							
分户管理资产编码					分户管理资产规模		
开户银行					银行账号		
期货结算账户信息							
账户户名	银行账号		开户银行		开户行网点		

分户管理资产对应的现货账户				
业务说明				
前五名持有人				
分户管理资产负责人及联系方式	姓名		联系电话	
	证件类型		证件号码	
开户授权人				
姓名		证件类型		证件号码
联系电话			邮政编码	
联系地址				
指定下单人				
姓名		证件类型		证件号码
联系电话			邮政编码	
联系地址				
资金调拨人				
姓名		证件类型		证件号码
联系地址			邮政编码	
联系地址				
结算单确认人				
姓名		证件类型		证件号码
联系地址			邮政编码	
联系地址				
开户营业部			营业部代码	
<p>本单位有能力承担风险，并保证资金来源的合法性和所提供资料的真实性、准确性和完整性。</p> <p>申请单位盖章： 法定代表人签字： 申请日期： 年 月 日</p>				
托管人信息（无托管人无需填写）				
托管人名称				
组织机构代码证号			机构注册资本(币种)	
营业执照号			税务登记号	
开户银行			银行账号	

联系地址				邮政编码			
联系人	姓名	联系电话	证件号码		证件类型		
法定代表人							
开户授权人							
联系人							
托管人同意开户记录							
审批意见：							
负责人签字：		托管人盖章：		审批日期： 年 月 日			
会员同意开户记录							
审批意见：							
负责人签字：		会员盖章：		审批日期： 年 月 日			
交易所审核备案记录							
分户管理资产的交易编码	中金所		上期所		大商所		郑商所
审核备案意见：							
经办人签字：		负责人签字：		日期： 年 月 日			

第一联：中金所留存 第二联：会员留存 第三联：特殊法人机构留存 第四联：托管人留存

注：中国金融期货交易所简称为“中金所”，上海期货交易所简称为“上期所”，郑州商品交易所简称为“郑商所”，大连商品交易所简称为“大商所”。

中国金融期货交易所结算细则

第一章 总 则

第一条 为规范期货结算行为，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，保障中国金融期货交易所（以下简称交易所）期货结算的正常进行，根据《中国金融期货交易所交易规则》，制定本细则。

第二条 结算业务是指交易所根据交易结果、公布的结算价格和交易所有关规定对交易双方的交易保证金、盈亏、手续费及其他有关款项进行资金清算和划转的业务活动。

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、结算担保金制度和风险准备金制度等。

第四条 交易所实行会员分级结算制度。交易所对结算会员结算，结算会员对其客户、受托交易会员结算，交易会员对其客户结算。

第五条 交易所、会员、客户、期货保证金存管银行应当遵守本细则。

第二章 结算机构

第六条 结算机构是指交易所设置的结算部门和会员的结算部门。交易所结算部门负责交易所期货交易的统一结算、保证金管理、结算担保金管理及结算风险的防范。

第七条 交易所结算部门的主要职责为：

- （一）登录编制结算会员的结算账表；
- （二）办理资金往来汇划业务；
- （三）统计、登记和报告交易结算情况；
- （四）处理会员交易中的账款纠纷；
- （五）办理结算、交割业务；
- （六）管理保证金、结算担保金；
- （七）控制结算风险；
- （八）监督期货保证金存管银行与交易所的期货结算业务；
- （九）法律、行政法规、规章和交易所规定的其他职责。

第八条 在交易所成交的期货合约应当通过交易所结算部门进行统一结算。

第九条 交易所实行会员分级结算制度。交易所结算部门负责交易所与结算会员之间的结算工作。

第十条 会员应当设立结算部门。结算会员的结算部门负责该结算会员与交易所、客户、交易会员之间的结算工作；交易会员的结算部门负责该交易会员与结算会员、客户之间的结算工作。

第十一条 交易所所有权检查会员的结算资料、财务报表及相关的凭证和账册。

第十二条 会员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。

第十三条 结算交割员是指经结算会员授权，代表结算会员办理结算和交割业务的人员。每一结算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，取得交易所颁发的结算交割员培训合格证书，并经所属结算会员授权后取得《中国金融期货交易所结算交割员证》（以下简称《结算交割员证》）。

第十四条 结算交割员应当履行下列职责：

- （一）办理结算会员出入金业务；
- （二）获取交易所提供的结算数据，并及时进行核对；
- （三）办理其他结算、交割业务。

第十五条 结算交割员在交易所办理结算、交割业务时，应当出示《结算交割员证》。

第十六条 《结算交割员证》仅限本人使用，不得伪造、涂改、借用。结算会员在其结算交割员发生变动时，应当及时到交易所办理相关手续。

第十七条 结算会员应当加强结算交割员管理，严格规范结算交割员操作。

第十八条 结算机构及其工作人员应当保守交易所、会员和客户的商业秘密。

第三章 期货保证金存管银行

第十九条 期货保证金存管银行是与交易所签订协议，协助交易所办理期货交易结算业务的银行。

第二十条 期货保证金存管银行享有下列权利：

- （一）开设交易所专用结算账户和会员期货保证金账户；
- （二）存放用于期货交易的保证金等相关款项；
- （三）了解会员在交易所的资信情况；
- （四）法律、行政法规、规章和交易所规定的其他权利。

第二十一条 期货保证金存管银行应当履行下列义务：

- （一）根据交易所提供的票据或者指令优先划转结算会员的资金；
- （二）及时向交易所通报会员在资金结算方面的不良行为和风险；
- （三）保守交易所、会员和客户的商业秘密；
- （四）在交易所出现重大风险时，协助交易所化解风险；
- （五）向交易所提供会员期货保证金账户的资金情况；
- （六）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；
- （七）根据中国证监会或者交易所的要求，对会员期货保证金账户中的资金采取必要的监管措施；
- （八）法律、行政法规、规章和交易所规定的其他义务。

第四章 日常结算

第二十二条 交易所在期货保证金存管银行开设专用结算账户，用于存放结算会员的保证金及相关款项。

第二十三条 结算会员应当在期货保证金存管银行开设期货保证金账户，用于存放保证金及相关款项。

第二十四条 结算会员在交易所所在地的期货保证金存管银行开设的期货保证金账户称为专用资金账户。

交易所与结算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结算会员专用资金账户办理。

第二十五条 结算会员开立、更名、更换或者注销专用资金账户，应当凭交易所签发的专用通知书到期货保证金存管银行办理。

第二十六条 交易所、结算会员应当按照有关规定和期货保证金存管银行签订期货保证金存管协议。

交易所所有权在不通知结算会员的情况下通过期货保证金存管银行从结算会员专用资金账户中收取各项应收款项，并有权随时查询该账户的资金情况。

第二十七条 交易所对结算会员存入交易所专用结算账户的保证金实行分账管理，为每一结算会员设立明细账户，按日序时登记核算结算会员的出入金、盈亏、交易保证金、手续费等。

第二十八条 结算会员对客户、交易会员存入结算会员保证金账户的保证金实行分账管理，为每一客户、交易会员设立明细账户，按日序时登记核算客户、交易会员的出入金、盈亏、交易保证金、手续费等。

第二十九条 交易会员只能委托一家特别结算会员或者全面结算会员为其进行结算。

第三十条 交易所实行结算担保金制度。结算担保金是指由结算会员依交易所规定缴纳的，用于应对结算会员违约风险的共同担保资金。

第三十一条 交易所在银行开立结算担保金专用账户，对结算会员缴纳的结算担保金进行专户管理。

结算会员应当在交易所指定的银行开立结算担保金专用账户，用于与交易所结算担保金专用账户之间进行结算担保金缴纳、调整的资金划转。结算担保金缴纳、调整的标准按照《中国金融期货交易所风险控制管理办法》及其他相关规定执行。

第三十二条 交易所在结算担保金专用账户下为每一结算会员设立明细账户，并按照中国证监会和交易所有关规定进行管理，所得收入在扣除必要费用和税费后依照相关规定返还结算会员。交易所按照季度核算每一结算会员的结算担保金变化。

第三十三条 结算会员开立、更名、更换或者注销结算担保金专用账户，应当凭交易所签发的专用通知书到指定银行办理。

第三十四条 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。

第三十五条 结算准备金是指结算会员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。

第三十六条 结算会员的结算准备金最低余额标准为人民币200万元，应当以自有资金缴纳。交易所所有权根据市场情况调整结算会员结算准备金最低余额标准。

第三十七条 交易所根据结算会员每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，在每年的3月下旬、6月下旬、

9月下旬、12月下旬将利息转为结算会员结算准备金。具体执行利率由交易所确定、调整并公布。

第三十八条 交易保证金是指结算会员存入交易所专用结算账户中确保履约的资金，是已被合约占用的保证金。买卖成交后，交易所根据交易保证金标准和持仓合约价值向双方收取交易保证金。

第三十九条 交易保证金的收取标准按照《中国金融期货交易所风险控制管理办法》的有关规定执行。

第四十条 结算会员向客户、交易会员收取交易保证金的标准不得低于交易所向结算会员收取交易保证金的标准。交易会员向客户收取交易保证金的标准不得低于结算会员向交易会员收取交易保证金的标准。

第四十一条 交易所实行当日无负债结算制度。

当日收市后，交易所按照当日结算价对结算会员所有合约的盈亏、交易保证金及手续费、税金等费用进行清算，对应收应付的款项实行净额一次划转，相应增加或者减少结算准备金。

结算会员在交易所结算完成后，按照前款原则对客户、交易会员进行结算；交易会员按照前款原则对客户进行结算。

第四十二条 交易所根据当日成交合约按照规定标准向结算会员收取手续费。股指期货的手续费标准为不高于成交金额的万分之零点五。

交易所所有权对手续费标准进行调整。

第四十三条 当日结算价是指某一期货合约最后一小时成交价格按照成交量的加权平均价。计算结果保留至小数点后一位。

最后一小时因系统故障等原因导致交易中断的，扣除中断时间后向前取满一小时视为最后一小时。

合约最后一小时无成交的，以前一小时成交价格按照成交量的加权平均价作为当日结算价。该时段仍无成交的，则再往前推一小时。以此类推。合约当日最后一笔成交距开盘时间不足一小时的，则取全天成交量的加权平均价作为当日结算价。

合约当日无成交的，当日结算价计算公式为：当日结算价=该合约上一交易日结算价+基准合约当日结算价-基准合约上一交易日结算价，其中，基准合约为当日有成交的离交割月最近的合约。合约为新上市合约的，取其挂盘基准价为上一交易日结算价。基准合约为当日交割合约的，取其交割结算价为基准合约当日结算价。根据本公式计算出的当日结算价超出合约涨跌停板价格的，取涨跌停板价格作为当日结算价。

采用上述方法仍无法确定当日结算价或者计算出的结算价明显不合理的，交易所所有权决定当日结算价。

第四十四条 期货合约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=Σ[(卖出成交价-当日结算价)×卖出量×合约乘数]+Σ[(当日结算价-买入成交价)×买入量×合约乘数]+(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)×合约乘数

第四十五条 当日盈亏在当日结算时进行划转，盈利划入结算会员结算准备金，亏

损从结算会员结算准备金中扣划。

当日结算时，结算会员账户中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结算准备金中扣划，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结算准备金。

手续费、税金等各项费用从结算准备金中扣划。

第四十六条 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+当日盈亏+入金-出金-手续费等。

第四十七条 结算完毕后，结算会员的结算准备金余额低于最低余额标准时，该结算结果即视为交易所向结算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，可以通过期货保证金存管银行从结算会员专用资金账户中扣划。若未能全额扣款成功，结算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。未能补足的，如结算准备金余额小于结算准备金最低余额，不得开仓；如结算准备金余额小于零，按照《中国金融期货交易所风险控制管理办法》的规定进行处理。

第四十八条 交易所可以根据市场风险状况，在交易过程中向风险较大的结算会员发出追加保证金的通知，并可以通过期货保证金存管银行从结算会员专用资金账户中扣划。若未能全额扣款成功，结算会员应当按照交易所的要求在规定时间内补足保证金。结算会员未能按时补足的，交易所所有权对其采取限制开仓、强行平仓等风险控制措施。

第四十九条 交易所本着安全、准确、快捷的原则为结算会员办理出入金业务。

入金是指从结算会员专用资金账户向交易所专用结算账户划入资金的行为；出金是指从交易所专用结算账户向结算会员专用资金账户划出资金的行为。

（一）入金

1. 票据支付。结算会员可以用专用资金账户开出的支票、本票和贷记凭证入金。结算会员用此类方式划入的资金，经期货保证金存管银行确认到账后，交易所将增加结算会员在交易所内的结算准备金。

2. 银行扣划。结算会员可以在每个交易日交易结束之前向交易所提出书面或者电子划款申请，经期货保证金存管银行确认到账后，交易所将增加结算会员在交易所内的结算准备金。

（二）出金

结算会员可以在每日收市之前向交易所提出书面或者电子划款申请，经交易所审核后通知期货保证金存管银行于当日收市后在结算会员的专用资金账户和交易所专用结算账户之间进行划转。

第五十条 结算会员出金应当符合交易所规定。结算会员的出金标准为：

可出金额=实有货币资金-交易保证金-结算准备金最低余额

交易所可以根据市场风险状况对结算会员出金标准做适当调整。

第五十一条 有下列情形之一的，交易所可以限制结算会员出金：

（一）会员或者客户涉嫌重大违规，被交易所立案调查的；

- (二) 会员或者客户被司法机关或者其他有关部门立案调查,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形。

第五十二条 当日结算完成后, 结算会员应当通过交易所系统获得相关的结算数据。

第五十三条 因特殊情况造成交易所不能按时提供结算数据的, 交易所另行通知提供结算数据的时间和方式。

第五十四条 结算会员每天应当及时取得交易所提供的结算数据, 做好核对工作, 并妥善保存。

第五十五条 结算会员对结算数据有异议的, 应当在不迟于下一交易日开市前30分钟以书面形式通知交易所。情况特殊的, 结算会员可以在下一交易日开市后2小时内以书面形式通知交易所。

结算会员未在前款规定时间内对结算数据提出书面异议的, 视为认可结算数据的正确性。

第五十六条 交易所在每月的第一个交易日向结算会员提供上月的《中国金融期货交易所资金结算核对单》, 在每季的第一个交易日向结算会员提供上季的《中国金融期货交易所结算担保金核对单》, 作为结算会员核查的依据。

第五章 结算关系变更

第五十七条 出现下列情形之一的, 交易所可以为相关会员办理结算关系变更手续:

- (一) 结算协议期满后结算会员与交易会员不再续约;
- (二) 结算会员与交易会员提前解除结算协议;
- (三) 全面结算会员或者特别结算会员因故不能为交易会员进行结算;
- (四) 交易会员变更为结算会员或者结算会员变更为交易会员;
- (五) 交易所认定的其他情形。

第五十八条 发生第五十七条第(一)项情形的, 交易会员和移入结算会员应当在不迟于交易会员和移出结算会员的结算协议期满前30日向交易所提交下列材料:

- (一) 《交易会员更换结算会员申请书》;
- (二) 交易会员和移入结算会员签订的结算协议;
- (三) 交易所规定的其他材料。

发生第五十七条第(二)、(三)项情形的, 交易会员和移入结算会员除提交前款规定材料外, 还应当提交交易会员与移出结算会员结算协议的解除协议。

发生第五十七条第(四)项情形的, 会员应当按照《中国金融期货交易所会员管理办法》的相关规定办理会员资格变更手续, 并提交结算关系变更申请。

第五十九条 交易所对会员提交的申请材料进行审批。交易所批准后, 通知相关会员变更结算关系的约定日期。

第六十条 交易所在约定日结算后为相关会员办理结算关系变更, 对持仓及相应的交易保证金进行移转, 并向相关会员提供移转清单, 会员应当对移转清单进行核对确

认。

在约定日结算后，市场出现重大风险或者交易所认定的其他情形的，交易所可以暂停办理结算关系变更手续。

第六十一条 在交易所办理结算关系变更手续期间，交易会员和结算会员应当相互配合。在办理完毕之前，移出结算会员对其代为结算的持仓负有履约义务。

第六十二条 交易所按照移转持仓的数量收取变更手续费。手续费标准为人民币10元/手，从移入结算会员的结算准备金中扣划。交易所所有权对手续费标准进行调整。

第六章 客户移仓

第六十三条 会员因故不能从事金融期货经纪业务或者中国证监会要求移仓时，由会员提出移仓申请并经交易所批准，交易所可以对该会员客户的持仓及相应的交易保证金进行移仓。

第六十四条 会员提交的移仓申请材料应当包括移出会员及其客户、移入会员同意移仓的声明书及需要移转的客户持仓的详细清单。移入会员或者移出会员为交易会员的，还应当提交其委托结算的结算会员同意移仓的声明书。

第六十五条 移仓申请批准后，交易所通知会员移仓的约定日期。

第六十六条 交易所在约定日结算后，为会员实施客户移仓，并向相关会员提供移转清单，会员应当对移转清单进行核对确认。移入会员或者移出会员为交易会员的，还应当将移转清单提交其委托结算的结算会员确认。

第六十七条 在约定日结算后，市场出现重大风险或者交易所认定的其他情形的，交易所可以暂停办理客户移仓手续。

第七章 交割结算

第六十八条 股指期货合约采用现金交割方式。

股指期货合约最后交易日收市后，交易所以交割结算价为基准，划付持仓双方的盈亏，了结所有未平仓合约。

第六十九条 股指期货交割结算价为最后交易日标的指数最后2小时的算术平均价。计算结果保留至小数点后两位。

交易所所有权根据市场情况对股指期货的交割结算价进行调整。

第七十条 股指期货的交割手续费标准为交割金额的万分之一，由交易所向结算会员收取，交易所所有权对交割手续费标准进行调整。

第八章 风险与责任

第七十一条 风险管理实行分级负责。交易所对结算会员进行风险管理，结算会员对其客户、受托交易会员进行风险管理，交易会员对其客户进行风险管理。

第七十二条 结算会员对其客户及受托交易会员在交易所成交的合约负有履约责任。

第七十三条 结算会员无法履约时，交易所所有权按照规定依次采取下列保障措施：

（一）暂停开仓；

- (二) 强行平仓，并用平仓后释放的保证金履约赔偿；
- (三) 动用该违约结算会员缴纳的结算担保金；
- (四) 动用其他结算会员缴纳的结算担保金；
- (五) 动用交易所风险准备金；
- (六) 动用交易所自有资金。

交易所代为履约后，取得对违约会员的相应追偿权。

第七十四条 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亏损的资金。

第七十五条 风险准备金的来源：

- (一) 交易所按照手续费收入的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。

当风险准备金达到一定规模时，经中国证监会批准后可以不再提取。

第七十六条 风险准备金应当单独核算，专户存储。

第七十七条 风险准备金的动用应当经交易所董事会批准，并报告中国证监会后，按照规定的用途和程序进行。

第九章 附 则

第七十八条 违反本细则规定的，交易所按照本细则和《中国金融期货交易所违规违约处理办法》的有关规定处理。

第七十九条 本细则由交易所负责解释。

第八十条 本细则自2010年2月20日起实施。

中国金融期货交易所结算会员结算业务细则

第一章 总 则

第一条 为规范结算会员的期货结算行为，加强对结算会员结算业务的监督管理，根据《期货公司金融期货结算业务试行办法》和《中国金融期货交易所交易规则》，制定本细则。

第二条 本细则所称结算会员结算业务是指中国金融期货交易所（以下简称交易所）特别结算会员、全面结算会员对其受托交易会员办理的期货结算业务。

第三条 结算会员、交易会员应当遵守本细则。

第二章 结算关系的确立与变更

第四条 交易会员应当委托结算会员为其进行结算，且只能委托一家结算会员为其进行结算。

第五条 结算会员受托为交易会员结算，应当签订结算协议，并报交易所备案。

第六条 结算会员与交易会员签订结算协议，应当遵守法律、行政法规、规章和交易所的规定，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）交易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）手续费标准；

- (七) 通知事项、方式及时限;
- (八) 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;
- (九) 协议变更和解除;
- (十) 违约责任;
- (十一) 争议处理方式;
- (十二) 双方约定的且不违反法律、行政法规、规章规定的其他事项。

第七条 结算会员与交易会员签订结算协议, 发生下列情形之一的, 应当于5个交易日日内报交易所备案:

- (一) 修改结算协议条款;
- (二) 解除结算协议;
- (三) 交易所规定的其他情形。

第八条 交易会员和结算会员变更结算关系, 应当根据《中国金融期货交易所结算细则》及相关规定办理手续, 相关会员应当相互配合。

第三章 交易

第九条 交易会员为其客户申请、注销交易编码, 应当按照有关规定办理, 并及时告知结算会员。

第十条 交易会员下达的交易指令应当通过结算会员的审查或者验证后进入交易所。

结算会员可以按照结算协议的约定对交易会员的指令采取必要的限制措施。

第十一条 结算会员传递交易会员的交易指令, 应当遵守时间优先的原则。

第十二条 交易会员下达的交易指令进入交易所后, 结算会员应当及时将从交易所取得的委托回报和成交结果反馈给交易会员。

第十三条 交易会员对委托回报和成交结果有异议的, 应当在当日及时向结算会员、交易所提出。

第十四条 客户申请套期保值额度的, 应当向其开户的交易会员申报, 交易会员对申报材料进行审核后向交易所办理申请手续。

交易所对客户的套期保值申请材料进行审核, 确定其套期保值额度后, 应当及时将套期保值额度告知结算会员和交易会员。

第十五条 交易会员申请套期保值额度的, 直接向交易所办理申请手续。

交易所对交易会员的套期保值申请材料进行审核, 确定其套期保值额度后, 应当及时将套期保值额度告知结算会员和交易会员。

第四章 结算

第十六条 特别结算会员应当在期货保证金存管银行开设期货保证金账户, 用于存放交易会员的保证金及相关款项。

全面结算会员应当在期货保证金存管银行开设期货保证金账户, 用于存放其客户和交易会员的保证金及相关款项。

交易会员是期货公司的，应当在期货保证金存管银行开设期货保证金账户，用于存放其客户的保证金及相关款项。

交易会员不是期货公司的，应当在期货保证金存管银行开设期货结算账户，用于存放其保证金及相关款项。

第十七条 结算会员向交易会员收取的保证金归交易会员所有。除用于交易会员的期货交易外，任何机构或者个人不得占用、挪用。

交易会员向客户收取的保证金归客户所有。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。

第十八条 交易会员是期货公司的，其与结算会员的期货业务资金往来，只能通过各自的期货保证金账户办理。

交易会员不是期货公司的，其与结算会员的期货业务资金往来，通过交易会员的期货结算账户和结算会员的期货保证金账户办理。

第十九条 结算会员应当对交易会员存入结算会员期货保证金账户的保证金实行分账管理，为每一交易会员设立明细账户，按日序时登记核算每一交易会员的出入金、盈亏、交易保证金、手续费等。

第二十条 结算会员为交易会员结算应当根据交易保证金标准和持仓合约价值收取交易保证金，且交易保证金标准不得低于交易所对结算会员的收取标准。

第二十一条 结算会员和交易会员应当在结算协议中约定交易会员结算准备金最低余额。结算准备金最低余额不得低于人民币50万元，交易会员应当以自有资金缴纳。

第二十二条 结算会员为交易会员结算的，应当建立并执行当日无负债结算制度。当日收市后，结算会员应当根据交易所公布的当日结算价，按照交易所的计算方法计算交易会员所有合约的盈亏，同时计算交易保证金及手续费、税金等费用。

当日盈利划入交易会员结算准备金，当日亏损从交易会员结算准备金中扣划。

交易会员账户中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结算准备金中扣划，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结算准备金。

手续费、税金等费用从交易会员的结算准备金中扣划。

第二十三条 结算会员应当按照结算协议的约定，为交易会员办理出入金，无正当理由不得拖延。

第二十四条 结算会员应当与交易会员约定结算数据收取、查询和确认的时间和方式。结算会员应当本着安全、准确、及时的原则为交易会员发送结算数据。

结算会员对交易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交易所保持一致。

第二十五条 交易会员对结算会员发送的结算数据有异议的，应当以书面形式在结算协议约定的时间内提出；交易会员对结算数据无异议的，应当按照结算协议约定的方式确认。

交易会员在结算协议约定的时间内既未对结算数据的内容确认，也未提出异议的，视为对结算数据内容的确认。

交易会员有异议的，结算会员应当在结算协议约定的时间内予以核实。

第五章 风险管理

第二十六条 结算会员对其客户和受托交易会员进行风险管理，交易会员对其客户进行风险管理。

第二十七条 结算会员应当依照中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）和交易所的规定建立对其客户和受托交易会员的保证金管理制度。

第二十八条 结算会员可以根据交易会员的资信及市场情况调整保证金标准。

第二十九条 结算会员调整受托交易会员的交易保证金标准的，应当在当日结算时对交易会员相关合约的所有持仓按照调整后的交易保证金标准进行结算。交易会员保证金不足的，应当在下一个交易日开市前追加到位。

第三十条 交易所开市前，交易会员结算准备金余额小于规定或者约定最低余额的，结算会员应当禁止其开仓。

第三十一条 结算会员不得向交易会员收取结算担保金。

第三十二条 全面结算会员的持仓达到或者超过交易所持仓限额的，其客户、受托交易会员均不得同方向开仓交易；特别结算会员的持仓达到或者超过交易所持仓限额的，其受托交易会员不得同方向开仓交易。

第三十三条 结算会员应当建立并执行对交易会员的强行平仓制度。

第三十四条 交易会员的结算准备金余额低于约定标准的，应当及时追加保证金或者自行平仓。交易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，结算会员有权对该交易会员的持仓执行强行平仓。

第三十五条 交易会员的结算准备金余额小于零且未能在结算协议约定时间内补足的，结算会员应当按照结算协议的约定对交易会员或者其客户的持仓采取强行平仓措施。

除前款规定外，结算会员可以与交易会员在结算协议中约定应当予以强行平仓的其他情形。

第三十六条 结算会员和交易会员在结算协议中应当约定强行平仓的执行原则。强行平仓可以参照交易所的执行原则，也可以采取其他原则。

第三十七条 结算会员对交易会员采取强行平仓措施的，强行平仓发生的费用、损失以及因市场原因无法强行平仓造成的损失扩大部分均由交易会员承担。

交易会员承担损失后，有权向有责任的客户追偿。

第三十八条 交易会员在期货交易中违约的，应当承担违约责任。

结算会员应当先以该交易会员的保证金承担其违约责任；保证金不足的，结算会员应当以风险准备金和自有资金代为承担违约责任，并由此取得对该交易会员的相应追偿权。

第三十九条 结算会员认为必要的，可以对交易会员进行风险提示。

第六章 监督管理

第四十条 结算会员、交易会员及其从业人员应当遵守有关法律、行政法规、规章和交易所交易规则及其实施细则等规定，接受中国证监会和交易所的监督和管理。

第四十一条 结算会员应当谨慎、勤勉地办理期货结算业务，控制结算业务风险；建立结算业务风险隔离机制，公平对待结算会员的客户、交易会员及其客户，防范利益冲突，保守交易会员的商业秘密，不得利用结算业务关系及因此获得的信息损害交易会员及其客户的合法权益。

第四十二条 交易会员应当谨慎、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结算会员及其客户的合法权益。

第四十三条 结算会员应当将自有资金与受托结算的交易会员保证金分账管理，交易会员保证金应当专户存储，严禁挪用。

第四十四条 结算会员不得将收取的交易会员保证金用于自身经营活动或者清偿自身债务；不得允许他人使用交易会员保证金或者用交易会员保证金为他人经营活动提供担保。

第四十五条 结算会员、交易会员应当维护交易所的声誉，协助交易所处理各种突发或者异常事件。出现突发或者异常事件时，结算会员应当做好交易会员和客户的解释工作。

第四十六条 结算会员应当督促交易会员遵守期货交易相关法律、行政法规、规章及交易所规则，加强交易会员交易行为的合法合规性管理。

第七章 附 则

第四十七条 违反本细则规定的，交易所按照本细则和《中国金融期货交易所违规违约处理办法》的有关规定处理。

第四十八条 本细则由交易所负责解释。

第四十九条 本细则自2010年2月20日起实施。

中国金融期货交易所会员管理办法

第一章 总 则

第一条 为加强会员管理，保护会员的合法权益，规范会员在中国金融期货交易所（以下简称交易所）的业务活动，根据《中国金融期货交易所交易规则》，制定本办法。

第二条 会员是指根据有关法律、行政法规和规章的规定，经交易所批准，有权在交易所从事交易或者结算业务的企业法人或者其他经济组织。

第三条 交易所的会员分为交易结算会员、全面结算会员、特别结算会员和交易会员。

第四条 会员从事交易所业务活动，应当遵守法律、行政法规、规章和交易所交易规则及其实施细则，诚实守信，规范运作，接受交易所自律管理。

第五条 会员的董事、监事、高级管理人员以及从业人员应当遵守法律、行政法规、规章和交易所交易规则及其实施细则，忠实、勤勉履行职责，接受交易所自律管理。

第二章 交易会员

第六条 交易会员可以从事经纪或者自营业务，不具有与交易所进行结算的资格。

第七条 申请交易所交易会员资格，应当符合下列条件：

- （一）为在中华人民共和国境内登记注册的企业法人或者其他经济组织；

- (二) 承认并遵守交易所交易规则及其实施细则;
- (三) 具有良好的信誉和经营历史,近3年无不良经营记录、严重违法违规行为记录或者被期货交易所、证券交易所取消会员资格的记录;
- (四) 具有健全的组织机构、财务管理制度及完善的期货业务管理制度、内部控制制度和风险管理制度;
- (五) 具备满足开展业务需要的期货从业人员;
- (六) 具有满足开展业务所需要的设备、场地;
- (七) 符合中国证券监督管理委员会(以下简称中国证监会)期货保证金安全存管监控的有关规定;
- (八) 期货业务系统符合交易所的相关规定;
- (九) 交易所规定的其他条件。

第八条 期货公司申请交易会员资格,应当符合本办法第七条规定的条件,取得金融期货经纪业务资格并且最近一次的期货公司分类评价结果达到C类以上(含C类)。

第九条 非期货公司申请交易会员资格,应当为依法核准登记的金融机构,并符合本办法第七条和相关主管部门的规定。

第十条 申请交易会员资格,应当向交易所提交下列文件:

- (一) 经法定代表人签字的交易会员资格申请书;
- (二) 会员入会登记表;
- (三) 与结算会员签订的结算协议;
- (四) 期货公司申请交易会员资格的,应当提供加盖公章的中国证监会核发的金融期货经纪业务资格许可证明文件复印件;
- (五) 加盖公章的营业执照复印件;
- (六) 加盖公章的组织机构代码证复印件;
- (七) 公司章程、主要股东名册及其持股比例;
- (八) 住所(经营场所)使用证明;
- (九) 《会员期货业务系统检查表》及相关文档;
- (十) 公司风险管理制度、内部控制制度、业务流程及相关业务制度等;
- (十一) 从事经纪业务的,申请日前2个月月末的期货公司风险监管报表以及公司保证其申请日前2个月风险监管指标持续符合规定标准的书面说明;
- (十二) 《高级管理人员情况表》、《人员配置情况表》、《业务代表申请表》和《业务联络员申请表》;
- (十三) 经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计的最近1年的财务报告;
- (十四) 交易所要求提供的其他文件或者材料。

第十一条 交易所在收到符合要求的申请材料之日起30个工作日内提出审核意见,通知符合条件的申请单位办理相关手续。

第十二条 申请单位应当在交易所发出会员资格批准通知之日起30个工作日内,与交易所签署《中国金融期货交易所交易会员协议》,并办理相关手续。逾期未办理的,视为放弃申请会员资格。

第十三条 申请单位办理完毕相关手续后，即取得交易会员资格，交易所制发会员证书，并报告中国证监会。

第三章 结算会员

第十四条 结算会员可以从事结算业务，具有与交易所进行结算的资格。结算会员按照业务范围分为交易结算会员、全面结算会员和特别结算会员。

交易结算会员只能为其受托客户办理结算、交割业务。

全面结算会员既可以为其受托客户也可以为与其签订结算协议的交易会员办理结算、交割业务。

特别结算会员只能为与其签订结算协议的交易会员办理结算、交割业务。

第十五条 申请交易结算会员资格，应当符合本办法第七条规定的条件，取得金融期货结算业务资格并且最近一次的期货公司分类评价结果达到B类以上（含B类）。

申请全面结算会员资格，应当符合本办法第七条规定的条件，取得金融期货结算业务资格并且最近两次的期货公司分类评价结果均达到A类。

第十六条 申请交易结算会员和全面结算会员资格的，应当向交易所提交下列文件：

- （一）本办法第十条第（二）项、第（五）项至第（十二）项规定的文件；
- （二）经法定代表人签字的结算会员资格申请书；
- （三）加盖公章的中国证监会核发的金融期货结算业务资格许可证明文件复印件；
- （四）经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计的申请日前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当年上半年度财务报告；
- （五）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的最近一期的财务报告；
- （六）交易所要求提供的其他文件或者材料。

申请特别结算会员资格的，应当向交易所提交前款第（一）项至第（三）项及第（六）项规定的文件。

第十七条 交易所在收到符合要求的申请材料之日起30个工作日内提出审核意见，通知符合条件的申请单位办理相关手续。

第十八条 申请单位应当在交易所发出会员资格批准通知之日起30个工作日内，办理下列事项：

- （一）签署《中国金融期货交易所结算会员协议》；
- （二）按照交易所规定开设专用资金账户和结算担保金专用账户；
- （三）缴纳结算担保金；
- （四）办理有关人员的授权手续；
- （五）交易所规定应当办理的其他事项。

逾期未办理的，视为放弃申请会员资格。

第十九条 申请单位办理完毕相关手续后，即取得结算会员资格，交易所制发会员证书，并报告中国证监会。

第四章 会员资格的变更和终止

第二十条 会员不得转让其会员资格，但可以申请变更或者终止会员资格。交易所在会员资格发生变化后，报告中国证监会。

第二十一条 会员资格的变更是指交易会员、交易结算会员或者全面结算会员资格之间的转换。

第二十二条 会员申请变更会员资格，应当符合本办法规定的条件，并向交易所提交经法定代表人签字的变更会员资格申请书及本办法规定的其他材料。

第二十三条 交易所在收到符合要求的申请材料之日起 30 个工作日内提出审核意见，通知符合条件的申请单位办理相关手续。

会员应当在交易所发出批准变更通知之日起 30 个工作日内，办理下列事项：

（一）结算会员申请变更为交易会员，按照本办法第十二条的有关规定办理手续；结清与交易所的全部债权和债务；退还交易所颁发的各种证件；办理专用资金账户和结算担保金专用账户的销户手续；交易所规定应当办理的其他事项。

（二）交易会员申请变更为结算会员，应当按照本办法第十八条的有关规定办理手续。

（三）交易结算会员和全面结算会员之间资格变更的，按照变更后的结算会员结算担保金标准缴纳结算担保金。

会员资格变更涉及结算关系变更的，应当根据《中国金融期货交易所结算细则》办理相关手续。

逾期未办理的，视为放弃申请。

第二十四条 会员不再符合交易所规定的会员资格条件或者中国证监会规定的，应当按照交易所要求申请变更或者终止会员资格。

第二十五条 会员申请终止会员资格，应当向交易所提交经法定代表人签字的终止会员资格申请书及交易所要求的其他材料。

第二十六条 交易所在收到符合要求的申请材料之日起 30 个工作日内提出审核意见，通知符合条件的申请单位办理相关手续。

会员应当在交易所发出终止会员资格通知之日起 30 个工作日内，办理下列事项：

- （一）了结合约持仓；
- （二）结清与交易所的全部债权、债务；
- （三）退还交易所颁发的各种证件；
- （四）办理专用资金账户的销户手续；
- （五）办理结算担保金专用账户的销户手续；
- （六）交易所规定应当办理的其他事项。

第二十七条 交易所同意终止会员资格的，注销其会员资格，报告中国证监会，并予以公布。

会员未按照本办法第二十四条的规定申请变更或者终止会员资格的，交易所可以决定调整或者取消其会员资格，并书面通知该会员。

会员资格证书自注销之日起失效。

第二十八条 会员存在下列情形之一的，交易所可以不受理其变更或者终止会员资格的申请：

- (一) 因经济纠纷、违法或者犯罪受到国家有关部门立案调查、处理；
- (二) 因涉嫌违规，被交易所立案调查；
- (三) 因违法、违规被交易所采取通报批评、暂停期货交易、结算业务等措施，且未滿 3 个月；
- (四) 与交易所存在债务纠纷且尚未结清；
- (五) 交易所规定的其他情形。

第五章 会员联系人

第二十九条 交易所建立会员联系人制度。会员应当设业务代表一名，代表会员组织、协调会员与交易所的各项业务往来。

业务代表由会员高级管理人员担任。

会员应当为业务代表履行职责提供便利条件，会员董事、监事、高级管理人员及相关人员应当配合业务代表的工作。

第三十条 会员应当设业务联络员若干名，业务联络员根据会员授权协助业务代表履行职责。

第三十一条 会员推荐业务代表，应当向交易所提交下列文件：

- (一) 会员推荐文件；
- (二) 高级管理人员任职证明文件；
- (三) 拟推荐人员的联络方式；
- (四) 拟推荐人员的期货从业人员资格证书。

会员推荐业务联络员，应当提交前款第（一）、第（三）项和第（四）项文件。

第三十二条 交易所在收到符合要求的申请材料之日起 5 个工作日内，提出审核意见。

第三十三条 业务代表应当履行下列职责：

- (一) 组织办理交易、结算与交割等相关业务；
- (二) 办理交易所会员资格、席位等相关业务；
- (三) 报送交易所要求的公司文件；
- (四) 组织会员相关业务人员参加交易所举办的培训；
- (五) 组织与交易所业务相关的内部培训；
- (六) 配合交易所对交易及相关系统进行改造、测试；
- (七) 每日登录交易所系统，及时接收交易所发送的通知以及业务文件等，并予以协调落实；
- (八) 及时将会员变更总部、分支机构的相关资料及其他信息告知交易所；
- (九) 督促会员及时履行报告义务；
- (十) 督促会员及时缴纳各项费用；
- (十一) 协调、组织业务联络员的工作；
- (十二) 交易所要求履行的其他职责。

第三十四条 业务代表或者业务联络员出现下列情形之一的，会员应当立即予以更

换并书面报告交易所：

- （一）业务代表或者业务联络员离职离岗；
- （二）业务代表不再担任高级管理人员职务；
- （三）不能按照交易所要求履行职责；
- （四）履行职责时出现重大错误，产生严重后果；
- （五）交易所认为不适宜继续担任业务代表或者业务联络员的其他情形。

会员对存在前款规定情形的业务代表或者业务联络员不予更换的，交易所可以要求更换。

第三十五条 会员向交易所申请更换业务代表或者业务联络员，应当提交更换申请书及本办法第三十一条所规定的文件。

第三十六条 业务代表空缺期间，会员法定代表人应当履行业务代表职责，直至会员推荐新的业务代表并经交易所审核通过。

第六章 会员报告

第三十七条 会员向交易所报送的信息和资料应当真实、准确、完整。

第三十八条 会员应当向交易所履行下列定期报告义务：

- （一）每月前 7 个工作日内报送上月统计报表及风险控制指标监管报表；
- （二）每年 4 月 30 日前报送上年度经审计的财务报告和交易所要求的年度报告材料；

（三）交易所规定的其他报告义务。

第三十九条 会员有下列情形之一的，应当在 10 个工作日内向交易所书面报告：

- （一）法定代表人变更；
- （二）注册资本总额或者股权结构变更；
- （三）名称、住所、经营范围或者联系方式变更；
- （四）高级管理人员变更；
- （五）净资产等风险控制指标不符合中国证监会规定标准；
- （六）合并、分立、设立或者撤销分支机构；
- （七）发生重大诉讼案件或者经济纠纷；
- （八）取得其他交易所会员资格；
- （九）因涉嫌违法、违规受到有权机关调查、采取监管措施或者受到刑事、行政、自律处罚；
- （十）改聘会计师事务所；
- （十一）股东大会或者股东会、董事会决议被依法撤销或者宣告无效；
- （十二）交易所规定的其他情形。

第四十条 会员发生下列情形之一的，应当立即向交易所报告，并持续报告进展情况：

- （一）重大业务风险；
- （二）重大技术故障；
- （三）不可抗力或者意外事件可能影响客户正常交易；

(四) 交易所规定应当报告的其他情形。

第四十一条 交易所可以根据审慎管理原则,要求会员对期货交易、内部控制、风险管理和技术系统运行等情况进行自查,并提交专项自查报告。

第七章 监督管理

第四十二条 交易所在会员监管过程中,对存在或者可能存在问题的会员,可以根据需要采取下列措施:

- (一) 口头警示;
- (二) 书面警示;
- (三) 约见谈话;
- (四) 限期说明情况;
- (五) 责令改正;
- (六) 责令参加培训;
- (七) 责令定期报告;
- (八) 责令加强内部合规检查;
- (九) 专项调查;
- (十) 责令处分有关人员;
- (十一) 限制或者暂停相关业务;
- (十二) 提请中国证监会或者其派出机构处理。

第四十三条 会员有下列情形之一的,交易所有限制、暂停其业务或者调整、取消其会员资格:

- (一) 国家主管机关撤销其工商登记或者予以解散;
- (二) 国家主管机关撤销其业务许可;
- (三) 法院裁定其宣告破产;
- (四) 交易所要求其限期整改而未能按期完成;
- (五) 交易所规定的其他情形。

第四十四条 会员不得接受下列单位和个人的委托为其进行期货交易:

- (一) 国家机关和事业单位;
- (二) 中国证监会、期货交易所、中国期货保证金监控中心、中国期货业协会和期货公司的工作人员及其配偶;
- (三) 证券、期货市场禁止进入者;
- (四) 未能提供开户证明材料的单位和个人;
- (五) 无民事行为能力人或者限制民事行为能力人;
- (六) 中国证监会及交易所规定的不得从事期货交易的其他单位或者个人。

第四十五条 会员应当妥善保管客户档案、业务记录、财务报表及相关凭证、账册,以备查询和核实。

开户、变更、销户的客户资料档案应当自期货经纪合同终止之日起至少保存 20 年;交易指令记录、交易结算记录、错单记录、客户投诉档案以及其他业务记录应当至少保存 20 年,但对期货交易有争议的,应当保存至该争议消除时为止。

第四十六条 会员从事经纪业务的，应当将交易所发布的即时行情和公告信息等市场信息及时在营业场所公布。

未经交易所批准，会员不得将上述信息提供给任何第三方从事经营活动，不得在非营业场所将上述信息提供其客户以外的其他机构和个人。

第四十七条 会员应当及时、准确传递客户交易指令，并将相关信息及时通知客户。未经客户委托，不得擅自代客户进行期货交易，不得隐瞒重要事项或者使用其他不正当手段诱骗客户发出交易指令。

第四十八条 会员收取的客户保证金归客户所有，任何单位和个人不得占用和挪用。

会员不得将收取的客户保证金用于自身经营活动或者清偿自身债务，不得允许他人擅自使用客户保证金或者擅自使用客户保证金为他人提供担保。

第四十九条 结算会员对其客户和受托交易会员的期货交易承担履约责任，交易会员、客户无法履约时，结算会员应当代为履约，并取得追偿权。

第五十条 会员为控制交易风险，需要对客户持仓实施强行平仓的，应当遵守双方合同约定的标准和条件，并以合同约定的方式通知客户。

第五十一条 会员应当督促客户遵守期货交易相关法律、行政法规、规章及交易所规则，持续开展风险教育，加强客户交易行为的合法合规性管理。

第五十二条 会员应当维护交易所的声誉，协助交易所处理突发或者异常事件。出现突发或者异常事件时，会员应当做好对客户的解释工作。

第五十三条 交易所每年定期或者不定期对会员执行交易所交易规则及其实施细则的情况进行检查，会员应当根据交易所的要求积极配合。

第五十四条 会员从业人员在交易所从事期货业务，应当经会员授权，会员从业人员在交易所从事的业务活动由所在会员承担全部责任。会员从业人员在同一时期内，只能受聘于一家会员，不得在其他会员处兼职。

会员变更、取消其从业人员期货业务授权的，应当及时通知交易所，并对交易所接到通知前其从业人员的业务活动承担全部责任。

第五十五条 会员资格终止后，该会员对其从业人员的授权自动失效。

第八章 附 则

第五十六条 违反本办法规定的，交易所按照本办法和《中国金融期货交易所违规违约处理办法》的有关规定处理。

第五十七条 本办法由交易所负责解释。

第五十八条 本办法自 2010 年 2 月 20 日起实施。

中国金融期货交易所信息管理办法

第一章 总 则

第一条 为规范信息的发布、经营、传播和使用，保障客户充分、及时、有效地获得信息，维护中国金融期货交易所（以下简称交易所）的信息权利，根据有关法律、行政法规、规章及《中国金融期货交易所交易规则》，制定本办法。

第二条 本办法所称信息是指与在交易所交易的产品有关的任何信息与数据，以及能够直接或者间接传达全部或者部分前述信息与数据的任何形式的描述，包括在交易所交易活动中产生的所有上市品种的交易行情、各种交易数据统计资料、交易所发布的各种公告和通知，以及中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）指定披露的其他相关信息。

法律、行政法规、规章和监管部门禁止披露的信息，不在本办法所称的信息范围内。

第三条 交易所对信息享有所有权，未经交易所授权许可，任何单位和个人不得从事与交易所信息有关的业务，包括发布、经营、增值开发或者传播交易所信息等。

第四条 交易所可以独立、与第三方合作或者委托第三方对交易所信息进行经营管理。

第五条 交易所提供信息实行有偿原则，根据有关法律、行政法规、规章或者备忘录为协助监管部门或者其他相关单位履行监管职责而提供的除外。

第六条 因不可抗力、意外事件等原因，导致交易信息及设备传输中断或者发生故障无法正常运作时，交易所不承担任何责任。

第七条 交易所发布的信息分法定披露信息和非法定披露信息。法定披露信息是指根据有关法律、行政法规和规章，交易所必须予以披露的信息。法定披露信息以外的属于非法定披露信息。

第八条 交易所信息的发布、经营、传播和使用适用本办法。交易所、会员、信息服务机构、软件开发公司、客户，以及其他经营、传播和使用交易所信息的组织和个人应当遵守本办法。

第二章 信息内容及发布

第九条 交易所根据有关规定和市场需要发布不同层次的即时、延时、每日、每周、每月交易信息，各类统计信息以及合约历史数据。

第十条 即时信息是指与集中交易所显示的行情基本同步且连续的市场行情信息，即实时行情。

实时行情：合约名称、合约月份、最新价、涨跌、成交量、持仓量、申买价、申卖价、申买量、申卖量、结算价、开盘价、收盘价、最高价、最低价、前结算价。

第十一条 每日信息是指每个交易日结束后发布的有关当日的交易信息。

每日信息包括下列主要内容：

（一）每日行情：合约名称、合约月份、开盘价、最高价、最低价、收盘价、前结算价、结算价、涨跌、成交量、持仓量、持仓量变化、成交额。

（二）单边持仓达到1万手以上（含）和当月合约前20名结算会员的成交量、持仓量。

第十二条 每周信息是指每周最后一个交易日结束后发布的有关本周的交易信息。

每周信息包括下列主要内容：

每周行情：合约名称、合约月份、周开盘价、最高价、最低价、周收盘价、涨跌（本周收盘价与上周末结算价之差）、持仓量、持仓量变化（本周末持仓量与上周末持仓量之差）、周末结算价、成交量、成交额。

第十三条 每月信息是指每月最后一个交易日结束后发布的有关本月的交易信息。

每月信息主要内容有：

每月行情：合约名称、合约月份、月开盘价、最高价、最低价、月收盘价、涨跌（本月末收盘价与上月末结算价之差）、持仓量、持仓量变化（本月末持仓量与上月末持仓量之差）、月末结算价、成交量、成交额。

第十四条 交易所通过交易所系统、互联网站、会员席位等方式发布信息，并通过经交易所授权的信息服务机构、公共媒体等机构传播信息。

第十五条 会员、信息服务机构、软件开发公司等机构对其从交易所获得的不宜公开的信息承担保密义务。

第十六条 会员、信息服务机构、公共媒体、软件开发公司等机构应当书面承诺不得发布虚假的或者带有误导性质的信息。

第三章 信息服务

第十七条 信息服务业务分为信息传播服务业务和信息增值服务业务。从事信息服务业务，应当经交易所许可或者授权，并与交易所签订信息经营许可协议。

信息传播服务业务是指经交易所许可或者授权，向其他机构传输，或者向信息终端用户（以下简称终端用户）、社会公众传播交易所信息的服务业务。

信息增值服务业务是指经交易所许可或者授权，对交易所信息进行加工，产生增值的服务业务。

第十八条 申请信息传播服务业务，应当具备下列条件：

（一）应当自行建立信息服务系统，能够提供以市场为导向的显示应用系统；

（二）具有终端收费的市场运作经验，具备有为市场提供可靠服务的切实可行的商业计划；

（三）应当设置监控中心，具有控制功能，并配置软、硬件工程师；

（四）具备必要的接收或者储存交易信息的设备或者方式，能够有效地防止交易信息的非授权接收、传播或者使用；

- (五) 公司财务状况良好;
- (六) 近2年无商业方面的不良记录;
- (七) 交易所规定的其他条件。

前款第四项中的设备或者方式包括:接收或者储存设备的种类、配置、数量、安置处所、有关的工作程序、规章制度。

第十九条 申请信息增值服务业务,除满足本办法第十八条第(四)、(五)、(六)、(七)项之规定外,还应当具有信息增值开发的能力和资质。

第二十条 申请信息服务业务的,应当依照交易所规定向交易所提交下列材料:

- (一) 交易所信息服务业务申请表,并注明申请从事的业务类型;
- (二) 法定代表人或者负责人身份证件;
- (三) 工商行政管理部门核发的营业执照;
- (四) 组织机构代码证;
- (五) 经会计师事务所审核的最近一个会计年度的财务报告;
- (六) 特许行业者需附主管机关的许可证照;
- (七) 申请成为分传播机构的,还应当提供其信息来源合法的证明文件;
- (八) 交易所要求提供的其他材料。

第二十一条 申请直接连接交易所系统的,应当首先通过交易所连接测试。其与交易所系统连接时,不得影响交易所交易业务,必要时交易所可以限制其连接。

从事信息服务业务的机构改变连接方式的,应当事先报交易所同意。

第二十二条 从事信息服务业务的机构以及交易所会员应当与交易所签订交易信息经营许可协议,严格依照交易信息经营许可协议接收、储存、在许可的区域内传播交易信息或者在其基础上进行增值开发,履行交易信息经营许可协议规定的义务。

未经交易所许可,从事信息服务业务的机构不得将交易信息用于信息经营许可协议载明的许可用途之外的任何目的。

第二十三条 从事信息传播服务业务的机构及交易所会员在传播交易所信息时,应当保证其真实、准确、完整,并且在传播过程中明确注明信息来源。

从事信息传播服务业务的机构或者交易所会员,发现其传输、传播的交易信息或者同时传播的新闻信息内容有错误时,应当立即通知交易所,及时更正并公开说明。

第二十四条 从事信息传播服务业务的机构或者交易所会员,在传输或者传播交易信息时,应当采取必要的技术措施以防止该信息被盗用、窃取或者外接使用。

不符合前款规定的,交易所所有权自行或者要求其他从事信息传播服务业务的机构暂停或者终止向其提供交易信息。

从事信息传播服务业务的机构或者交易所会员未经交易所同意,不得将交易信息出售或者转让他人,或者以任何方式再转接到其他场所。

第二十五条 从事信息传播服务业务的机构向其他机构传输交易信息,供后者进行再传播或者增值开发的,应当通知交易所,并要求后者提供其已获得交易所合法授权或者许可的证明。后者未提供前述证明的,从事信息传播服务业务的机构不得向其提供交易信息。

第二十六条 从事信息传播服务业务的机构应当将每日传输或者传播的信息内容保留30日以上，以备交易所随时检查。

从事信息传播服务业务的机构，法定代表人、联系人、营业地址、联系电话、传真号码以及其他经交易所规定应当申报的事项发生变更的，应当于该事实发生之日起10个工作日内向交易所报告。

第二十七条 信息传播服务机构应当准确记录其客户的信息，以及与收费有关的记录和资料。前述信息、记录和资料应当保留20年以上，以备交易所检查。

第二十八条 为便于交易所监督，信息传播服务机构应当在签署信息经营许可协议后的7日内，为交易所提供并安装能正常接收其传播内容的用户接收终端。

第二十九条 从事信息增值服务业务的机构在对信息进行增值开发时，应当保证信息的真实、准确、完整。对于经其加工处理后的信息，应当明显标示增值开发机构名称及加注说明，并承担法律责任。

从事信息增值服务业务的机构发现经其加工处理后的信息有错误或者可能误导客户时，应当立即通知交易所，及时更正并公开说明。

第三十条 从事信息增值服务业务的机构对信息进行的增值开发应当仅限于信息服务的目的。未经交易所事先书面同意，信息增值服务机构不得为信息服务以外的任何目的进行增值开发。

第四章 信息使用

第三十一条 终端用户是指向交易所授权的信息服务机构订购交易信息服务的信息最终接收者。终端用户只能从交易所授权的信息服务机构处获取交易信息。

第三十二条 信息服务机构应当与终端用户签订书面协议，协议内容应当明确规定终端用户应当遵守本办法有关规定，以及终端用户盗接、转接交易信息的处理措施及应负的责任。信息服务机构应当将其签订的用户协议报交易所备案。

第三十三条 交易所查询终端用户信息的，信息服务机构应当立即提供其与用户签订的协议副本及该用户的相关信息。

第三十四条 信息服务机构应当编制信息设备使用明细表并报送交易所，有新增或者变动的应当于每月7日前报送交易所。传输至境外的，应当按照其与交易所约定的时间编制境外使用说明书报送交易所。

第三十五条 信息服务机构应当通过用户协议要求其用户承诺其接收的信息仅供自身使用，不得将交易信息出售或者转让他人，或者以任何方式进行再传播。

信息服务机构应当防止其用户未经交易所授权，以任何方式将交易信息进行再传播，或者将交易信息提供给他人进行再传播。

信息服务机构应当协助交易所对其用户进行监管，不得规避或者拒绝履行协助义务。

第三十六条 发现或者认为可能存在针对交易所信息的侵权行为的，信息服务机构应当立即通知交易所，协助交易所展开调查，并配合交易所针对侵权行为采取包括诉讼在内的法律措施。

第五章 收费标准

第三十七条 从事与交易信息有关的信息传播和信息增值服务业务的，应当按照交易所规定的收费标准缴纳费用。

第三十八条 交易所可以根据实际情况变更收费项目和收费标准。

第三十九条 交易所根据有关规定和市场情况，区分法定披露信息和非法定披露信息，并根据不同档次或者深度的实时、延时、每日、每周、每月、每年等交易信息，以及各类统计信息和合约历史数据库确定不同的收费标准。

第六章 监督管理

第四十条 对未经交易所许可，擅自发布、传输和传播交易信息的机构和个人，交易所所有权终止其接收、传输和传播交易所信息，要求信息传播服务机构对其进行屏蔽，并追究其法律责任。

对未经交易所许可，擅自对交易信息进行增值开发的机构和个人，交易所所有权要求其停止增值开发，禁止其使用增值开发成果，要求信息传播服务机构对其进行屏蔽，并追究法律责任。

交易所要求信息传播服务机构对上述机构和个人进行屏蔽的，信息传播服务机构应当立即执行。

第四十一条 信息服务机构应当将约定的增值开发成果向交易所备案。未履行备案义务的，交易所所有权终止向其提供交易信息，要求信息传播服务机构对其进行屏蔽，并可根据已签署的交易信息经营许可协议进行处理。

第四十二条 已获交易所许可传播和增值开发信息的机构违反本办法的，交易所根据已签署的交易信息经营许可协议进行处理。

第四十三条 交易所会员使用、传播交易所信息的，除遵守本办法有关规定外，还应当遵守《中国金融期货交易所会员管理办法》的有关规定。

第四十四条 交易所会员违反本办法的，交易所将根据《中国金融期货交易所违规违约处理办法》以及相关协议进行处理。

第七章 附 则

第四十五条 本办法由交易所负责解释。

第四十六条 本办法自2010年2月20日起实施。

中国金融期货交易所实时行情（表式）

合约名称	合约月份	最新价	涨跌	成交量	持仓量	申买价	申卖价	申买量	申卖量	结算价	开盘价	收盘价	最高价	最低价	前结算价

注： 价格：指数点； 交易量、持仓量：手（按照单边计算）； 涨跌：最新价与前结算价之差。

中国金融期货交易所每日行情（表式） 年 月 日 星期

合约名	合约月	开盘	最高	最低	收盘	前结算	结算	涨跌	成交	持仓	持仓量变	成交额
小计												
小计												
小计												
小计												
总计												

注： 价格：指数点； 交易量、持仓量：手（按照单边计算）； 成交额：万元（按照单边计算）； 涨跌：收盘价与前结算价之差。

中国金融期货交易所每周行情（表式） 年 月 日 星期

合约名称	合约月	周开盘	最高	最低	周收盘	涨	持仓	持仓量变	周末结算	成交	成交
小计											
小计											
小计											
小计											
总计											

注： 价格：指数点； 成交量、持仓量：手（按照单边计算）； 成交额：亿元（按照单边计算） 涨跌：周收盘价与上周末结算价之差。

中国金融期货交易所每月行情（表式） 年 月

合约名	合约月	月开盘	最高	最低	月末收盘	涨	持仓	持仓量变	月末结算	成交	成交
小计											
小计											
小计											
小计											
总计											

注： 价格：指数点； 成交量、持仓量：手（按照单边计算）； 成交额：亿元（按照单边计算）； 涨跌：月收盘价与上月末结算价之差。

中国金融期货交易所信息服务业务申请表

信息服务机构名称		信息服务机构证 书号 (交易所填)	
组织机构代码证			
营业执照号		席位号	
税务登记号		注册资本	
公司地址(邮编)			
传真		Email	
联系人	姓名	联系电话	手机号码
现有客户群体			
信息服务基础设施			
终端收费控制说明			
附件	一、法定代表人或者负责人身份证件； 二、工商行政管理部门核发的营业执照； 三、组织机构代码证； 四、经会计师事务所审核的最近一个会计年度的财务报告； 五、特许行业者需附主管机关的许可证照； 六、交易所要求提供的其他材料。		
申请人及负责人或者法定代表人签章			

中国金融期货交易所风险控制管理办法

第一章 总 则

第一条 为加强期货交易风险管理,保护期货交易当事人的合法权益,保障中国金融期货交易所(以下简称交易所)期货交易的正常进行,根据《中国金融期货交易所交易规则》,制定本办法。

第二条 交易所风险管理实行保证金制度、涨跌停板制度、持仓限额制度、大户持仓报告制度、强行平仓制度、强制减仓制度、结算担保金制度和风险警示制度。

第三条 交易所、会员和客户应当遵守本办法。

第二章 保证金制度

第四条 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。

第五条 股指期货合约最低交易保证金标准为12%。期货交易过程中,出现下列情形之一的,交易所可以根据市场风险状况调整交易保证金标准,并向中国证券监督管理委员会(以下简称中国证监会)报告:

- (一) 期货交易出现涨跌停板单边无连续报价(以下简称单边市);
- (二) 遇国家法定长假;
- (三) 交易所认为市场风险明显变化;
- (四) 交易所认为必要的其他情形。

单边市是指某一合约收市前5分钟内出现只有停板价格的买入(卖出)申报、没有停板价格的卖出(买入)申报,或者一有卖出(买入)申报就成交、但未打开停板价格的情形。

第六条 交易所调整期货合约交易保证金标准的,在当日结算时对该合约的所有持仓按照调整后的交易保证金标准进行结算。

第七条 结算准备金的管理适用《中国金融期货交易所结算细则》的有关规定。

第三章 涨跌停板制度

第八条 交易所实行涨跌停板制度。涨跌停板幅度由交易所设定,交易所可以根据市场风险状况调整涨跌停板幅度。

第九条 股指期货合约的涨跌停板幅度为上一交易日结算价的 $\pm 10\%$ 。

季月合约上市首日涨跌停板幅度为挂盘基准价的 $\pm 20\%$ 。上市首日有成交的,于下一交易日恢复到合约规定的涨跌停板幅度;上市首日无成交的,下一交易日继续执行前

一交易日的涨跌停板幅度。

股指期货合约最后交易日涨跌停板幅度为上一交易日结算价的±20%。

第十条 期货合约连续两个交易日出现同方向单边市（第一个单边市的交易日称为D1交易日，第二个单边市的交易日称为D2交易日，D1交易日前一交易日称为D0交易日，下同），D2交易日为最后交易日的，该合约直接进行交割结算；D2交易日不是最后交易日的，交易所有权根据市场情况采取下列风险控制措施中的一种或者多种：提高交易保证金标准、限制开仓、限制出金、限期平仓、强行平仓、暂停交易、调整涨跌停板幅度、强制减仓或者其他风险控制措施。

第四章 持仓限额制度

第十一条 交易所实行持仓限额制度。持仓限额是指交易所规定的会员或者客户对某一合约单边持仓的最大数量。

第十二条 同一客户在不同会员处开仓交易，其在某一合约单边持仓合计不得超出该客户的持仓限额。

第十三条 会员和客户的股指期货合约持仓限额具体规定如下：

（一）进行投机交易的客户号某一合约单边持仓限额为100手；

（二）某一合约结算后单边总持仓量超过10万手的，结算会员下一交易日该合约单边持仓量不得超过该合约单边总持仓量的25%；

进行套期保值交易和套利交易的客户号的持仓按照交易所有关规定执行，不受前款第一项限制。

第十四条 会员、客户持仓达到或者超过持仓限额的，不得同方向开仓交易。

第五章 大户持仓报告制度

第十五条 交易所实行大户持仓报告制度。交易所可以根据市场风险状况，公布持仓报告标准。

从事自营业务的交易会员或者客户，进行套期保值交易、套利交易、投机交易的不同客户号下的持仓应当合并计算；同一客户在不同会员处的持仓合并计算。

第十六条 会员或者客户持仓达到交易所规定的报告标准或者交易所要求报告的，应当于下一交易日收市前向交易所报告。

客户未报告的，开户会员应当向交易所报告。客户在多个会员处开户的，由交易所指定有关会员向交易所报送该客户应当报告的有关资料。交易所有权要求会员、客户再次报告或者补充报告。

第十七条 达到交易所规定报告标准或者交易所要求报告的会员或者客户应当提供下列资料：

（一）《大户持仓报告表》（见附件），内容包括会员名称、会员号、客户名称和客户号、合约代码、持仓量、交易保证金、可动用资金等；

（二）资金来源说明；

（三）法人客户的实际控制人资料；

（四）开户资料及当日结算单据；

(五) 交易所要求提供的其他资料。

第十八条 会员应当对客户提供的资料进行审核, 并保证客户所提供资料的真实性和准确性。

第十九条 交易所所有权对会员或者客户提供的资料进行核查。

第六章 强行平仓制度

第二十条 交易所实行强行平仓制度。强行平仓是指交易所按照有关规定对会员、客户持仓实行平仓的一种强制措施。

第二十一条 会员、客户出现下列情形之一的, 交易所对其持仓实行强行平仓:

(一) 结算会员结算准备金余额小于零, 且未能在第一节结束前补足;

(二) 客户、从事自营业务的交易会员持仓超出持仓限额标准, 且未能在第一节结束前平仓;

(三) 因违规、违约受到交易所强行平仓处理;

(四) 根据交易所的紧急措施应当予以强行平仓;

(五) 交易所规定应当予以强行平仓的其他情形。

第二十二条 需要强行平仓的头寸先由会员在第一节结束前执行, 交易所另有规定的除外。会员未在规定时间内执行完毕的, 由交易所强制执行。

(一) 会员执行

因本办法第二十一条第(一)、(二)项情形强行平仓的, 会员执行平仓的原则由会员自行确定, 平仓结果应当符合交易所规定。

(二) 交易所执行

1. 因本办法第二十一条第(一)项情形强行平仓的:

对需要强行平仓的头寸, 由交易所按照上一交易日结算后合约总持仓量由大到小顺序, 优先选择持仓量大的合约作为强行平仓的合约, 再按照该会员该合约所有客户持仓比例分配。

交易所对多个结算会员强行平仓的, 按照应当追加保证金数额由大到小的顺序依次选择强行平仓的结算会员。

2. 因本办法第二十一条第(二)项情形强行平仓的:

交易所对超仓头寸进行强行平仓的, 客户在多个会员处持仓时, 按照持仓数量由大到小的顺序选择会员强行平仓。

3. 因本办法第二十一条第(三)、(四)、(五)项情形强行平仓的, 交易所根据涉及的会员或者客户的具体情况确定强行平仓头寸。

会员同时存在本办法第二十一条第(一)、(二)项所规定情形时, 交易所先按照第(二)项情形确定强行平仓头寸, 再按照第(一)项情形确定强行平仓头寸。

第二十三条 强行平仓的执行程序

(一) 通知

交易所以“强行平仓通知书”(以下简称通知书)的形式向有关结算会员下达强行平仓要求。通知书随当日结算数据发送, 有关结算会员可以通过交易所系统获得, 交易

所特别送达的除外。

（二）执行及确认

1. 开市后，有关会员应当自行平仓，直至符合交易所规定；
2. 结算会员超过规定平仓时限而未执行完毕的，剩余部分由交易所执行强行平仓；
3. 强行平仓结果随当日成交记录发送，有关信息可以通过交易所系统获得。

第二十四条 强行平仓的价格通过市场交易形成。

第二十五条 因价格涨跌停板限制或者其他市场原因，无法在规定时限内完成全部强行平仓的，剩余强行平仓数量可以顺延至下一交易日继续强行平仓，仍按照本办法第二十二条原则执行，直至符合交易所规定。

第二十六条 因价格涨跌停板限制或者其他市场原因，无法在当日完成全部强行平仓的，交易所根据当日结算结果，对该会员做出相应处理。

第二十七条 因价格涨跌停板限制或者其他市场原因，有关持仓的强行平仓只能延时完成的，因此产生的亏损，由直接责任人承担；未能完成平仓的，该持仓持有者应当继续对此承担持仓责任或者交割义务。

第二十八条 由会员执行的强行平仓产生的盈利归直接责任人；由交易所执行的强行平仓产生的盈亏相抵后的盈利按照国家有关规定执行；因强行平仓产生的亏损由直接责任人承担。

直接责任人是客户的，强行平仓后产生的亏损，由该客户所在会员先行承担后，自行向该客户追索。

第七章 强制减仓制度

第二十九条 交易所实行强制减仓制度。强制减仓是指交易所将当日以涨跌停板价格申报的未成交平仓报单，以当日涨跌停板价格与该合约净持仓盈利客户按照持仓比例自动撮合成交。

第三十条 强制减仓的方法

（一）同一客户（包括从事自营业务的交易会员，本章下同）在同一合约上双向持仓的，其净持仓部分平仓报单参与强制减仓计算，其余平仓报单与其反向持仓自动对冲平仓。

（二）申报平仓数量的确定

申报平仓数量是指在D2交易日收市后，已经在交易所系统中以涨跌停板价格申报未成交的、且客户合约的单位净持仓亏损大于等于D2交易日结算价10%的所有持仓。

客户不愿按照上述方法平仓的，可以在收市前撤单。

（三）客户合约单位净持仓盈亏的确定

客户合约的单位净持仓盈亏是指客户该合约的持仓盈亏的总和除以净持仓量。客户该合约持仓盈亏的总和是指客户该合约所有持仓中，D0交易日（含）前成交的按照D0交易日结算价、D1交易日和D2交易日成交的按照实际成交价与D2交易日结算价的差额合并计算的盈亏总和。

（四）单位净持仓盈利客户平仓范围的确定

根据上述方法计算的单位净持仓盈利大于零的客户的盈利方向净持仓均列入平仓范围。

（五）平仓数量的分配原则

1. 在平仓范围内按照盈利大小的不同分成三级, 逐级进行分配。

首先分配给单位净持仓盈利大于等于D2交易日结算价的10%的持仓（以下简称盈利10%以上的持仓）；其次分配给单位净持仓盈利小于D2交易日结算价的10%而大于等于6%的持仓（以下简称盈利6%以上的持仓）；最后分配给单位净持仓盈利小于D2交易日结算价的6%而大于零的持仓（以下简称盈利大于零的持仓）。

2. 以上各级分配比例均按照申报平仓数量(剩余申报平仓数量)与各级可平仓的盈利持仓数量之比进行分配。

盈利10%以上的持仓数量大于等于申报平仓数量的, 根据申报平仓数量与盈利10%以上的持仓数量的比例, 将申报平仓数量向盈利10%以上的持仓分配实际平仓数量。

盈利10%以上的持仓数量小于申报平仓数量的, 根据盈利10%以上的持仓数量与申报平仓数量的比例, 将盈利10%以上的持仓数量向申报平仓客户分配实际平仓数量；再把剩余的申报平仓数量按照上述的分配方法依次向盈利6%以上的持仓、盈利大于零的持仓分配；还有剩余的, 不再分配。

（六）强制减仓的执行

强制减仓于D2交易日收市后执行, 强制减仓结果作为D2交易日会员的交易结果。

（七）强制减仓的价格

强制减仓的价格为该合约D2交易日的涨跌停板价格。

按照本条进行强制减仓造成的损失由会员及其客户承担。

第三十一条 该合约在采取上述措施后风险仍未释放的, 交易所宣布进入异常情况, 并按照有关规定采取紧急措施。

第八章 结算担保金制度

第三十二条 交易所实行结算担保金制度。结算担保金是指由结算会员依照交易所规定缴存的, 用于应对结算会员违约风险的共同担保资金。

第三十三条 结算担保金分为基础结算担保金和变动结算担保金。基础结算担保金是指结算会员参与交易所结算交割业务必须缴纳的最低结算担保金数额。变动结算担保金是指结算会员结算担保金中超出基础结算担保金的部分, 随结算会员业务量的变化而调整。结算担保金应当以现金形式缴纳。

（一）各类结算会员的基础结算担保金为：交易结算会员人民币1000万元, 全面结算会员人民币2000万元, 特别结算会员人民币3000万元。结算会员应当在签署《中国金融期货交易所结算会员协议》后第5个交易日第一节结束前, 将基础结算担保金存入交易所结算担保金专用账户。

（二）交易所每季度首个交易日确定本季度全市场的结算担保金基数, 作为计算各结算会员应当分担的结算担保金的依据。

交易所根据结算担保金基数, 按照各结算会员业务量比例计算本季度其应当分担的结算担保金。结算会员本季度应当分担的结算担保金=结算担保金基数×(20%×该会

员上一季度日均交易量/全市场上一季度日均交易量+80%×该会员上一季度日均持仓量/全市场上一季度日均持仓量)。

结算会员应当分担的结算担保金数额与其基础结算担保金数额取大者,作为结算会员本季度应当缴纳的结算担保金金额。交易所在本季度的第5个交易日第一节结束后,通过银行将结算担保金余额的超出部分划至结算会员结算担保金专用账户,将需要补缴的结算担保金从结算会员结算担保金专用账户中扣划。

结算会员需要补缴结算担保金的,应当在本季度的第5个交易日第一节结束前将补缴金额存入其结算担保金专用账户。

(三)交易所可以根据市场风险情况调整结算担保金的收取时间以及结算担保金基数,并有权提高个别结算会员应当缴纳的结算担保金金额。

第三十四条 结算会员结算准备金小于零,且未能在规定时限内补足的,交易所采取强行平仓等措施后,结算会员无持仓且结算准备金仍小于零的,交易所所有权使用该违约结算会员的结算担保金补足,不足部分再按照比例使用其他结算会员缴纳的结算担保金。

其他结算会员分摊比例为其结算担保金余额占当前未使用结算担保金总额之比。

第三十五条 结算会员缴纳的结算担保金,依本办法第三十四条使用后,应当于使用日之后的第5个交易日第一节结束前按照原缴纳标准,将需要补缴的部分存至其结算担保金专用账户。交易所于第5个交易日第一节结束后通过银行从结算会员结算担保金专用账户中扣划。

第三十六条 结算会员未能按期缴纳结算担保金的,按照《中国金融期货交易所违规违约处理办法》有关规定处理。

第三十七条 动用结算担保金后,交易所由此取得对违约会员的相应追偿权。

第九章 风险警示制度

第三十八条 交易所实行风险警示制度。交易所认为必要的,可以单独或者同时采取要求会员和客户报告情况、谈话提醒、书面警示、发布风险警示公告等措施中的一种或者多种,以警示和化解风险。

第三十九条 出现下列情形之一的,交易所所有权约见会员的高级管理人员或者客户谈话提醒风险,或者要求会员或者客户报告情况:

- (一) 期货价格出现异常;
- (二) 会员或者客户交易异常;
- (三) 会员或者客户持仓异常;
- (四) 会员资金异常;
- (五) 会员或者客户涉嫌违规、违约;
- (六) 交易所接到涉及会员或者客户的投诉;
- (七) 会员涉及司法调查;
- (八) 交易所认定的其他情况。

第四十条 交易所实施谈话提醒,应当提前一天以书面形式将谈话时间、地点、要求等事项通知相关会员或者客户,交易所工作人员应当对谈话的有关内容予以保密。

客户应当亲自参加谈话提醒，并由会员指定人员陪同；谈话对象确因特殊情况不能参加的，应当事先报告交易所，经交易所同意后可以书面委托有关人员代理。谈话对象应当如实陈述、不得隐瞒事实。

第四十一条 交易所通过情况报告和谈话，发现会员或者客户有违规嫌疑、交易头寸有较大风险的，有权对会员或者客户发出《风险警示函》。

第四十二条 发生下列情形之一的，交易所所有权发出风险警示公告，向全体会员和客户警示风险：

- （一）期货价格出现异常；
- （二）期货价格和现货价格出现较大差距；
- （三）会员或者客户涉嫌违规、违约；
- （四）会员或者客户交易存在较大风险；
- （五）交易所认定的其他情形。

第十章 附 则

第四十三条 本办法中持仓是指每一客户号对应的持仓。

第四十四条 违反本办法规定的，交易所按照本办法和《中国金融期货交易所违规违约处理办法》的有关规定处理。

第四十五条 本办法由交易所负责解释。

第四十六条 本办法自2010年2月20日起实施。

附件

大户持仓报告表

客户名称				
客户号		<input type="checkbox"/> 投机 <input type="checkbox"/> 套利 <input type="checkbox"/> 套保		
联系地址		联系电话		
资金调拨人名称		资金调拨人联系电话		
指令下达人名称		指令下达人联系电话		
合约代码		买持仓量		卖持仓量
合约代码		买持仓量		卖持仓量
合约代码		买持仓量		卖持仓量
合约代码		买持仓量		卖持仓量
总持仓保证金		资金规模		实际控制人
资金来源				
<p>本人（公司）保证以上报告内容的真实性和准确性，不存在任何故意虚假或者遗漏。</p> <p>报告人签名：_____ 报告日期：_____ 年 月 日</p>				
以下由客户所属会员填写				
<p>本公司保证客户在我处持仓大小的真实性，不存在任何虚假或者遗漏。</p> <p>会 员 单 位 盖 章： 年 月 日</p>				
会员名称		会员号		
客户开户日期		客户交易方式		
IP 地址		电话委托号码		
<p>经审核，本公司保证本报告所有内容的真实性，不存在任何隐瞒或者遗漏。</p> <p>会员单位盖章：_____ 报告日期：_____</p>				

年 月 日

中国金融期货交易所套期保值管理办法

第一章 总 则

第一条 为发挥期货市场的套期保值功能，促进期货市场的规范发展，根据《中国金融期货交易所交易规则》，制定本办法。

第二条 会员、客户在中国金融期货交易所（以下简称交易所）从事套期保值业务应当遵守本办法。

第二章 套期保值额度的申请与审批

第三条 交易所实行套期保值额度审批制度。客户申请套期保值额度的，应当向其开户的会员申报，会员对申报材料进行审核后向交易所办理申请手续。

会员申请套期保值额度的，直接向交易所办理申请手续。

第四条 申请套期保值额度的会员或者客户，应当填写《中国金融期货交易所套期保值额度申请（审批）表》，并向交易所提交下列申请材料：

（一）自然人客户应当提交本人身份证复印件，会员或者法人客户应当提交营业执照副本复印件、组织机构代码证复印件以及近2年经审计的财务报告；

（二）近6个月的现货交易情况；

（三）申请人的套期保值交易方案；

（四）申请人历史套期保值交易情况说明；

（五）会员对申请人材料真实性的核实声明；

（六）交易所规定的其他材料。

第五条 套期保值额度由交易所根据套期保值申请人的现货市场交易情况、资信状况和市场情况审批。

第六条 交易所在受理套期保值额度申请后5个交易日内完成审批，并按照下列情形分别处理：

（一）符合套期保值条件的，通知其准予办理；

（二）不符合套期保值条件的，通知其不予办理；

(三) 相关申请材料不足的, 通知申请人补充申请材料。

交易所应当将套期保值的审批结果报告中国证监会。

第七条 套期保值额度自获批之日起6个月内有效, 有效期内可以重复使用。获批套期保值额度可以在多个月份合约使用, 各合约同一方向套期保值持仓合计不得超过该方向获批的套期保值额度。

第八条 在某一合约最后10个交易日内获批的新增套期保值额度不得在该合约上使用。

第九条 交易所根据市场情况对套期保值额度进行调整。

第十条 申请人需要调整套期保值额度时, 应当及时向交易所提出书面变更申请。调整后的套期保值额度自获批之日起6个月内有效。

第三章 套期保值监督管理

第十一条 交易所对申请人的有关经营状况、资信情况及期货、现货市场交易行为进行监督和调查, 会员及相关客户应当予以协助和配合。

交易所要求获批套期保值额度的申请人报告现货、期货交易情况。

第十二条 交易所对会员或者客户获批套期保值额度的使用情况进行监督管理。

第十三条 会员或者客户套期保值期货持仓超过其相应的现货资产配比要求的, 交易所要求其限期调整; 逾期未进行调整或者调整后仍不符合要求的, 交易所调整或者取消其套期保值额度, 必要时可以采取限制开仓、限期平仓、强行平仓等措施。

第十四条 会员或者客户各合约同一方向套期保值持仓合计超过该方向获批套期保值额度的, 应当在下一交易日第一节交易结束前自行调整; 逾期未进行调整或者调整后仍不符合要求的, 交易所对其采取调整或者取消其套期保值额度、限制开仓、限期平仓、强行平仓等措施。

第十五条 会员或者客户应当在不迟于套期保值额度有效期到期前5个交易日向交易所申请新的套期保值额度; 逾期未申请的, 会员或者客户应当在套期保值额度有效期到期前对套期保值持仓进行平仓; 逾期不平仓的, 交易所对其采取限制开仓、限期平仓、强行平仓等措施。

第十六条 获批套期保值额度的会员或者客户在套期保值额度内频繁进行开平仓交易的, 交易所对其采取谈话提醒、书面警示、调整或者取消其套期保值额度、限制开仓、限期平仓、强行平仓等措施。

第十七条 会员或者客户在进行套期保值申请和交易时, 存在欺诈或者违反交易所规定的其他行为的, 交易所不受理其套期保值申请、调整或者取消其套期保值额度, 将其已建立的相关套期保值持仓予以部分或者全部强行平仓, 并按照《中国金融期货交易所违规违约处理办法》的有关规定处理。

第四章 附 则

第十八条 违反本办法规定的, 交易所按照本办法和《中国金融期货交易所违规违约处理办法》的有关规定处理。

第十九条 本办法由交易所负责解释。

第二十条 本办法自2010年2月20日起实施。

股指期货投资者适当性制度实施办法（试行）

第一条 为保障股指期货市场平稳、规范、健康运行，防范风险，保护投资者的合法权益，根据《期货交易管理条例》、《期货交易所管理办法》、《期货公司管理办法》和《关于建立股指期货投资者适当性制度的规定（试行）》等行政法规、规章及中国金融期货交易所（以下简称交易所）业务规则，制定本办法。

第二条 期货公司会员应当根据中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）有关规定和本办法要求，评估投资者的产品认知水平和风险承受能力，选择适当的投资者审慎参与股指期货交易，严格执行股指期货投资者适当性制度（以下简称投资者适当性制度）各项要求，建立以了解客户和分类管理为核心的客户管理和服务制度。

第三条 投资者应当根据投资者适当性制度的要求，全面评估自身的经济实力、产品认知能力、风险控制与承受能力，审慎决定是否参与股指期货交易。

第四条 期货公司会员只能为符合下列标准的自然人投资者申请开立股指期货交易编码：

（一）申请开户时保证金账户可用资金余额不低于人民币50万元；

（二）具备股指期货基础知识，通过相关测试；

（三）具有累计10个交易日、20笔以上的股指期货仿真交易成交记录，或者最近三年内具有10笔以上的商品期货交易成交记录；

（四）不存在严重不良诚信记录；不存在法律、行政法规、规章和交易所业务规则禁止或者限制从事股指期货交易的情形。

期货公司会员除按上述标准对投资者进行审核外，还应当按照交易所制定的投资者适当性制度操作指引，对投资者的基本情况、相关投资经历、财务状况和诚信状况等进行综合评估，不得为综合评估得分低于规定标准的投资者申请开立股指期货交易编码。

第五条 期货公司会员只能为符合下列标准的一般法人投资者申请开立股指期货交易编码：

（一）净资产不低于人民币100万元；

（二）申请开户时保证金账户可用资金余额不低于人民币50万元；

（三）具有相应的决策机制和操作流程；

（四）相关业务人员具备股指期货基础知识，通过相关测试；

（五）具有累计10个交易日、20笔以上的股指期货仿真交易成交记录；或者最近三年内具有10笔以上的商品期货交易成交记录；

（六）不存在严重不良诚信记录；不存在法律、行政法规、规章和交易所业务规则禁止或者限制从事股指期货交易的情形。

期货公司会员为其他经济组织申请开立股指期货交易编码的，参照本条执行。

第六条 期货公司会员只能为获得监管机构或者主管机关批准从事股指期货交易的特殊法人投资者申请开立股指期货交易编码。

第七条 交易所可以根据市场情况对投资者适当性标准进行调整。

第八条 期货公司会员应当根据中国证监会的有关规定、本办法及交易所制定的投资者适当性制度操作指引，制定本公司的实施方案，建立相关工作制度，完善内部分工与业务流程。

第九条 期货公司会员应当建立并有效执行客户开发责任追究制度，明确高级管理人员、业务部门负责人、营业部负责人、复核评估人、开户经办人、客户开发人员的责任。

第十条 期货公司会员开展股指期货开户业务，应当及时将投资者适当性制度实施方案及相关工作制度报交易所备案。交易所无异议的，期货公司会员才能为投资者申请开立股指期货交易编码。

第十一条 期货公司会员应当向投资者充分揭示股指期货风险，全面客观介绍股指期货法律法规、业务规则和产品特征，严格验证投资者资金、股指期货仿真交易经历和

商品期货交易经历，测试投资者的股指期货基础知识，审慎评估投资者的诚信状况和风险承受能力，认真审核投资者开户申请材料。

第十二条 期货公司会员应当督促客户遵守与股指期货交易相关的法律、行政法规、规章及交易所业务规则，持续开展风险教育，加强客户交易行为的合法合规性管理。

第十三条 期货公司会员应当建立客户资料档案，除依法接受调查和检查外，应当为客户保密。

第十四条 期货公司会员应当为客户提供合理的投诉渠道，告知投诉的方法和程序，妥善处理纠纷，督促客户依法维护自身权益。

第十五条 期货公司会员委托具有中间介绍业务资格的证券公司协助办理开户手续的，应当与证券公司建立业务对接规则，落实投资者适当性制度的相关要求，对证券公司相关业务进行复核。

第十六条 投资者应当如实申报开户材料，不得采取虚假申报等手段规避投资者适当性制度要求。

第十七条 投资者应当遵守“买卖自负”的原则，承担股指期货交易的履约责任，不得以不符合投资者适当性标准为由拒绝承担股指期货交易履约责任。

第十八条 投资者应当通过正当途径维护自身合法权益。投资者维护自身合法权益时应当遵守法律法规的相关规定，不得侵害国家、社会、集体利益和他人合法权益，不得扰乱社会公共秩序、交易所及相关单位的工作秩序。

第十九条 交易所对期货公司会员落实投资者适当性制度相关要求的情况进行检查时，期货公司会员应当配合，如实提供投资者开户材料、资金账户情况等资料，不得隐瞒、阻碍和拒绝。

交易所在检查中发现从事中间介绍业务的证券公司存在违规行为的，进行必要的延伸检查，并将有关违规情况通报中国证监会相关派出机构。

第二十条 对存在或者可能存在违反投资者适当性制度行为的期货公司会员，交易所可以采取约见谈话、责令参加培训、增加内控合规自查次数、口头警示、书面警示、责令处分责任人员、限期说明情况、专项调查和暂停受理或者办理相关业务等监管措施。

第二十一条 期货公司会员违反投资者适当性制度的，交易所可以对其采取责令整改、谈话提醒、书面警示、通报批评、公开谴责、暂停受理申请开立新的交易编码、暂

停或者限制业务、调整或者取消会员资格等处理措施；情节严重的，交易所可以向中国证监会、中国期货业协会提出行政处罚或者纪律处分建议。

第二十二條 期貨公司會員工作人員對違規行為負責的，交易所可以採取通報批評、公開譴責、暫停從事交易所期貨業務和取消從事交易所期貨業務資格等處理措施；情節嚴重的，交易所可以向中國證監會、中國期貨業協會提出撤銷任職資格、取消從業資格等行政處罰或者紀律處分建議。

第二十三條 本辦法所稱特殊法人包括證券公司、基金公司、合格境外機構投資者，以及須經監管機構或者主管機關批准才能參與股指期貨交易的其他法人；一般法人系指特殊法人以外的法人。

第二十四條 本辦法由交易所負責解釋。

第二十五條 本辦法自發布之日起實施。

中国金融期货交易所套期保值额度申请（审批）表

一、申请人基本情况			
会员名称		会员号	
联系人		电话	
申请人名称		申请人客户号	
联系人		电话	
二、套期保值申请情况			
产品	买/卖	申请数量	申请日期
三、报送材料（另附）			
<p>1、自然人客户应当提交本人身份证复印件，会员或者法人客户应当提交营业执照副本复印件、组织机构代码证复印件以及近2年经过审计的财务报告；</p> <p>2、客户需要保值的现货资产持有状况的证明；</p> <p>3、近6个月的现货交易情况；</p> <p>4、套期保值交易方案；</p> <p>5、历史套期保值交易情况说明；</p> <p>6、交易所规定的其他材料。</p>			
四、申请人声明事项			
<p>1、提供的文件内容完整并且真实；</p> <p>2、将依据内部稽核与内部控制程序从事期货交易；</p> <p>3、遵守期货交易相关法律法规从事期货交易，绝不以不当手段干扰期货与相关现货市场运作，并且了解中国金融期货交易所执行监管时，对发现的异常情况有权依据《中国金融期货交易所交易规则》及其实施细则相关规定采取相应措施以维护市场秩序；</p> <p>4、同意中国金融期货交易所申请人在从事期货交易期间，可以依据相关规定要求申请人就有关事项限期提出书面说明或者补充文件，申请人不会规避或者拒绝。</p>			
五、申请人签章			

<p>申请人（负责人）签章：</p> <p>申请人盖章：</p>
<p>六、会员对申请人材料真实性的声明事项</p>
<p>我公司保证申请人向贵所提供的各项证明材料均属实，并在运作中按照中国金融期货交易所的有关规定执行。</p>
<p>七、会员签章</p>
<p>会员负责人签章：</p> <p>会员盖章：</p>
<p>八、交易所审批</p>
<p>交易所审批意见：</p>

注：会员作为申请人的，不适用本表第六项和第七项。

二、期货法规

关于建立股指期货投资者适当性制度的规定（试行）

第一条 为督促期货公司建立健全内控、合规制度，建立并完善以了解客户和分类管理为核心的客户管理和服务制度，保护投资者合法权益，保障股指期货市场平稳、规范和健康运行，根据《期货交易管理条例》、《期货交易所管理办法》及《期货公司管理办法》等法规、规章，制定本规定。

第二条 本规定所称股指期货投资者适当性制度（以下简称投资者适当性制度），是指根据股指期货的产品特征和风险特性，区别投资者的产品认知水平和风险承受能力，选择适当的投资者审慎参与股指期货交易，并建立与之相适应的监管制度安排。

第三条 中国证监会各省、自治区、直辖市、计划单列市监管局（以下统称各派出机构），中国金融期货交易所（以下简称中金所），中国期货保证金监控中心公司（以下简称监控中心），中国期货业协会（以下简称中期协）应当按照“统一领导、各司其职、各负其责、加强协作、联合监管”的原则，严格落实本规定的各项工作要求。

第四条 中国证监会及其派出机构对期货公司执行投资者适当性制度的情况进行监督检查。

中金所、中期协对期货公司执行投资者适当性制度的情况进行自律管理。

监控中心对期货公司执行投资者适当性制度的情况进行核查验证。

第五条 中金所应当从投资者的经济实力、股指期货产品认知能力、投资经历等方面，制定投资者适当性制度的具体标准和实施指引，并报中国证监会备案。

第六条 期货公司应当建立健全内控、合规制度，严格落实投资者适当性制度。

期货公司应当根据中金所制定的标准和指引，制定投资者适当性标准的实施方案，建立并有效执行客户开发管理制度和开户审核工作制度，完善业务流程与内部分工，加强责任追究。

期货公司应当及时将投资者适当性制度实施方案及相关制度报中金所和公司所在地中国证监会派出机构备案。

第七条 期货公司应当深化客户服务，向投资者充分揭示股指期货风险，全面客观介绍股指期货法律法规、业务规则和产品特征，测试投资者的股指期货基础知识，认真审核投资者开户申请材料，审慎评估投资者的风险承受能力，不得为不符合适当性标准的投资者申请开立股指期货交易编码。

期货公司应当建立客户资料档案，除依法接受调查和检查外，应当为客户保密。

第八条 自然人投资者应当全面评估自身的经济实力、产品认知能力、风险控制能力、生理及心理承受能力等，审慎决定是否参与股指期货交易。

法人投资者及其他经济组织从事股指期货交易业务，应当根据自身的经营管理特点和业务运作状况，建立健全内部控制和 risk 管理制度，对自身的内部控制和 risk 管理能力进行客观评估，审慎决定是否参与股指期货交易。

第九条 投资者应当如实申报开户材料，不得采取虚假申报等手段规避投资者适当性标准要求。投资者提供虚假证明材料的，应当承担相应的责任。

投资者应当遵守“买卖自负”的原则，承担股指期货交易的履约责任，不得以不符合投资者适当性标准为由拒绝承担股指期货交易履约责任。

第十条 中金所、期货公司应当加强对投资者交易行为的合法合规性管理，督促投资者遵守股指期货交易相关法律、法规、规章及中金所业务规则，持续开展投资者风险教育。

第十一条 期货公司应当完善客户纠纷处理机制，明确承担此项职责的部门和岗位，负责处理投资者参与股指期货交易所产生的投诉等事项，及时化解相关矛盾纠纷。

期货公司应当督促客户遵守法律法规，通过正当途径维护自身合法权益，不得侵害国家利益及他人的合法权益，不得扰乱社会公共秩序。

第十二条 期货公司违反投资者适当性制度要求，未能执行相关内控、合规制度的，中国证监会及其派出机构依据相关法律法规的规定，采取监管措施；情节严重的，根据《期货交易管理条例》第七十条进行处罚。

期货公司违反投资者适当性制度要求的，中金所、中期协应当根据业务规则和自律规则对其进行纪律处分。

第十三条 取得中间介绍业务资格的证券公司接受期货公司委托，协助办理开户手续的，应当对投资者开户资料和身份真实性等进行审查，向投资者充分揭示股指期货交易风险，进行相关知识测试和风险评估，做好开户入金指导，严格执行投资者适当性制度。

第十四条 期货公司和从事中间介绍业务的证券公司应当在其经营场所为投资者办理股指期货开户手续。

第十五条 中国证监会及其派出机构对取得中间介绍业务资格的证券公司进行日常监督检查，发现证券公司违反投资者适当性制度要求的，依法采取监管措施或者予以行政处罚。

中金所以对期货公司执行投资者适当性制度的情况进行检查，检查中发现从事中间介绍业务的证券公司存在违法违规行为的，应将有关情况通报相关派出机构。

第十六条 投资者适当性制度对投资者的各项要求以及依据制度进行的评价，不构成投资建议，不构成对投资者的获利保证。

第十七条 本规定由中国证监会负责解释。

第十八条 本规定自 2010 年 2 月 8 日起施行。

关于股指期货投资者适当性制度征求意见情况的说明

2010年1月15日，中国证监会发布了《关于建立股指期货投资者适当性制度的规定（试行）》，中国金融期货交易所、中国期货业协会也发布了配套文件，同时向社会公开征求意见。期间，共收到反馈意见52条。其中期货公司、证券公司及其他机构的意见17条，个人投资者35条。

从征求意见情况和社会舆论反映来看，投资者、中介机构和专家学者普遍支持建立投资者适当性制度。认为适当性制度设计合理，实施安排科学，考虑了我国资本市场的实际和股指期货的风险特性，体现了将适当产品销售给适当投资者的理念，符合保护投资者合法权益的基本原则，可从源头上深化投资者风险教育，有效避免投资者盲目入市，确保股指期货平稳推出。

经过认真研究，吸收采纳的意见主要有以下几个方面。

一是制度实施方面，主要涉及期货公司和证券公司的分工。有意见提出，证券公司是投资者适当性制度诸多环节的落实主体，应当明确在相关业务中的分工。采纳该意见，在中金所《实施办法》中增加期货公司、证券公司业务对接要求，并规定期货公司对证券公司的相关业务进行复核。

二是在操作性方面，主要集中在适当性指标的具体理解和实施。有意见认为，中金所《实施办法》硬性条件中10个交易日，20笔以上股指期货仿真交易成交记录的要求不明确。10个交易日是否必须是连续的，20笔上成交是否是累计的。采纳该意见，明确仿真交易累计10个交易日的时间要求。

有意见提出，应当明确中金所《操作指引》中信用报告的出具部门。我们采纳该意见，明确人民银行征信中心作为个人信用报告的权威出具机关。

有意见认为，投资者提供相关证明材料真实性很难验证，建议增加投资者对自己提供材料真实性负责的内容。股指期货适当性制度实施过程中，期货公司有审慎选择客户的义务，同时客户也有如实陈述自身情况的义务。我们采纳了这个建议。

三是为保证适当性制度的实施效果，根据有关意见，明确期货公司和从事中间介绍业务的证券公司应当在其经营场所为投资者办理股指期货开户手续，即必须临柜开户，禁止非现场开户。

没有采纳的意见主要涉及50万资金要求和综合评估程序。有意见认为50万资金门槛过高，限制了一般散户的参与。我们认为，对于高风险产品设定准入资金门槛是国际上比较成熟的做法，是对中介机构将适当的产品卖给适当的投资者的要求。资金指标可以反映投资者的经济实力，是衡量投资者风险承受能力的主要指标。设定最低资金要求可以较好地验证投资者的风险承受能力。目前沪深300股指期货合约的合约面值大约为

100 万，按 12% 的最低保证金水平，考虑期货交易的基本风险控制要求，50 万的资金门槛是合适的。

还有意见提出尽量简化综合评估的各项证明材料。我们认为，综合评估是对投资者风险承担能力的总体评估，是期货公司审慎选择客户的内在要求。综合评估效果的关键是要保证各项标准的可验证性，因此需要对相关指标提出证明材料要求。这些要求不会对适当的投资者参与构成限制，不会对真正有需求且符合条件的投资者造成障碍。

期货投资者保障基金管理暂行办法

作者：来源：

第一章 总 则

第一条 为保护期货投资者的合法权益，根据《期货交易管理条例》，制定本办法。

第二条 期货投资者保障基金（以下简称保障基金）是在期货公司严重违法违规或者风险控制不力等导致保证金出现缺口，可能严重危及社会稳定和期货市场安全时，补偿投资者保证金损失的专项基金。

第三条 期货交易活动实行公开、公平、公正和投资者投资决策自主、投资风险自担的原则。

投资者在期货投资活动中因期货市场波动或者投资品种价值本身发生变化所导致的损失，由投资者自行承担。

第四条 保障基金按照取之于市场、用之于市场的原则筹集。

第五条 保障基金由中国证监会集中管理、统筹使用。

第六条 保障基金的管理和运用遵循公开、合理、有效的原则。

第七条 保障基金的使用遵循保障投资者合法权益和公平救助原则，实行比例补偿。

第二章 保障基金的筹集

第八条 保障基金管理机构应当以保障基金名义设立资金专用账户，专户存储保障基金。

第九条 保障基金的启动资金由期货交易所从其积累的风险准备金中按照截至 2006 年 12 月 31 日风险准备金账户总额的百分之十五缴纳形成。

保障基金的后续资金来源包括：

- (一) 期货交易所按其向期货公司会员收取的交易手续费的百分之三缴纳；
- (二) 期货公司从其收取的交易手续费中按照代理交易额的千万分之五至十的比例缴纳；
- (三) 保障基金管理机构追偿或者接受的其他合法财产。

对于因财务状况恶化、风险控制不力等存在较高风险的期货公司，应当按照较高比例缴纳保障基金，各期货公司的具体缴纳比例由中国证监会根据期货公司风险状况确定。期货交易所、期货公司缴纳的保障基金在其营业成本中列支。

第十条 期货交易所应当在本办法实施之日起 1 个月内，将应当缴纳的启动资金划入保障基金专户。

期货交易所、期货公司应当按季度缴纳后续资金。期货交易所应当在每季度结束后 15 个工作日内，缴纳前一季度应当缴纳的保障基金，并按照本办法第九条确定的比例代扣代缴期货公司应当缴纳的保障基金。

第十一条 有下列情形之一的，经中国证监会、财政部批准，期货交易所、期货公司可以暂停缴纳保障基金：

- (一) 保障基金总额达到 8 亿元人民币；
- (二) 期货交易所、期货公司遭受重大突发市场风险或者不可抗力。

保障基金的规模、缴纳比例和缴纳方式，由中国证监会根据期货市场状况、市场风险水平等情况调整确定。

第十二条 鼓励保障基金来源多元化，保障基金可以接受社会捐赠和其他合法财产。

保障基金产生的利息以及运用所产生的各种收益等孳息归属保障基金。

第三章 保障基金的管理和监管

第十三条 中国证监会、财政部可以指定相关机构作为保障基金管理机构，代为管理保障基金。

第十四条 对保障基金的管理应当遵循安全、稳健的原则，保证保障基金的安全。

保障基金的资金运用限于银行存款、购买国债、中央银行债券（包括中央银行票据）和中央级金融机构发行的金融债券，以及中国证监会和财政部批准的其他资金运用方式。

第十五条 保障基金应当实行独立核算，分别管理，并与保障基金管理机构管理的其他资产有效隔离。

保障基金管理机构应当定期编报保障基金的筹集、管理、使用报告，经会计师事务所审计后，报送中国证监会和财政部。

第十六条 保障基金管理机构、期货交易所及期货公司，应当妥善保存有关保障基金的财务凭证、账簿和报表等资料，确保财务记录和档案完整、真实。

第十七条 财政部负责保障基金财务监管。保障基金的年度收支计划和决算报财政部批准。

第十八条 中国证监会负责保障基金业务监管，对保障基金的筹集、管理和使用等情况进行定期核查。

中国证监会定期向保障基金管理机构通报期货公司总体风险状况。存在较高风险的期货公司应当每月向保障基金管理机构提供财务监管报表。

第四章 保障基金的使用

第十九条 期货公司因严重违法违规或者风险控制不力等导致保证金出现缺口的，中国证监会可以按照本办法规定决定使用保障基金，对不能清偿的投资者保证金损失予以补偿。

第二十条 对期货投资者的保证金损失，保障基金按照下列原则予以补偿：

（一）对每位个人投资者的保证金损失在 10 万元以下（含 10 万元）的部分全额补偿，超过 10 万元的部分按百分之九十补偿；

（二）对每位机构投资者的保证金损失在 10 万元以下（含 10 万元）的部分全额补偿，超过 10 万元的部分按百分之八十补偿。

现有保障基金不足补偿的，由后续缴纳的保障基金补偿。

第二十一条 使用保障基金前，中国证监会和保障基金管理机构应当监督期货公司核实投资者保证金权益及损失，积极清理资产并变现处置，应当先以自有资金和变现资产弥补保证金缺口。不足弥补或者情况危急的，方能决定使用保障基金。

第二十二条 对投资者因参与非法期货交易而遭受的保证金损失，保障基金不予补偿。

对机构投资者以个人名义参与期货交易的，按照机构投资者补偿规则进行补偿。

第二十三条 动用保障基金对期货投资者的保证金损失进行补偿后，保障基金管理机构依法取得相应的受偿权，可以依法参与期货公司清算。

第二十四条 保障基金管理机构应当及时将保障基金的使用、补偿、追偿等情况报告中国证监会和财政部。

第五章 罚 则

第二十五条 期货公司因严重违法违规或者风险控制不力等导致保证金出现缺口的，中国证监会根据《期货交易管理条例》第七十条、第七十一条进行处罚，吊销期货业务许可证。涉嫌犯罪的，依法移送司法机关。

第二十六条 期货交易所、期货公司违反本办法规定，延期缴纳或者拒不缴纳保障基金以及不按规定保存、报送有关信息和资料的，中国证监会根据《期货交易管理条例》第六十八条、第七十条进行处罚。

第二十七条 对挪用、侵占、骗取保障基金的违法行为，依法查处；对有关失职人员，依法追究法律责任；涉嫌犯罪的，依法移送司法机关。

第六章 附 则

第二十八条 本办法自 2007 年 8 月 1 日起施行。

期货交易管理条例

（2007 年 2 月 7 日国务院第 168 次常务会议通过 2007 年 3 月 6 日中华人民共和国国务院令 第 489 号发布 自 2007 年 4 月 15 日起施行）

第一章 总 则

第一条 为了规范期货交易行为，加强对期货交易的监督管理，维护市场秩序，防范风险，保护期货交易各方的合法权益和社会公共利益，促进期货市场积极稳妥发展，制定本条例。

第二条 任何单位和个人从事期货交易，包括商品和金融期货合约、期权合约交易及其相关活动，应当遵守本条例。

第三条 从事期货交易活动，应当遵循公开、公平、公正和诚实信用的原则。禁止欺诈、内幕交易和操纵期货交易价格等违法行为。

第四条 期货交易应当在依法设立的期货交易所或者国务院期货监督管理机构批准的其他交易场所进行。

禁止在国务院期货监督管理机构批准的期货交易所之外进行期货交易，禁止变相期货交易。

第五条 国务院期货监督管理机构对期货市场实行集中统一的监督管理。

国务院期货监督管理机构派出机构依照本条例的有关规定和国务院期货监督管理机构的授权，履行监督管理职责。

第二章 期货交易所

第六条 设立期货交易所，由国务院期货监督管理机构审批。

未经国务院期货监督管理机构批准，任何单位或者个人不得设立期货交易所或者以任何形式组织期货交易及其相关活动。

第七条 期货交易所不以营利为目的，按照其章程的规定实行自律管理。期货交易所以其全部财产承担民事责任。期货交易所的负责人由国务院期货监督管理机构任免。

期货交易所的管理办法由国务院期货监督管理机构制定。

第八条 期货交易所会员应当是在中华人民共和国境内登记注册的企业法人或者其他经济组织。

期货交易所可以实行会员分级结算制度。实行会员分级结算制度的期货交易所会员由结算会员和非结算会员组成。

结算会员的结算业务资格由国务院期货监督管理机构批准。国务院期货监督管理机构应当在受理结算业务资格申请之日起3个月内做出批准或者不批准的决定。

第九条 有《中华人民共和国公司法》第一百四十七条规定的情形或者下列情形之一的，不得担任期货交易所的负责人、财务会计人员：

(一)因违法行为或者违纪行为被解除职务的期货交易所、证券交易所、证券登记结算机构的负责人，或者期货公司、证券公司的董事、监事、高级管理人员，以及国务院期货监督管理机构规定的其他人员，自被解除职务之日起未逾5年；

(二)因违法行为或者违纪行为被撤销资格的律师、注册会计师或者投资咨询机构、财务顾问机构、资信评级机构、资产评估机构、验证机构的专业人员，自被撤销资格之日起未逾5年。

第十条 期货交易所应当依照本条例和国务院期货监督管理机构的规定，建立、健

全各项规章制度，加强对交易活动的风险控制和会员以及交易所工作人员的监督管理。期货交易所履行下列职责：

- (一) 提供交易的场所、设施和服务；
- (二) 设计合约，安排合约上市；
- (三) 组织并监督交易、结算和交割；
- (四) 保证合约的履行；
- (五) 按照章程和交易规则对会员进行监督管理；
- (六) 国务院期货监督管理机构规定的其他职责。

期货交易所不得直接或者间接参与期货交易。未经国务院期货监督管理机构审核并报国务院批准，期货交易所不得从事信托投资、股票投资、非自用不动产投资等与其职责无关的业务。

第十一条 期货交易所应当按照国家有关规定建立、健全下列风险管理制度：

- (一) 保证金制度；
- (二) 当日无负债结算制度；
- (三) 涨跌停板制度；
- (四) 持仓限额和大户持仓报告制度；
- (五) 风险准备金制度；
- (六) 国务院期货监督管理机构规定的其他风险管理制度。

实行会员分级结算制度的期货交易所，还应当建立、健全结算担保金制度。

第十二条 当期货市场出现异常情况时，期货交易所可以按照其章程规定的权限和程序，决定采取下列紧急措施，并应当立即报告国务院期货监督管理机构：

- (一) 提高保证金；
- (二) 调整涨跌停板幅度；
- (三) 限制会员或者客户的最大持仓量；

(四)暂时停止交易;

(五)采取其他紧急措施。

前款所称异常情况,是指在交易中发生操纵期货交易价格的行为或者发生不可抗拒的突发事件以及国务院期货监督管理机构规定的其他情形。

异常情况消失后,期货交易所应当及时取消紧急措施。

第十三条 期货交易所办理下列事项,应当经国务院期货监督管理机构批准:

(一)制定或者修改章程、交易规则;

(二)上市、中止、取消或者恢复交易品种;

(三)上市、修改或者终止合约;

(四)变更住所或者营业场所;

(五)合并、分立或者解散;

(六)国务院期货监督管理机构规定的其他事项。

国务院期货监督管理机构批准期货交易所上市新的交易品种,应当征求国务院有关部门的意见。

第十四条 期货交易所的所得收益按照国家有关规定管理和使用,但应当首先用于保证期货交易场所、设施的运行和改善。

第三章 期货公司

第十五条 期货公司是依照《中华人民共和国公司法》和本条例规定设立的经营期货业务的金融机构。设立期货公司,应当经国务院期货监督管理机构批准,并在公司登记机关登记注册。

未经国务院期货监督管理机构批准,任何单位或者个人不得设立或者变相设立期货公司,经营期货业务。

第十六条 申请设立期货公司,应当符合《中华人民共和国公司法》的规定,并具备下列条件:

(一)注册资本最低限额为人民币 3000 万元;

(二)董事、监事、高级管理人员具备任职资格,从业人员具有期货从业资格;

(三)有符合法律、行政法规规定的公司章程;

(四)主要股东以及实际控制人具有持续盈利能力,信誉良好,最近3年无重大违法违规记录;

(五)有合格的经营场所和业务设施;

(六)有健全的风险管理和内部控制制度;

(七)国务院期货监督管理机构规定的其他条件。

国务院期货监督管理机构根据审慎监管原则和各项业务的风险程度,可以提高注册资本最低限额。注册资本应当是实缴资本。股东应当以货币或者期货公司经营必需的非货币财产出资,货币出资比例不得低于85%。

国务院期货监督管理机构应当在受理期货公司设立申请之日起6个月内,根据审慎监管原则进行审查,做出批准或者不批准的决定。

未经国务院期货监督管理机构批准,任何单位和个人不得委托或者接受他人委托持有或者管理期货公司的股权。

第十七条 期货公司业务实行许可制度,由国务院期货监督管理机构按照其商品期货、金融期货业务种类颁发许可证。期货公司除申请经营境内期货经纪业务外,还可以申请经营境外期货经纪、期货投资咨询以及国务院期货监督管理机构规定的其他期货业务。

期货公司不得从事与期货业务无关的活动,法律、行政法规或者国务院期货监督管理机构另有规定的除外。

期货公司不得从事或者变相从事期货自营业务。

期货公司不得为其股东、实际控制人或者其他关联人提供融资,不得对外担保。

第十八条 期货公司从事经纪业务,接受客户委托,以自己的名义为客户进行期货交易,交易结果由客户承担。

第十九条 期货公司办理下列事项,应当经国务院期货监督管理机构批准:

(一)合并、分立、停业、解散或者破产;

(二)变更公司形式;

(三)变更业务范围;

- (四) 变更注册资本;
- (五) 变更 5%以上的股权;
- (六) 设立、收购、参股或者终止境外期货类经营机构;
- (七) 国务院期货监督管理机构规定的其他事项。

前款第(四)项、第(七)项所列事项,国务院期货监督管理机构应当自受理申请之日起 20 日内做出批准或者不批准的决定;前款所列其他事项,国务院期货监督管理机构应当自受理申请之日起 2 个月内做出批准或者不批准的决定。

第二十条 期货公司办理下列事项,应当经国务院期货监督管理机构派出机构批准:

- (一) 变更法定代表人;
- (二) 变更住所或者营业场所;
- (三) 设立或者终止境内分支机构;
- (四) 变更境内分支机构的营业场所、负责人或者经营范围;
- (五) 国务院期货监督管理机构规定的其他事项。

前款第(一)项、第(二)项、第(四)项、第(五)项所列事项,国务院期货监督管理机构派出机构应当自受理申请之日起 20 日内做出批准或者不批准的决定;前款第(三)项所列事项,国务院期货监督管理机构派出机构应当自受理申请之日起 2 个月内做出批准或者不批准的决定。

第二十一条 期货公司或者其分支机构有《中华人民共和国行政许可法》第七十条规定的情形或者下列情形之一的,国务院期货监督管理机构应当依法办理期货业务许可证注销手续:

- (一) 营业执照被公司登记机关依法注销;
- (二) 成立后无正当理由超过 3 个月未开始营业,或者开业后无正当理由停业连续 3 个月以上;
- (三) 主动提出注销申请;
- (四) 国务院期货监督管理机构规定的其他情形。

期货公司在注销期货业务许可证前，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。期货公司分支机构在注销经营许可证前，应当终止经营活动，妥善处理客户资产。

第二十二条 期货公司应当建立、健全并严格执行业务管理规则、风险管理制度，遵守信息披露制度，保障客户保证金的存管安全，按照期货交易所的规定，向期货交易所报告大户名单、交易情况。

第二十三条 从事期货投资咨询以及为期货公司提供中间介绍等业务的其他期货经营机构，应当取得国务院期货监督管理机构批准的业务资格，具体管理办法由国务院期货监督管理机构制定。

第四章 期货交易基本规则

第二十四条 在期货交易所进行期货交易的，应当是期货交易所会员。

第二十五条 期货公司接受客户委托为其进行期货交易，应当事先向客户出示风险说明书，经客户签字确认后，与客户签订书面合同。期货公司不得未经客户委托或者不按照客户委托内容，擅自进行期货交易。

期货公司不得向客户做获利保证；不得在经纪业务中与客户约定分享利益或者共担风险。

第二十六条 下列单位和个人不得从事期货交易，期货公司不得接受其委托为其进行期货交易：

- (一) 国家机关和事业单位；
- (二) 国务院期货监督管理机构、期货交易所、期货保证金安全存管监控机构和期货业协会的工作人员；
- (三) 证券、期货市场禁止进入者；
- (四) 未能提供开户证明材料的单位和个人；
- (五) 国务院期货监督管理机构规定不得从事期货交易的其他单位和个人。

第二十七条 客户可以通过书面、电话、互联网或者国务院期货监督管理机构规定的其他方式，向期货公司下达交易指令。客户的交易指令应当明确、全面。

期货公司不得隐瞒重要事项或者使用其他不正当手段诱骗客户发出交易指令。

第二十八条 期货交易所应当及时公布上市品种合约的成交量、成交价、持仓量、最高价与最低价、开盘价与收盘价和其他应当公布的即时行情，并保证即时行情的真实、

准确。期货交易所不得发布价格预测信息。

未经期货交易所许可，任何单位和个人不得发布期货交易即时行情。

第二十九条 期货交易应当严格执行保证金制度。期货交易所向会员、期货公司向客户收取的保证金，不得低于国务院期货监督管理机构、期货交易所规定的标准，并应当与自有资金分开，专户存放。

期货交易所向会员收取的保证金，属于会员所有，除用于会员的交易结算外，严禁挪作他用。

期货公司向客户收取的保证金，属于客户所有，除下列可划转的情形外，严禁挪作他用：

- (一) 依据客户的要求支付可用资金；
- (二) 为客户交存保证金，支付手续费、税款；
- (三) 国务院期货监督管理机构规定的其他情形。

第三十条 期货公司应当为每一个客户单独开立专门账户、设置交易编码，不得混码交易。

第三十一条 期货公司经营期货经纪业务又同时经营其他期货业务的，应当严格执行业务分离和资金分离制度，不得混合操作。

第三十二条 期货交易所会员、客户可以使用标准仓单、国债等价值稳定、流动性强的有价证券充抵保证金进行期货交易。有价证券的种类、价值的计算方法和充抵保证金的比例等，由国务院期货监督管理机构规定。

第三十三条 银行业金融机构从事期货保证金存管、期货结算业务的资格，经国务院银行业监督管理机构审核同意后，由国务院期货监督管理机构批准。

第三十四条 期货交易所、期货公司、非期货公司结算会员应当按照国务院期货监督管理机构、财政部门的规定提取、管理和使用风险准备金，不得挪用。

第三十五条 期货交易的收费项目、收费标准和管理办法由国务院有关主管部门统一制定并公布。

第三十六条 期货交易应当采用公开的集中交易方式或者国务院期货监督管理机构批准的其他方式。

第三十七条 期货交易的结算，由期货交易所统一组织进行。

期货交易所实行当日无负债结算制度。期货交易所应当在当日及时将结算结果通知会员。

期货公司根据期货交易所的结算结果对客户进行结算，并应当将结算结果按照与客户约定的方式及时通知客户。客户应当及时查询并妥善处理自己的交易持仓。

第三十八条 期货交易所会员的保证金不足时，应当及时追加保证金或者自行平仓。会员未在期货交易所规定的时间内追加保证金或者自行平仓的，期货交易所应当将该会员的合约强行平仓，强行平仓的有关费用和发生的损失由该会员承担。

客户保证金不足时，应当及时追加保证金或者自行平仓。客户未在期货公司规定的时间内及时追加保证金或者自行平仓的，期货公司应当将该客户的合约强行平仓，强行平仓的有关费用和发生的损失由该客户承担。

第三十九条 期货交易的交割，由期货交易所统一组织进行。

交割仓库由期货交易所指定。期货交易所不得限制实物交割总量，并应当与交割仓库签订协议，明确双方的权利和义务。交割仓库不得有下列行为：

- (一) 出具虚假仓单；
- (二) 违反期货交易所业务规则，限制交割商品的入库、出库；
- (三) 泄露与期货交易有关的商业秘密；
- (四) 违反国家有关规定参与期货交易；
- (五) 国务院期货监督管理机构规定的其他行为。

第四十条 会员在期货交易中违约的，期货交易所先以该会员的保证金承担违约责任；保证金不足的，期货交易所应当以风险准备金和自有资金代为承担违约责任，并由此取得对该会员的相应追偿权。

客户在期货交易中违约的，期货公司先以该客户的保证金承担违约责任；保证金不足的，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，并由此取得对该客户的相应追偿权。

第四十一条 实行会员分级结算制度的期货交易所，应当向结算会员收取结算担保金。期货交易所只对结算会员结算，收取和追收保证金，以结算担保金、风险准备金、自有资金代为承担违约责任，以及采取其他相关措施；对非结算会员的结算、收取和追收保证金、代为承担违约责任，以及采取其他相关措施，由结算会员执行。

第四十二条 期货交易所、期货公司和非期货公司结算会员应当保证期货交易、结算、交割资料的完整和安全。

第四十三条 任何单位或者个人不得编造、传播有关期货交易的虚假信息，不得恶意串通、联手买卖或者以其他方式操纵期货交易价格。

第四十四条 任何单位或者个人不得违规使用信贷资金、财政资金进行期货交易。

银行业金融机构从事期货交易融资或者担保业务的资格，由国务院银行业监督管理机构批准。

第四十五条 国有以及国有控股企业进行境内外期货交易，应当遵循套期保值的原则，严格遵守国务院国有资产监督管理机构以及其他有关部门关于企业以国有资产进入期货市场的有关规定。

第四十六条 国务院商务主管部门对境内单位或者个人从事境外商品期货交易的品种进行核准。

境外期货项下购汇、结汇以及外汇收支，应当符合国家外汇管理有关规定。

境内单位或者个人从事境外期货交易的办法，由国务院期货监督管理机构会同国务院商务主管部门、国有资产监督管理机构、银行业监督管理机构、外汇管理部门等有关部门制订，报国务院批准后施行。

第五章 期货业协会

第四十七条 期货业协会是期货业的自律性组织，是社会团体法人。

期货公司以及其他专门从事期货经营的机构应当加入期货业协会，并缴纳会员费。

第四十八条 期货业协会的权力机构为全体会员组成的会员大会。

期货业协会的章程由会员大会制定，并报国务院期货监督管理机构备案。

期货业协会设理事会。理事会成员按照章程的规定选举产生。

第四十九条 期货业协会履行下列职责：

(一) 教育和组织会员遵守期货法律法规和政策；

(二) 制定会员应当遵守的行业自律性规则，监督、检查会员行为，对违反协会章程和自律性规则的，按照规定给予纪律处分；

(三) 负责期货从业人员资格的认定、管理以及撤销工作；

(四) 受理客户与期货业务有关的投诉，对会员之间、会员与客户之间发生的纠纷进

行调解；

(五) 依法维护会员的合法权益，向国务院期货监督管理机构反映会员的建议和要求；

(六) 组织期货从业人员的业务培训，开展会员间的业务交流；

(七) 组织会员就期货业的发展、运作以及有关内容进行研究；

(八) 期货业协会章程规定的其他职责。

期货业协会的业务活动应当接受国务院期货监督管理机构的指导和监督。

第六章 监督管理

第五十条 国务院期货监督管理机构对期货市场实施监督管理，依法履行下列职责：

(一) 制定有关期货市场监督管理的规章、规则，并依法行使审批权；

(二) 对品种的上市、交易、结算、交割等期货交易及其相关活动，进行监督管理；

(三) 对期货交易所、期货公司及其他期货经营机构、非期货公司结算会员、期货保证金安全存管监控机构、期货保证金存管银行、交割仓库等市场相关参与者的期货业务活动，进行监督管理；

(四) 制定期货从业人员的资格标准和管理办法，并监督实施；

(五) 监督检查期货交易的信息公开情况；

(六) 对期货业协会的活动进行指导和监督；

(七) 对违反期货市场监督管理法律、行政法规的行为进行查处；

(八) 开展与期货市场监督管理有关的国际交流、合作活动；

(九) 法律、行政法规规定的其他职责。

第五十一条 国务院期货监督管理机构依法履行职责，可以采取下列措施：

(一) 对期货交易所、期货公司及其他期货经营机构、非期货公司结算会员、期货保证金安全存管监控机构和交割仓库进行现场检查；

(二) 进入涉嫌违法行为发生场所调查取证；

(三) 询问当事人和与被调查事件有关的单位和个人, 要求其对与被调查事件有关的事项做出说明;

(四) 查阅、复制与被调查事件有关的财产权登记等资料;

(五) 查阅、复制当事人和与被调查事件有关的单位和个人的期货交易记录、财务会计资料以及其他相关文件和资料; 对可能被转移、隐匿或者毁损的文件和资料, 可以予以封存;

(六) 查询与被调查事件有关的单位的保证金账户和银行账户;

(七) 在调查操纵期货交易价格、内幕交易等重大期货违法行为时, 经国务院期货监督管理机构主要负责人批准, 可以限制被调查事件当事人的期货交易, 但限制的时间不得超过 15 个交易日; 案情复杂的, 可以延长至 30 个交易日;

(八) 法律、行政法规规定的其他措施。

第五十二条 期货交易所、期货公司及其他期货经营机构、期货保证金安全存管监控机构, 应当向国务院期货监督管理机构报送财务会计报告、业务资料和其他有关资料。

对期货公司及其他期货经营机构报送的年度报告, 国务院期货监督管理机构应当指定专人进行审核, 并制作审核报告。审核人员应当在审核报告上签字。审核中发现问题的, 国务院期货监督管理机构应当及时采取相应措施。

必要时, 国务院期货监督管理机构可以要求非期货公司结算会员、交割仓库, 以及期货公司股东、实际控制人或者其他关联人报送相关资料。

第五十三条 国务院期货监督管理机构依法履行职责, 进行监督检查或者调查时, 被检查、调查的单位和个人应当配合, 如实提供有关文件和资料, 不得拒绝、阻碍和隐瞒; 其他有关部门和单位应当给予支持和配合。

第五十四条 国家根据期货市场发展的需要, 设立期货投资者保障基金。

期货投资者保障基金的筹集、管理和使用的具体办法, 由国务院期货监督管理机构会同国务院财政部门制定。

第五十五条 国务院期货监督管理机构应当建立、健全保证金安全存管监控制度, 设立期货保证金安全存管监控机构。

客户和期货交易所、期货公司及其他期货经营机构、非期货公司结算会员以及期货保证金存管银行, 应当遵守国务院期货监督管理机构有关保证金安全存管监控的规定。

第五十六条 期货保证金安全存管监控机构依照有关规定对保证金安全实施监控,

进行每日稽核，发现问题应当立即报告国务院期货监督管理机构。国务院期货监督管理机构应当根据不同情况，依照本条例有关规定及时处理。

第五十七条 国务院期货监督管理机构对期货交易所、期货公司及其他期货经营机构和期货保证金安全存管监控机构的董事、监事、高级管理人员以及其他期货从业人员，实行资格管理制度。

第五十八条 国务院期货监督管理机构应当制定期货公司持续性经营规则，对期货公司的净资本与净资产的比例，净资本与境内期货经纪、境外期货经纪等业务规模的比例，流动资产与流动负债的比例等风险监管指标做出规定；对期货公司及其分支机构的经营条件、风险管理、内部控制、保证金存管、关联交易等方面提出要求。

第五十九条 期货公司及其分支机构不符合持续性经营规则或者出现经营风险的，国务院期货监督管理机构可以对期货公司及其董事、监事和高级管理人员采取谈话、提示、记入信用记录等监管措施或者责令期货公司限期整改，并对其整改情况进行检查验收。

期货公司逾期未改正，其行为严重危及期货公司的稳健运行、损害客户合法权益，或者涉嫌严重违法违规正在被国务院期货监督管理机构调查的，国务院期货监督管理机构可以区别情形，对其采取下列措施：

- (一) 限制或者暂停部分期货业务；
- (二) 停止批准新增业务或者分支机构；
- (三) 限制分配红利，限制向董事、监事、高级管理人员支付报酬、提供福利；
- (四) 限制转让财产或者在财产上设定其他权利；
- (五) 责令更换董事、监事、高级管理人员或者有关业务部门、分支机构的负责人员，或者限制其权利；
- (六) 限制期货公司自有资金或者风险准备金的调拨和使用；
- (七) 责令控股股东转让股权或者限制有关股东行使股东权利。

对经过整改符合有关法律、行政法规规定以及持续性经营规则要求的期货公司，国务院期货监督管理机构应当自验收完毕之日起 3 日内解除对其采取的有关措施。

对经过整改仍未达到持续性经营规则要求，严重影响正常经营的期货公司，国务院期货监督管理机构有权撤销其部分或者全部期货业务许可、关闭其分支机构。

第六十条 期货公司违法经营或者出现重大风险，严重危害期货市场秩序、损害客户利益的，国务院期货监督管理机构可以对该期货公司采取责令停业整顿、指定其他机

构托管或者接管等监管措施。经国务院期货监督管理机构批准，可以对该期货公司直接负责的董事、监事、高级管理人员和其他直接责任人员采取以下措施：

(一)通知出境管理机关依法阻止其出境；

(二)申请司法机关禁止其转移、转让或者以其他方式处分财产，或者在财产上设定其他权利。

第六十一条 期货公司的股东有虚假出资或者抽逃出资行为的，国务院期货监督管理机构应当责令其限期改正，并可责令其转让所持期货公司的股权。

在股东按照前款要求改正违法行为、转让所持期货公司的股权前，国务院期货监督管理机构可以限制其股东权利。

第六十二条 当期货市场出现异常情况时，国务院期货监督管理机构可以采取必要的风险处置措施。

第六十三条 期货公司的交易软件、结算软件，应当满足期货公司审慎经营和风险管理以及国务院期货监督管理机构有关保证金安全存管监控规定的要求。期货公司的交易软件、结算软件不符合要求的，国务院期货监督管理机构有权要求期货公司予以改进或者更换。

国务院期货监督管理机构可以要求期货公司的交易软件、结算软件的供应商提供该软件的相关资料，供应商应当予以配合。国务院期货监督管理机构对供应商提供的相关资料负有保密义务。

第六十四条 期货公司涉及重大诉讼、仲裁，或者股权被冻结或者用于担保，以及发生其他重大事件时，期货公司及其相关股东、实际控制人应当自该事件发生之日起5日内向国务院期货监督管理机构提交书面报告。

第六十五条 会计师事务所、律师事务所、资产评估机构等中介服务机构向期货交易所和期货公司等市场相关参与者提供相关服务时，应当遵守期货法律、行政法规以及国家有关规定，并按照国务院期货监督管理机构的要求提供相关资料。

第六十六条 国务院期货监督管理机构应当与有关部门建立监督管理的信息共享和协调配合机制。

国务院期货监督管理机构可以和其他国家或者地区的期货监督管理机构建立监督管理合作机制，实施跨境监督管理。

第六十七条 国务院期货监督管理机构、期货交易所、期货保证金安全存管监控机构和期货保证金存管银行等相关单位的工作人员，应当忠于职守，依法办事，公正廉洁，保守国家秘密和有关当事人的商业秘密，不得利用职务便利牟取不正当的利益。

第七章 法律责任

第六十八条 期货交易所、非期货公司结算会员有下列行为之一的，责令改正，给予警告，没收违法所得：

- (一) 违反规定接纳会员的；
- (二) 违反规定收取手续费的；
- (三) 违反规定使用、分配收益的；
- (四) 不按照规定公布即时行情的，或者发布价格预测信息的；
- (五) 不按照规定向国务院期货监督管理机构履行报告义务的；
- (六) 不按照规定向国务院期货监督管理机构报送有关文件、资料的；
- (七) 不按照规定建立、健全结算担保金制度的；
- (八) 不按照规定提取、管理和使用风险准备金的；
- (九) 违反国务院期货监督管理机构有关保证金安全存管监控规定的；
- (十) 限制会员实物交割总量的；
- (十一) 任用不具备资格的期货从业人员的；
- (十二) 违反国务院期货监督管理机构规定的其他行为。

有前款所列行为之一的，对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予纪律处分，处1万元以上10万元以下的罚款。

有本条第一款第(二)项所列行为的，应当责令退还多收取的手续费。

期货保证金安全存管监控机构有本条第一款第(五)项、第(六)项、第(九)项、第(十一)项、第(十二)项所列行为的，依照本条第一款、第二款的规定处罚、处分。期货保证金存管银行有本条第一款第(九)项、第(十二)项所列行为的，依照本条第一款、第二款的规定处罚、处分。

第六十九条 期货交易所、非期货公司结算会员有下列行为之一的，责令改正，给予警告，没收违法所得，并处违法所得1倍以上5倍以下的罚款；没有违法所得或者违法所得不满10万元的，并处10万元以上50万元以下的罚款；情节严重的，责令停业整顿：

- (一) 未经批准，擅自办理本条例第十三条所列事项的；
- (二) 允许会员在保证金不足的情况下进行期货交易的；
- (三) 直接或者间接参与期货交易，或者违反规定从事与其职责无关的业务；
- (四) 违反规定收取保证金，或者挪用保证金的；
- (五) 伪造、涂改或者不按照规定保存期货交易、结算、交割资料的；
- (六) 未建立或者未执行当日无负债结算、涨跌停板、持仓限额和大户持仓报告制度的；
- (七) 拒绝或者妨碍国务院期货监督管理机构监督检查的；
- (八) 违反国务院期货监督管理机构规定的其他行为。

有前款所列行为之一的，对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予纪律处分，处1万元以上10万元以下的罚款。

期货保证金安全存管监控机构有本条第一款第(三)项、第(七)项、第(八)项所列行为的，依照本条第一款、第二款的规定处罚、处分。

第七十条 期货公司有下列行为之一的，责令改正，给予警告，没收违法所得，并处违法所得1倍以上3倍以下的罚款；没有违法所得或者违法所得不满10万元的，并处10万元以上30万元以下的罚款；情节严重的，责令停业整顿或者吊销期货业务许可证：

- (一) 接受不符合规定条件的单位或者个人委托的；
- (二) 允许客户在保证金不足的情况下进行期货交易的；
- (三) 未经批准，擅自办理本条例第十九条、第二十条所列事项的；
- (四) 违反规定从事与期货业务无关的活动的；
- (五) 从事或者变相从事期货自营业务的；
- (六) 为其股东、实际控制人或者其他关联人提供融资，或者对外担保的；
- (七) 违反国务院期货监督管理机构有关保证金安全存管监控规定的；
- (八) 不按照规定向国务院期货监督管理机构履行报告义务或者报送有关文件、资料的；

(九)交易软件、结算软件不符合期货公司审慎经营和风险管理以及国务院期货监督管理机构有关保证金安全存管监控规定的要求的；

(十)不按照规定提取、管理和使用风险准备金的；

(十一)伪造、涂改或者不按照规定保存期货交易、结算、交割资料的；

(十二)任用不具备资格的期货从业人员的；

(十三)伪造、变造、出租、出借、买卖期货业务许可证或者经营许可证的；

(十四)进行混码交易的；

(十五)拒绝或者妨碍国务院期货监督管理机构监督检查的；

(十六)违反国务院期货监督管理机构规定的其他行为。

期货公司有前款所列行为之一的，对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予警告，并处1万元以上5万元以下的罚款；情节严重的，暂停或者撤销任职资格、期货从业人员资格。

期货公司之外的其他期货经营机构有本条第一款第(八)项、第(十二)项、第(十三)项、第(十五)项、第(十六)项所列行为的，依照本条第一款、第二款的规定处罚。

期货公司的股东、实际控制人或者其他关联人未经批准擅自委托他人或者接受他人委托持有或者管理期货公司股权的，拒不配合国务院期货监督管理机构的检查，拒不按照规定履行报告义务、提供有关信息和资料，或者报送、提供的信息和资料有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏的，依照本条第一款、第二款的规定处罚。

第七十一条 期货公司有下列欺诈客户行为之一的，责令改正，给予警告，没收违法所得，并处违法所得1倍以上5倍以下的罚款；没有违法所得或者违法所得不满10万元的，并处10万元以上50万元以下的罚款；情节严重的，责令停业整顿或者吊销期货业务许可证：

(一)向客户做获利保证或者不按照规定向客户出示风险说明书的；

(二)在经纪业务中与客户约定分享利益、共担风险的；

(三)不按照规定接受客户委托或者不按照客户委托内容擅自进行期货交易的；

(四)隐瞒重要事项或者使用其他不正当手段，诱骗客户发出交易指令的；

(五)向客户提供虚假成交回报的；

(六) 未将客户交易指令下达到期货交易所的；

(七) 挪用客户保证金的；

(八) 不按照规定在期货保证金存管银行开立保证金账户，或者违规划转客户保证金的；

(九) 国务院期货监督管理机构规定的其他欺诈客户的行为。

期货公司有前款所列行为之一的，对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予警告，并处1万元以上10万元以下的罚款；情节严重的，暂停或者撤销任职资格、期货从业人员资格。

任何单位或者个人编造并且传播有关期货交易的虚假信息，扰乱期货交易市场的，依照本条第一款、第二款的规定处罚。

第七十二条 期货公司及其他期货经营机构、非期货公司结算会员、期货保证金存管银行提供虚假申请文件或者采取其他欺诈手段隐瞒重要事实骗取期货业务许可的，撤销其期货业务许可，没收违法所得。

第七十三条 期货交易内幕信息的知情人或者非法获取期货交易内幕信息的人，在对期货交易价格有重大影响的信息尚未公开前，利用内幕信息从事期货交易，或者向他人泄露内幕信息，使他人利用内幕信息进行期货交易的，没收违法所得，并处违法所得1倍以上5倍以下的罚款；没有违法所得或者违法所得不满10万元的，处10万元以上50万元以下的罚款。单位从事内幕交易的，还应当对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予警告，并处3万元以上30万元以下的罚款。

国务院期货监督管理机构、期货交易所和期货保证金安全存管监控机构的工作人员进行内幕交易的，从重处罚。

第七十四条 任何单位或者个人有下列行为之一，操纵期货交易价格的，责令改正，没收违法所得，并处违法所得1倍以上5倍以下的罚款；没有违法所得或者违法所得不满20万元的，处20万元以上100万元以下的罚款：

(一) 单独或者合谋，集中资金优势、持仓优势或者利用信息优势联合或者连续买卖合约，操纵期货交易价格的；

(二) 蓄意串通，按事先约定的时间、价格和方式相互进行期货交易，影响期货交易价格或者期货交易量的；

(三) 以自己为交易对象，自买自卖，影响期货交易价格或者期货交易量的；

(四) 为影响期货市场行情囤积现货的；

(五) 国务院期货监督管理机构规定的其他操纵期货交易价格的行为。

单位有前款所列行为之一的，对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予警告，并处1万元以上10万元以下的罚款。

第七十五条 交割仓库有本条例第三十九条第二款所列行为之一的，责令改正，给予警告，没收违法所得，并处违法所得1倍以上5倍以下的罚款；没有违法所得或者违法所得不满10万元的，并处10万元以上50万元以下的罚款；情节严重的，责令期货交易所暂停或者取消其交割仓库资格。对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予警告，并处1万元以上10万元以下的罚款。

第七十六条 国有以及国有控股企业违反本条例和国务院国有资产监督管理机构以及其他有关部门关于企业以国有资产进入期货市场的有关规定进行期货交易，或者单位、个人违规使用信贷资金、财政资金进行期货交易的，给予警告，没收违法所得，并处违法所得1倍以上5倍以下的罚款；没有违法所得或者违法所得不满10万元的，并处10万元以上50万元以下的罚款。对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予降级直至开除的纪律处分。

第七十七条 境内单位或者个人违反规定从事境外期货交易的，责令改正，给予警告，没收违法所得，并处违法所得1倍以上5倍以下的罚款；没有违法所得或者违法所得不满20万元的，并处20万元以上100万元以下的罚款；情节严重的，暂停其境外期货交易。对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予警告，并处1万元以上10万元以下的罚款。

第七十八条 任何单位或者个人非法设立或者变相设立期货交易所、期货公司及其他期货经营机构，或者擅自从事期货业务，或者组织变相期货交易活动的，予以取缔，没收违法所得，并处违法所得1倍以上5倍以下的罚款；没有违法所得或者违法所得不满20万元的，处20万元以上100万元以下的罚款。对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予警告，并处1万元以上10万元以下的罚款。

第七十九条 期货公司的交易软件、结算软件供应商拒不配合国务院期货监督管理机构调查，或者未按照规定向国务院期货监督管理机构提供相关软件资料，或者提供的软件资料有虚假、重大遗漏的，责令改正，处3万元以上10万元以下的罚款。对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予警告，并处1万元以上5万元以下的罚款。

第八十条 会计师事务所、律师事务所、资产评估机构等中介服务机构未勤勉尽责，所出具的文件有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏的，责令改正，没收业务收入，暂停或者撤销相关业务许可，并处业务收入1倍以上5倍以下的罚款。对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予警告，并处3万元以上10万元以下的罚款。

第八十一条 任何单位或者个人违反本条例规定，情节严重的，由国务院期货监督管理机构宣布该个人、该单位或者该单位的直接责任人员为期货市场禁止进入者。

第八十二条 国务院期货监督管理机构、期货交易所、期货保证金安全存管监控机构和期货保证金存管银行等相关单位的工作人员，泄露知悉的国家秘密或者会员、客户商业秘密，或者徇私舞弊、玩忽职守、滥用职权、收受贿赂的，依法给予行政处分或者纪律处分。

第八十三条 违反本条例规定，构成犯罪的，依法追究刑事责任。

第八十四条 对本条例规定的违法行为的行政处罚，由国务院期货监督管理机构决定；涉及其他有关部门法定职权的，国务院期货监督管理机构应当会同其他有关部门处理；属于其他有关部门法定职权的，国务院期货监督管理机构应当移交其他有关部门处理。

第八章 附 则

第八十五条 本条例下列用语的含义：

(一) 期货合约，是指由期货交易所统一制定的、规定在将来某一特定的时间和地点交割一定数量标的物的标准化合约。根据合约标的物的不同，期货合约分为商品期货合约和金融期货合约。商品期货合约的标的物包括农产品、工业品、能源和其他商品及其相关指数产品；金融期货合约的标的物包括有价证券、利率、汇率等金融产品及其相关指数产品。

(二) 期权合约，是指由期货交易所统一制定的、规定买方有权在将来某一时间以特定价格买入或者卖出约定标的物(包括期货合约)的标准化合约。

(三) 保证金，是指期货交易者按照规定标准交纳的资金，用于结算和保证履约。

(四) 结算，是指根据期货交易所公布的结算价格对交易双方的交易盈亏状况进行的资金清算和划转。

(五) 交割，是指合约到期时，按照期货交易所的规则和程序，交易双方通过该合约所载标的物所有权的转移，或者按照规定结算价格进行现金差价结算，了结到期未平仓合约的过程。

(六) 平仓，是指期货交易者买入或者卖出与其所持合约的品种、数量和交割月份相同但交易方向相反的合约，了结期货交易的行为。

(七) 持仓量，是指期货交易者所持有的未平仓合约的数量。

(八) 持仓限额，是指期货交易所对期货交易者的持仓量规定的最高数额。

(九) 仓单，是指交割仓库开具并经期货交易所认定的标准化提货凭证。

(十) 涨跌停板，是指合约在 1 个交易日中的交易价格不得高于或者低于规定的涨跌

幅度，超出该涨跌幅度的报价将被视为无效，不能成交。

(十一)内幕信息，是指可能对期货交易价格产生重大影响的尚未公开的信息，包括：国务院期货监督管理机构以及其他相关部门制定的对期货交易价格可能发生重大影响的政策，期货交易所做出的可能对期货交易价格发生重大影响的决定，期货交易所会员、客户的资金和交易动向以及国务院期货监督管理机构认定的对期货交易价格有显著影响的其他重要信息。

(十二)内幕信息的知情人员，是指由于其管理地位、监督地位或者职业地位，或者作为雇员、专业顾问履行职务，能够接触或者获得内幕信息的人员，包括：期货交易所的管理人员以及其他由于任职可获取内幕信息的从业人员，国务院期货监督管理机构和其他有关部门的工作人员以及国务院期货监督管理机构规定的其他人员。

第八十六条 国务院期货监督管理机构可以批准设立期货专门结算机构，专门履行期货交易所的结算以及相关职责，并承担相应法律责任。

第八十七条 境外机构在境内设立、收购或者参股期货经营机构，以及境外期货经营机构在境内设立分支机构(含代表处)的管理办法，由国务院期货监督管理机构会同国务院商务主管部门、外汇管理部门等有关部门制订，报国务院批准后施行。

第八十八条 在期货交易所之外的国务院期货监督管理机构批准的交易场所进行的期货交易，依照本条例的有关规定执行。

第八十九条 任何机构或者市场，未经国务院期货监督管理机构批准，采用集中交易方式进行标准化合约交易，同时采用以下交易机制或者具备以下交易机制特征之一的，为变相期货交易：

(一)为参与集中交易的所有买方和卖方提供履约担保的；

(二)实行当日无负债结算制度和保证金制度，同时保证金收取比例低于合约(或者合同)标的额 20%的。

本条例施行前采用前款规定的交易机制或者具备前款规定的交易机制特征之一的机构或者市场，应当在国务院商务主管部门规定的期限内进行整改。

第九十条 不属于期货交易的商品或者金融产品的其他交易活动，由国家有关部门监督管理，不适用本条例。

第九十一条 本条例自 2007 年 4 月 15 日起施行。1999 年 6 月 2 日国务院发布的《期货交易管理暂行条例》同时废止。

期货交易所管理办法

作者：来源：

中国证券监督管理委员会令（第 42 号） 2007 年 4 月 9 日发布，自 2007 年 4 月 15 日起施行。

第一章 总则

第一条 为了加强对期货交易所的监督管理，明确期货交易所职责，维护期货市场秩序，促进期货市场积极稳妥发展，根据《期货交易管理条例》，制定本办法。

第二条 本办法适用于在中华人民共和国境内设立的期货交易所。

第三条 本办法所称期货交易所是指依照《期货交易管理条例》和本办法规定设立，不以营利为目的，履行《期货交易管理条例》和本办法规定的职责，按照章程和交易规则实行自律管理的法人。

第四条 经中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）批准，期货交易所可以采取会员制或者公司制的组织形式。

会员制期货交易所的注册资本划分为均等份额，由会员出资认缴。

公司制期货交易所采用股份有限公司的组织形式。

第五条 中国证监会依法对期货交易所实行集中统一的监督管理。

第二章 设立、变更与终止

第六条 设立期货交易所，由中国证监会审批。未经批准，任何单位或者个人不得设立期货交易所或者以任何形式组织期货交易及其相关活动。

第七条 经中国证监会批准设立的期货交易所，应当标明“商品交易所”或者“期货交易所”字样。其他任何单位或者个人不得使用期货交易所或者近似的名称。

第八条 期货交易所除履行《期货交易管理条例》规定的职责外，还应当履行下列职责：

(一) 制定并实施期货交易所的交易规则及其实施细则；

(二) 发布市场信息；

(三) 监管会员及其客户、指定交割仓库、期货保证金存管银行及期货市场其他参与者的期货业务；

(四) 查处违规行为。

第九条 申请设立期货交易所，应当向中国证监会提交下列文件和材料：

(一) 申请书；

(二) 章程和交易规则草案；

(三) 期货交易所的经营计划；

(四) 拟加入会员或者股东名单；

(五) 理事会成员候选人或者董事会和监事会成员名单及简历；

(六) 拟任用高级管理人员的名单及简历；

(七) 场地、设备、资金证明文件及情况说明；

(八) 中国证监会规定的其他文件、材料。

第十条 期货交易所章程应当载明下列事项：

(一) 设立目的和职责；

(二) 名称、住所和营业场所；

(三) 注册资本及其构成；

(四) 营业期限；

(五) 组织机构的组成、职责、任期和议事规则；

(六) 管理人员的产生、任免及其职责；

(七) 基本业务制度；

(八) 风险准备金管理制度；

- (九) 财务会计、内部控制制度；
- (十) 变更、终止的条件、程序及清算办法；
- (十一) 章程修改程序；
- (十二) 需要在章程中规定的其他事项。

第十一条 除本办法第十条规定的事项外，会员制期货交易所章程还应当载明下列事项：

- (一) 会员资格及其管理办法；
- (二) 会员的权利和义务；
- (三) 对会员的纪律处分。

第十二条 期货交易所交易规则应当载明下列事项：

- (一) 期货交易、结算和交割制度；
- (二) 风险管理制度和交易异常情况的处理程序；
- (三) 保证金的管理和使用制度；
- (四) 期货交易信息的发布办法；
- (五) 违规、违约行为及其处理办法；
- (六) 交易纠纷的处理方式；
- (七) 需要在交易规则中载明的其他事项。

公司制期货交易所还应当在交易规则中载明本办法第十一条规定的事项。

第十三条 期货交易所变更名称、注册资本的，应当经中国证监会批准。

第十四条 期货交易所的合并、分立，由中国证监会批准。

期货交易所合并可以采取吸收合并和新设合并两种方式，合并前各方的债权、债务由合并后存续或者新设的期货交易所承继。

期货交易所分立的，其债权、债务由分立后的期货交易所承继。

第十五条 期货交易所联网交易的，应当于决定之日起10日内报告中国证监会。

第十六条 未经中国证监会批准，期货交易所不得设立分所或者其他任何期货交易所场所。

第十七条 期货交易所因下列情形之一解散：

- (一) 章程规定的营业期限届满；
- (二) 会员大会或者股东大会决定解散；
- (三) 中国证监会决定关闭。

期货交易所因前款第(一)项、第(二)项情形解散的，由中国证监会批准。

第十八条 期货交易所因合并、分立或者解散而终止的，由中国证监会予以公告。

期货交易所终止的，应当成立清算组进行清算。清算组制定的清算方案，应当报中国证监会批准。

第三章 组织机构

第一节 会员制期货交易所

第十九条 会员制期货交易所设会员大会。会员大会是期货交易所的权力机构，由全体会员组成。

第二十条 会员大会行使下列职权：

- (一) 审定期货交易所章程、交易规则及其修改草案；
- (二) 选举和更换会员理事；
- (三) 审议批准理事会和总经理的工作报告；
- (四) 审议批准期货交易所的财务预算方案、决算报告；
- (五) 审议期货交易所风险准备金使用情况；
- (六) 决定增加或者减少期货交易所注册资本；
- (七) 决定期货交易所的合并、分立、解散和清算事项；

(八) 决定期货交易所理事会提交的其他重大事项；

(九) 期货交易所章程规定的其他职权。

第二十一条 会员大会由理事会召集，每年召开一次。

有下列情形之一的，应当召开临时会员大会：

(一) 会员理事不足期货交易所章程规定人数的 $2/3$ ；

(二) $1/3$ 以上会员联名提议；

(三) 理事会认为必要。

第二十二条 会员大会由理事长主持。召开会员大会，应当将会议审议的事项于会议召开 10 日前通知会员。临时会员大会不得对通知中未列明的事项作出决议。

第二十三条 会员大会应有 $2/3$ 以上会员参加方为有效。会员大会应当对表决事项制作会议纪要，由出席会议的理事签名。

会员大会结束之日起 10 日内，期货交易所应当将大会全部文件报告中国证监会。

第二十四条 期货交易所设理事会，每届任期 3 年。理事会是会员大会的常设机构，对会员大会负责。

第二十五条 理事会行使下列职权：

(一) 召集会员大会，并向会员大会报告工作；

(二) 拟订期货交易所章程、交易规则及其修改草案，提交会员大会审定；

(三) 审议总经理提出的财务预算方案、决算报告，提交会员大会通过；

(四) 审议期货交易所合并、分立、解散和清算的方案，提交会员大会通过；

(五) 决定专门委员会的设置；

(六) 决定会员的接纳和退出；

(七) 决定对违规行为的纪律处分；

(八) 决定期货交易所变更名称、住所或者营业场所；

(九) 审议批准根据章程和交易规则制定的细则和办法；

(十) 审议结算担保金的使用情况；

(十一) 审议批准风险准备金的使用方案；

(十二) 审议批准总经理提出的期货交易所发展规划和年度工作计划；

(十三) 审议批准期货交易所对外投资计划；

(十四) 监督总经理组织实施会员大会和理事会决议的情况；

(十五) 监督期货交易所高级管理人员和其他工作人员遵守国家有关法律、行政法规、规章、政策和期货交易所章程、交易规则及其实施细则的情况；

(十六) 组织期货交易所年度财务会计报告的审计工作，决定会计师事务所的聘用和变更事项；

(十七) 期货交易所章程规定和会员大会授予的其他职权。

第二十六条 理事会由会员理事和非会员理事组成；其中会员理事由会员大会选举产生，非会员理事由中国证监会委派。

第二十七条 理事会设理事长 1 人、副理事长 1 至 2 人。理事长、副理事长的任免，由中国证监会提名，理事会通过。理事长不得兼任总经理。

第二十八条 理事长行使下列职权：

(一) 主持会员大会、理事会会议和理事会日常工作；

(二) 组织协调专门委员会的工作；

(三) 检查理事会决议的实施情况并向理事会报告。

副理事长协助理事长工作。理事长因故临时不能履行职权的，由理事长指定的副理事长或者理事代其履行职权。

第二十九条 理事会会议至少每半年召开一次。每次会议应当于会议召开 10 日前通知全体理事。

有下列情形之一的，应当召开理事会临时会议：

(一) 1 / 3 以上理事联名提议；

(二) 期货交易所章程规定的情形；

(三)中国证监会提议。

理事会召开临时会议，可以另定召集理事会临时会议的通知方式和通知时限。

第三十条 理事会会议须有 2 / 3 以上理事出席方为有效，其决议须经全体理事 1 / 2 以上表决通过。

理事会会议结束之日起 1 0 日内，理事会应当将会议决议及其他会议文件报告中国证监会。

第三十一条 理事会会议应当由理事本人出席。理事因故不能出席的，应当以书面形式委托其他理事代为出席；委托书中应当载明授权范围。每位理事只能接受一位理事的委托。

理事会应当对会议表决事项作成会议记录，由出席会议的理事和记录员在会议记录上签名。

第三十二条 理事会可以根据需要设立监察、交易、结算、交割、会员资格审查、纪律处分、调解、财务和技术等专门委员会。

各专门委员会对理事会负责，其职责、任期和人员组成等事项由理事会规定。

第三十三条 期货交易所设总经理 1 人，副总经理若干人。总经理、副总理由中国证监会任免。总经理每届任期 3 年，连任不得超过两届。

总经理是期货交易所的法定代表人，总经理是当然理事。

第三十四条 总经理行使下列职权：

- (一)组织实施会员大会、理事会通过的制度和决议；
- (二)主持期货交易所的日常工作；
- (三)根据章程和交易规则拟订有关细则和办法；
- (四)决定结算担保金的使用；
- (五)拟订风险准备金的使用方案；
- (六)拟订并实施经批准的期货交易所发展规划、年度工作计划；
- (七)拟订并实施经批准的期货交易所对外投资计划；

- (八) 拟订期货交易所财务预算方案、决算报告；
- (九) 拟订期货交易所合并、分立、解散和清算的方案；
- (十) 拟订期货交易所变更名称、住所或者营业场所的方案；
- (十一) 决定期货交易所机构设置方案，聘任和解聘工作人员；
- (十二) 决定期货交易所员工的工资和奖惩；
- (十三) 期货交易所章程规定的或者理事会授予的其他职权。

总经理因故临时不能履行职权的，由总经理指定的副总经理代其履行职权。

第三十五条 期货交易所任免中层管理人员，应当在决定之日起 10 日内向中国证监会报告。

第二节 公司制期货交易所

第三十六条 公司制期货交易所设股东大会。股东大会是期货交易所的权力机构，由全体股东组成。

第三十七条 股东大会行使下列职权：

- (一) 本办法第二十条第（一）项、第（四）项至第（七）项规定的职权；
- (二) 选举和更换非由职工代表担任的董事、监事；
- (三) 审议批准董事会、监事会和总经理的工作报告；
- (四) 决定期货交易所董事会提交的其他重大事项；
- (五) 期货交易所章程规定的其他职权。

第三十八条 股东大会会议的召开及议事规则应当符合期货交易所章程的规定。

会议结束之日起 10 日内，期货交易所应当将会议全部文件报告中国证监会。

第三十九条 期货交易所设董事会，每届任期 3 年。

第四十条 董事会对股东大会负责，行使下列职权：

- (一) 召集股东大会会议，并向股东大会报告工作；

(二)拟订期货交易所章程、交易规则及其修改草案，提交股东大会审定；

(三)审议总经理提出的财务预算方案、决算报告，提交股东大会通过；

(四)审议期货交易所合并、分立、解散和清算的方案，提交股东大会通过；

(五)监督总经理组织实施股东大会和董事会决议的情况；

(六)本办法第二十五条第(五)项至第(十三)项、第(十五)项、第(十六)项规定的职权；

(七)期货交易所章程规定和股东大会授予的其他职权。

第四十一条 期货交易所设董事长1人，副董事长1至2人。董事长、副董事长的任免，由中国证监会提名，董事会通过。董事长不得兼任总经理。

第四十二条 董事长行使下列职权：

(一)主持股东大会、董事会会议和董事会日常工作；

(二)组织协调专门委员会的工作；

(三)检查董事会决议的实施情况并向董事会报告。

副董事长协助董事长工作。董事长因故临时不能履行职权的，由董事长指定的副董事长或者董事代其履行职权。

第四十三条 董事会会议的召开和议事规则应当符合期货交易所章程的规定。

董事会会议结束之日起10日内，董事会应当将会议决议及其他会议文件报告中国证监会。

第四十四条 董事会可以根据需要设立本办法第三十二条规定的专门委员会。各专门委员会对董事会负责，其职责、任期和人员组成等事项由董事会规定。

第四十五条 期货交易所应当设独立董事。独立董事由中国证监会提名，股东大会通过。

第四十六条 期货交易所可以设董事会秘书。董事会秘书由中国证监会提名，董事会通过。

董事会秘书负责期货交易所股东大会和董事会会议的筹备、文件保管以及期货交易所股东资料的管理等事宜。

第四十七条 期货交易所设总经理 1 人，副总经理若干人。总经理、副总理由中国证监会任免。总经理每届任期 3 年，连任不得超过两届。

总经理是期货交易所的法定代表人，总经理应当由董事担任。

第四十八条 总经理行使下列职权：

- (一) 组织实施股东大会、董事会通过的制度和决议；
- (二) 本办法第三十四条第（二）项至第（十二）项规定的职权；
- (三) 期货交易所章程规定或者董事会授予的其他职权。

总经理因故临时不能履行职权的，由总经理指定的副总经理代其履行职权。

第四十九条 期货交易所设监事会，每届任期 3 年。监事会成员不得少于 3 人。监事会设主席 1 人，副主席 1 至 2 人。监事会主席、副主席的任免，由中国证监会提名，监事会通过。

第五十条 监事会行使下列职权：

- (一) 检查期货交易所财务；
- (二) 监督期货交易所董事、高级管理人员执行职务行为；
- (三) 向股东大会会议提出提案；
- (四) 期货交易所章程规定的其他职权。

第五十一条 监事会会议的召开和议事规则应当符合期货交易所章程的规定。

监事会会议结束之日起 10 日内，监事会应当将会议决议及其他会议文件报告中国证监会。

第五十二条 本办法第三十五条的规定适用于公司制期货交易所。

第四章 会员管理

第五十三条 期货交易所会员应当是在中华人民共和国境内登记注册的企业法人或者其他经济组织。

第五十四条 取得期货交易所会员资格，应当经期货交易所批准。

期货交易所批准、取消会员的会员资格，应当向中国证监会报告。

第五十五条 期货交易所应当制定会员管理办法，规定会员资格的取得与终止的条件和程序、对会员的监督管理等内容。

第五十六条 会员制期货交易所会员享有下列权利：

- (一) 参加会员大会，行使选举权、被选举权和表决权；
- (二) 在期货交易所从事规定的交易、结算和交割等业务；
- (三) 使用期货交易所提供的交易设施，获得有关期货交易的信息和服务；
- (四) 按规定转让会员资格；
- (五) 联名提议召开临时会员大会；
- (六) 按照期货交易所章程和交易规则行使申诉权；
- (七) 期货交易所章程规定的其他权利。

第五十七条 会员制期货交易所会员应当履行下列义务：

- (一) 遵守国家有关法律、行政法规、规章和政策；
- (二) 遵守期货交易所的章程、交易规则及其实施细则及有关决定；
- (三) 按规定缴纳各种费用；
- (四) 执行会员大会、理事会的决议；
- (五) 接受期货交易所监督管理。

第五十八条 公司制期货交易所会员享有下列权利：

- (一) 本办法第五十六条第（二）项和第（三）项规定的权利；
- (二) 按照交易规则行使申诉权；
- (三) 期货交易所交易规则规定的其他权利。

第五十九条 公司制期货交易所会员应当履行本办法第五十七条第（一）项至第（三）项、第（五）项规定的义务。

第六十条 期货交易所每年应当对会员遵守期货交易所交易规则及其实施细则的情

况进行抽样或者全面检查，并将检查结果报告中国证监会。

期货交易所行使监管职权时，可以按照期货交易所章程和交易规则及其实施细则规定的权限和程序对会员进行调查取证，会员应当配合。

第六十一条 经中国证监会批准，期货交易所可以实行全员结算制度或者会员分级结算制度。

第六十二条 实行全员结算制度的期货交易所会员均具有与期货交易所进行结算的资格。

第六十三条 实行全员结算制度的期货交易所会员由期货公司会员和非期货公司会员组成。期货公司会员按照中国证监会批准的业务范围开展相关业务；非期货公司会员不得从事《期货交易管理条例》规定的期货公司业务。

第六十四条 实行全员结算制度的期货交易所对会员结算，会员对其受托的客户结算。

第六十五条 实行会员分级结算制度的期货交易所会员由结算会员和非结算会员组成。结算会员具有与期货交易所进行结算的资格，非结算会员不具有与期货交易所进行结算的资格。

期货交易所对结算会员结算，结算会员对非结算会员结算，非结算会员对其受托的客户结算。

第六十六条 结算会员由交易结算会员、全面结算会员和特别结算会员组成。

全面结算会员、特别结算会员可以为与其签订结算协议的非结算会员办理结算业务。交易结算会员不得为非结算会员办理结算业务。

第六十七条 申请成为结算会员的，应当取得中国证监会批准的结算业务资格。

第六十八条 实行会员分级结算制度的期货交易所可以根据结算会员资信和业务开展情况，限制结算会员的结算业务范围，但应当于3日内报告中国证监会。

第五章 基本业务规则

第六十九条 期货交易所向会员收取的保证金，只能用于担保期货合约的履行，不得查封、冻结、扣划或者强制执行。期货交易所应当在期货保证金存管银行开立专用结算账户，专户存储保证金，不得挪用。

保证金分为结算准备金和交易保证金。结算准备金是指未被合约占用的保证金；交易保证金是指已被合约占用的保证金。

实行会员分级结算制度的期货交易所只向结算会员收取保证金。

第七十条 期货交易所应当建立保证金管理制度。保证金管理制度应当包括下列内容：

- (一)向会员收取保证金的标准和形式；
- (二)专用结算账户中会员结算准备金最低余额；
- (三)当会员结算准备金余额低于期货交易所规定最低余额时的处置方法。

会员结算准备金最低余额由会员以自有资金向期货交易所缴纳。

第七十一条 期货交易所可以接受以下有价证券充抵保证金：

- (一)经期货交易所认定的标准仓单；
- (二)可流通的国债；
- (三)中国证监会认定的其他有价证券。

以前款规定的有价证券充抵保证金的，充抵的期限不得超过该有价证券的有效期限。

第七十二条 标准仓单充抵保证金的，期货交易所以充抵日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计算价值。

国债充抵保证金的，期货交易所以充抵日前一交易日该国债在上海证券交易所、深圳证券交易所较低的收盘价为基准计算价值。

期货交易所可以根据市场情况对用于充抵保证金的有价证券的基准计算价值进行调整。

第七十三条 有价证券充抵保证金的金额不得高于以下标准中的较低值：

- (一)有价证券基准计算价值的80%；
- (二)会员在期货交易所专用结算账户中的实有货币资金的4倍。

第七十四条 期货交易的相关亏损、费用、货款和税金等款项，应当以货币资金支付，不得以有价证券充抵的金额支付。

第七十五条 客户以有价证券充抵保证金的，会员应当将收到的有价证券提交期货交易所。

非结算会员的客户以有价证券充抵保证金的，非结算会员应将收到的有价证券提交结算会员，由结算会员提交期货交易所。

第七十六条 客户以有价证券充抵保证金的，期货交易所应当将用于充抵的有价证券的种类和数量如实反映在该客户的交易编码下。

第七十七条 实行会员分级结算制度的期货交易所应当建立结算担保金制度。结算担保金包括基础结算担保金和变动结算担保金。

结算担保金由结算会员以自有资金向期货交易所缴纳。结算担保金属于结算会员所有，用于应对结算会员违约风险。期货交易所应当按照有关规定管理和使用，不得挪作他用。

期货交易所调整基础结算担保金标准的，应当在调整前报告中国证监会。

第七十八条 期货交易所应当按照手续费收入的 20% 的比例提取风险准备金，风险准备金应当单独核算，专户存储。

中国证监会可以根据期货交易所业务规模、发展计划以及潜在的风险决定风险准备金的规模。

第七十九条 期货交易实行客户交易编码制度。会员和客户应当遵守一户一码制度，不得混码交易。

第八十条 期货交易实行限仓制度和套期保值审批制度。

第八十一条 期货交易实行大户持仓报告制度。会员或者客户持仓达到期货交易所规定的持仓报告标准的，会员或者客户应当向期货交易所报告。客户未报告的，会员应当向期货交易所报告。

期货交易所可以根据市场风险状况制定并调整持仓报告标准。

第八十二条 期货交易实行当日无负债结算制度。

第八十三条 实行全员结算制度的期货交易所对会员进行风险管理，会员对其受托的客户进行风险管理。

实行会员分级结算制度的期货交易所对结算会员进行风险管理，结算会员对与其签订结算协议的非结算会员进行风险管理，会员对其受托的客户进行风险管理。

第八十四条 会员在期货交易中违约的，应当承担违约责任。

期货交易所先以违约会员的保证金承担该会员的违约责任，保证金不足的，实行全员结

算制度的期货交易所应当以违约会员的自有资金、期货交易所风险准备金和期货交易所自有资金承担；实行会员分级结算制度的期货交易所应当以违约会员的自有资金、结算担保金、期货交易所风险准备金和期货交易所自有资金承担。

期货交易所以结算担保金、期货交易所风险准备金和期货交易所自有资金代为承担责任后，由此取得对违约会员的相应追偿权。

第八十五条 有根据认为会员或者客户违反期货交易所交易规则及其实施细则并且对市场正在产生或者即将产生重大影响，为防止违规行为后果进一步扩大，期货交易所可以对该会员或者客户采取下列临时处置措施：

(一) 限制入金；

(二) 限制出金；

(三) 限制开仓；

(四) 提高保证金标准；

(五) 限期平仓；

(六) 强行平仓。

期货交易所按交易规则及其实施细则规定的程序采取前款第（四）项、第（五）项或者第（六）项措施的，应当在采取措施后及时报告中国证监会。

期货交易所对会员或者客户采取临时处置措施，应当按照期货交易所交易规则及其实施细则规定的方式通知会员或者客户，并列明采取临时处置措施的根据。

第八十六条 期货价格出现同方向连续涨跌停板的，期货交易所可以采用调整涨跌停板幅度、提高交易保证金标准及按一定原则减仓等措施化解风险。

第八十七条 期货交易所实行风险警示制度。期货交易所认为必要的，可以分别或同时采取要求会员和客户报告情况、谈话提醒、发布风险提示函等措施，以警示和化解风险。

第八十八条 在期货交易过程中出现以下情形之一的，期货交易所可以宣布进入异常情况，采取紧急措施化解风险：

(一) 地震、水灾、火灾等不可抗力或者计算机系统故障等不可归责于期货交易所的原因导致交易无法正常进行；

(二) 会员出现结算、交割危机，对市场正在产生或者即将产生重大影响；

(三) 出现本办法第八十六条规定的情形经采取相应措施后仍未化解风险；

(四) 期货交易所交易规则及其实施细则中规定的其他情形。

期货交易所宣布进入异常情况并决定采取紧急措施前应当报告中国证监会。

第八十九条 期货交易所宣布进入异常情况并决定暂停交易的，暂停交易的期限不得超过 3 个交易日，但经中国证监会批准延长的除外。

第九十条 期货交易所应当以适当方式发布下列信息：

(一) 即时行情；

(二) 持仓量、成交量排名情况；

(三) 期货交易所交易规则及其实施细则规定的其他信息。

期货交易涉及商品实物交割的，期货交易所还应当发布标准仓单数量和可用库容情况。

第九十一条 期货交易所应当编制交易情况周报表、月报表和年报表，并及时公布。

第九十二条 期货交易所对期货交易、结算、交割资料的保存期限应当不少于 20 年。

第六章 监督管理

第九十三条 期货交易所制定或者修改章程、交易规则，上市、中止、取消或者恢复交易品种，上市、修改或者终止合约，应当经中国证监会批准。

第九十四条 期货交易所应当对违反期货交易所交易规则及其实施细则的行为制定查处办法，并报中国证监会批准。

期货交易所对会员及其客户、指定交割仓库、期货保证金存管银行及期货市场其他参与者与期货业务有关的违规行为，应当在前款所称办法规定的职责范围内及时予以查处；超出前款所称办法规定的职责范围的，应当向中国证监会报告。

第九十五条 期货交易所制定或者修改交易规则的实施细则，应当征求中国证监会的意见，并在正式发布实施前，报告中国证监会。

第九十六条 期货交易所的交易结算系统和交易结算业务应当满足期货保证金安全存管监控的要求，真实、准确和完整地反映会员保证金的变动情况。

第九十七条 期货交易所应当按照中国证监会有关期货保证金安全存管监控的规

定，向期货保证金安全存管监控机构报送相关信息。

第九十八条 公司制期货交易所收购本期货交易所股份、股东转让所持股份或者对其股份进行其他处置，应当经中国证监会批准。

第九十九条 期货交易所的高级管理人员应当具备中国证监会要求的条件。未经中国证监会批准，期货交易所的理事长、副理事长、董事长、副董事长、监事会主席、监事会副主席、总经理、副总经理、董事会秘书不得在任何营利性组织中兼职。

未经批准，期货交易所的其他工作人员和非会员理事不得以任何形式在期货交易所会员单位及其他与期货交易有关的营利性组织兼职。

第一百条 期货交易所工作人员应当自觉遵守有关法律、行政法规、规章和政策，恪尽职守，勤勉尽责，诚实信用，具有良好的职业操守。

期货交易所工作人员不得从事期货交易，不得泄露内幕消息或者利用内幕消息获得非法利益，不得从期货交易所会员、客户处谋取利益。

期货交易所的工作人员履行职务，遇有与本人或者其亲属有利害关系的情形时，应当回避。

第一百零一条 期货交易所的所得收益按照国家有关规定管理和使用，但应当首先用于保证期货交易场所、设施的运行和改善。

第一百零二条 期货交易所应当向中国证监会履行下列报告义务：

(一)每一年度结束后4个月内提交经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计的年度财务报告；

(二)每一季度结束后15日内、每一年度结束后30日内提交有关经营情况和有关法律、行政法规、规章、政策执行情况的季度和年度工作报告；

(三)中国证监会规定的其他事项。

第一百零三条 发生下列重大事项，期货交易所应当及时向中国证监会报告：

(一)发现期货交易所工作人员存在或者可能存在严重违反国家有关法律、行政法规、规章、政策的行为；

(二)期货交易所涉及占其净资产10%以上或者对其经营风险有较大影响的诉讼；

(三)期货交易所的重大财务支出、投资事项以及可能带来较大财务或者经营风险的重大财务决策；

(四)中国证监会规定的其他事项。

第一百零四条 中国证监会可以根据市场情况调整期货交易所收取的保证金标准，暂停、恢复或者取消某一期货交易品种的交易。

第一百零五条 中国证监会认为期货市场出现异常情况的，可以决定采取延迟开市、暂停交易、提前闭市等必要的风险处置措施。

第一百零六条 中国证监会认为有必要的，可以对期货交易所高级管理人员实施提示。

第一百零七条 中国证监会派出机构对期货交易所会员进行风险处置，采取监管措施的，经中国证监会批准，期货交易所应当在限制会员资金划转、限制会员开仓、移仓和强行平仓等方面予以配合。

第一百零八条 中国证监会可以向期货交易所派驻督察员。督察员依照中国证监会的有关规定履行职责。

督察员履行职责，期货交易所应当予以配合。

第一百零九条 期货交易所应当按照国家有关规定及时缴纳期货市场监管费。

第七章 法律责任

第一百一十条 期货交易所未按照本办法第十五条、第三十五条、第五十二条、第六十八条、第八十八条、第九十五条、第一百零二条和第一百零三条的规定履行报告义务，或者未按照本办法第二十三条、第三十条、第三十八条、第四十三条、第五十一条和第九十七条的规定报送有关文件、资料 and 信息的，根据《期货交易管理条例》第六十八条处罚。

第一百一十一条 期货交易所有下列行为之一的，根据《期货交易管理条例》第六十九条处罚：

- (一) 未经批准变更名称或者注册资本；
- (二) 未经批准设立分所或者其他任何交易场所；
- (三) 违反有价证券充抵保证金规定；
- (四) 不按照规定对会员进行检查；
- (五) 未建立或者未执行客户交易编码制度、保证金管理制度；
- (六) 交易结算系统和交易结算业务不符合本办法第九十六条的规定。

第一百一十二条 期货交易所工作人员违反本办法第一百条规定的，根据《期货交易管理条例》第八十二条处罚。

第八章 附则

第一百一十三条 在中国证监会批准的其他交易场所进行期货交易的，依照本办法的有关规定执行。

第一百一十四条 本办法自2007年4月15日起施行。2002年5月17日发布的《期货交易所管理办法》（中国证券监督管理委员会令第6号）同时废止。

期货公司管理办法

中国证券监督管理委员会令（第43号） 2007年4月9日发布，自2007年4月15日起施行。

第一章 总 则

第一条 为了规范期货公司的经营活动，加强对期货公司的监督管理，保护客户的合法权益，促进期货市场积极稳妥发展，根据《公司法》和《期货交易管理条例》等法律、行政法规，制定本办法。

第二条 在中华人民共和国境内设立的期货公司，适用本办法。

第三条 期货公司应当遵守法律、行政法规和中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）的规定，审慎经营，履行对客户的诚信义务。

第四条 期货公司的控股股东、实际控制人和其他关联人不得滥用权利，不得占用期货公司的资产或者挪用客户保证金和其他资产，不得损害期货公司、客户的合法权益。

第五条 中国证监会及其派出机构依法对期货公司及其分支机构实行监督管理。

中国期货业协会、期货交易所依法对期货公司实行自律管理。

期货保证金安全存管监控机构依法对保证金安全实施监控。

第二章 设立、变更与业务终止

第六条 申请设立期货公司，除应当符合《期货交易管理条例》第十六条规定的条件外，还应当具备下列条件：

- （一）具有期货从业人员资格的人员不少于 15 人；
- （二）具备任职资格的高级管理人员不少于 3 人。

第七条 申请设立期货公司，股东应当具有中国法人资格，持有 5 % 以上股权的股东应当具备下列条件：

（一）实收资本和净资产均不低于人民币 3 0 0 0 万元，持续经营 2 个以上完整的会计年度，在最近 2 个会计年度内至少 1 个会计年度盈利；或者实收资本和净资产均不低于人民币 2 亿元；

（二）净资产不低于实收资本的 5 0 %，或有负债低于净资产的 5 0 %，不存在对财务状况产生重大不确定影响的其他风险；

（三）包括对期货公司的出资在内的累计对外长期股权投资不超过自身净资产；

（四）没有较大数额的到期未清偿债务；

（五）近 3 年内未因违法违规经营受到行政处罚或者刑事处罚；

（六）未因涉嫌违法违规经营正在被有权机关立案调查或者采取强制措施；

（七）在近 3 年内作为金融机构的股东或者实际控制人，或者作为上市公司的控股股东或者实际控制人，没有滥用股东权利、逃避股东义务等不诚信行为；

（八）其自然人股东、法定代表人或者高级管理人员没有被采取证券、期货市场禁入措施，或者禁入期限届满已逾 2 年；没有被撤销证券、期货高级管理人员任职资格或者从业人员资格，或者自被撤销之日起已逾 2 年；不存在《公司法》第一百四十七条第一款所列情形；

（九）不存在中国证监会根据审慎监管原则认定的其他不适合参股期货公司的情形。

第八条 设立期货公司，持有 1 0 0 % 股权的股东除应当符合本办法第七条规定的条件外，净资本应当不低于人民币 1 0 亿元；股东不适用净资本或者类似指标的，净资产应当不低于人民币 1 5 亿元。

第九条 期货公司有关联关系的股东持股比例合计达到 5 % 的，持股比例最高的股东应当符合本办法第七条规定的条件。

期货公司有关联关系的股东持股比例合计达到 1 0 0 % 的，持股比例最高的股东

应当符合本办法第八条规定的条件。

第十条 申请设立期货公司，应当向中国证监会提交下列申请材料：

- (一) 设立期货公司申请书；
- (二) 公司章程草案；
- (三) 经营计划；
- (四) 发起人名单及其审计报告；
- (五) 拟任用高级管理人员和从业人员名单、简历和相关资格证明；
- (六) 拟订的期货业务制度、内部控制制度和风险管理制度文本；
- (七) 场地、设备、资金证明文件；
- (八) 律师事务所出具的法律意见书；
- (九) 中国证监会规定的其他申请材料。

第十一条 按照本办法设立的期货公司，可以从事商品期货经纪业务；从事其他期货业务的，还应当取得相应的业务资格。

第十二条 期货公司申请金融期货经纪业务资格，应当具备下列条件：

- (一) 申请日前 2 个月的风险监管指标持续符合规定的标准；
- (二) 具有健全的公司治理、风险管理制度和内部控制制度，并有效执行；
- (三) 符合中国证监会期货保证金安全存管监控的规定；
- (四) 具有从事金融期货经纪业务的详细计划；
- (五) 业务设施和技术系统符合相关技术规范且运行状况良好；
- (六) 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；
- (七) 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；
- (八) 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；

(九) 近 2 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;

(十) 控股股东净资产不低于人民币 3000 万元;

(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;

(十二) 中国证监会根据审慎监管原则规定的其他条件。

第十三条 期货公司申请金融期货经纪业务资格, 应当向中国证监会提交下列申请材料:

(一) 金融期货经纪业务资格申请书;

(二) 加盖公司公章的营业执照和业务许可证复印件;

(三) 股东会或者董事会关于期货公司申请金融期货经纪业务资格的决议文件;

(四) 申请日前 2 个月月末的期货公司风险监控报表, 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;

(五) 公司治理、风险管理制度和内部控制制度文本及执行情况报告;

(六) 从事金融期货经纪业务的计划书;

(七) 业务设施和技术系统运行情况报告;

(八) 《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》;

(九) 经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计的前 1 年度财务报告; 申请日在下半年的, 还应提供经审计的半年度财务报告;

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

(十一) 律师事务所就期货公司是否符合本办法第十二条第(六)项、第(八)项、第(九)项和第(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;

(十二) 若存在本办法第十二条第(九)项规定的情形的, 还应提供期货公司住所

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；

(十三) 中国证监会规定的其他申请材料。

第十四条 期货公司变更股权有下列情形之一的，应当经中国证监会批准：

(一) 单个股东的持股比例增加到5%以上，或者有关联关系的股东合计持股比例增加到5%以上；

(二) 持有5%以上股权的股东受让股权，或者有关联关系且合计持有5%以上股权的股东受让股权。

第十五条 期货公司变更股权有本办法第十四条所列情形的，应当符合下列条件：

(一) 拟变更的股权不存在被查封、冻结等情形；

(二) 期货公司与股东之间不存在交叉持股的情形，期货公司不存在为股权受让方提供任何形式财务支持的情形；

(三) 涉及的股东符合本办法第七条、第八条、第九条规定的条件。

第十六条 期货公司变更股权有本办法第十四条所列情形的，应当向中国证监会提交下列申请材料：

(一) 变更股权申请书；

(二) 股东会关于变更股权的决议文件；

(三) 股权转让合同，以及其他股东放弃优先购买权的承诺书；

(四) 变更后期货公司股东股权背景情况图；

(五) 间接持有期货公司5%及以上股权的自然人情况申报表；

(六) 期货公司关于变更后股东之间是否存在关联关系、期货公司是否为股权受让方提供任何形式财务支持的情况说明；

(七) 拟增加出资额的股东的股东会或者董事会做出的相关决议；

(八) 拟增加出资额的股东以及符合本办法第九条规定的股东的基本情况报告；

(九) 拟增加出资额的股东以及符合本办法第九条规定的股东的审计报告；

(十) 拟增加出资额的股东以及符合本办法第九条规定的股东关于投资期货公司的

可行性报告和计划；

(十一) 律师事务所出具的法律意见书；

(十二) 中国证监会规定的其他材料。

第十七条 期货公司变更注册资本，应当符合下列条件：

(一) 变更后注册资本不低于所从事的期货业务的注册资本最低限额；

(二) 模拟计算的变更注册资本后的净资本和其他财务指标满足风险监管指标标准；

(三) 增加注册资本的，拟增加出资或者受让股权的股东应当符合本办法第七条、第八条、第九条的规定。

第十八条 期货公司变更注册资本，应当经中国证监会审核，期货公司应当向中国证监会提交下列申请材料：

(一) 变更注册资本申请书；

(二) 股东会关于变更注册资本的决议文件；

(三) 股东变更出资的合同，以及其他股东放弃优先购买权的承诺书；

(四) 变更注册资本的详细方案；

(五) 模拟计算的变更注册资本后的资产负债表、风险监管报表；

(六) 本办法第十六条第(四)项至第(十一)项规定的材料；

(七) 中国证监会规定的其他材料。

第十九条 期货公司变更股权或者注册资本，单个股东或者有关联关系的股东拟持有期货公司100%股权的，中国证监会根据审慎监管原则进行审查，做出批准或者不批准的决定。

第二十条 期货公司变更法定代表人，拟任法定代表人应当具备任职资格。期货公司应当向住所地的中国证监会派出机构提交下列申请材料：

(一) 变更法定代表人申请书；

(二) 股东会关于变更法定代表人的决议文件。公司章程另有规定的，从其规定；

(三) 拟任法定代表人任职资格证明；

(四)中国证监会规定的其他材料。

第二十一条 期货公司变更住所，应当妥善处理客户的保证金和持仓，拟迁入的住所和拟使用的设施应当符合期货业务的需要。期货公司在中国证监会不同派出机构辖区变更住所的，还应当符合下列条件：

- (一)符合持续性经营规则；
- (二)近 2 年内无重大违法违规经营记录，未发生重大风险事件；
- (三)中国证监会根据审慎监管原则规定的其他条件。

第二十二条 期货公司变更住所，应当向拟迁入地中国证监会派出机构提交下列申请材料：

- (一)变更住所申请书；
- (二)变更住所的详细计划；
- (三)拟变更后的住所所有权或者使用权证明和消防检验合格证明；
- (四)妥善处理客户保证金和持仓的报告；
- (五)中国证监会规定的其他材料。

第二十三条 期货公司申请设立营业部，应当具备下列条件：

(一)未因涉嫌违法违规经营正在被有权机关调查，近 1 年内未因违法违规经营受到行政处罚或者刑事处罚；

- (二)申请日前 3 个月符合期货公司风险监管指标标准；
- (三)符合有关客户资产保护和期货保证金安全存管监控的规定；
- (四)公司治理和内部控制制度符合有关规定并有效执行；
- (五)拟任负责人具备任职资格条件，业务岗位工作人员具备期货从业人员资格；
- (六)业务岗位职责明确、分工合理，与营业部的经营计划相适应；
- (七)具有符合期货业务需要的营业场所和设施；
- (八)中国证监会根据审慎监管原则规定的其他条件。

第二十四条 期货公司申请设立营业部，应当向拟设立营业部所在地的中国证监会派出机构提交下列申请材料：

- （一）设立营业部申请书；
- （二）拟设立营业部的决议文件；
- （三）申请日前 3 个月月末的风险监管报表；
- （四）营业部的管理制度文本；
- （五）拟任负责人任职资格申请材料或证明；
- （六）拟任用从业人员名册、期货从业人员资格证书复印件；
- （七）营业场所所有权或者使用权证明和消防检验合格证明；
- （八）中国证监会规定的其他材料。

第二十五条 期货公司营业部变更负责人的，拟任负责人应当具备相应的任职资格。

期货公司应当向营业部所在地的中国证监会派出机构提交关于变更负责人申请书和拟任负责人任职资格证明。

第二十六条 期货公司营业部变更营业场所的，应当妥善处理客户的保证金和持仓，拟迁入的营业场所和拟使用的设施应当满足期货业务的需要。

期货公司应当向营业部所在地的中国证监会派出机构提交下列申请材料：

- （一）变更营业部营业场所申请书；
- （二）变更营业部营业场所的详细计划；
- （三）对客户保证金和持仓妥善处理的情况报告；
- （四）拟变更后的营业场所所有权或者使用权证明和消防检验合格证明；
- （五）中国证监会规定的其他材料。

本办法所称期货公司变更营业部营业场所仅限于在中国证监会同一派出机构辖区内变更营业场所。

第二十七条 期货公司营业部终止的，应当先行妥善处理该营业部客户的保证金和

其他资产，结清期货业务并终止经营活动。

期货公司应当向营业部所在地的中国证监会派出机构提交下列申请材料：

- (一)终止营业部申请书；
- (二)拟终止营业部的决议文件；
- (三)关于处理客户的保证金和其他资产、结清期货业务并终止经营活动的情况报告；
- (四)中国证监会规定的其他材料。

第二十八条 期货公司因遭遇不可抗力等正当事由申请停业的，应当妥善处理客户的保证金和其他资产，清退或转移客户。

期货公司恢复营业的，应当符合期货公司持续性经营规则。停业期限届满后，期货公司仍未能恢复营业或者仍不符合持续性经营规则的，中国证监会可以根据《期货交易管理条例》第二十一条第一款的规定注销其期货业务许可证。

第二十九条 期货公司停业的，应当向中国证监会提交下列申请材料：

- (一)停业申请书；
- (二)停业决议文件；
- (三)关于处理客户的保证金和其他资产、结清期货业务的情况报告；
- (四)中国证监会规定的其他材料。

第三十条 期货公司解散、破产的，应当先行妥善处理客户的保证金和其他资产，结清期货业务。

期货公司被撤销所有期货业务许可的，应当妥善处理客户的保证金和其他资产，结清期货业务；公司继续存续的，应当依法办理名称、经营范围和公司章程等工商变更登记，存续公司不得继续以期货公司名义从事期货业务，其名称中不得有“期货”或者近似字样。

第三十一条 期货公司设立、变更、解散、破产、被撤销期货业务许可或者其营业部设立、变更、终止的，期货公司应当在中国证监会指定的报刊或者媒体上公告。

第三十二条 期货公司及其营业部的许可证由中国证监会统一印制。许可证正本或者副本遗失或者灭失的，期货公司应当在30日内在中国证监会指定的报刊或者媒体上声明作废，并持登载声明向中国证监会重新申领。

第三章 公司治理

第三十三条 期货公司应当按照明晰职责、强化制衡、加强风险管理的原则，建立并完善公司治理。

第三十四条 期货公司与其控股股东在业务、人员、资产、财务、场所等方面应当严格分开，独立经营，独立核算。

期货公司的控股股东、实际控制人不得超越期货公司股东会、董事会任免期货公司的董事、监事、高级管理人员，或者非法干预客户保证金存管、交易、结算、风险管理、财务会计和营业部管理等经营管理活动。

期货公司不得向股东做出最低收益、分红的承诺；期货公司向股东、实际控制人及其关联人提供期货经纪服务的，不得降低风险管理要求。

第三十五条 期货公司股东会应当按照《公司法》和公司章程，对职权范围内的事项进行审议和表决。股东会每年应当至少召开一次会议。

期货公司股东应当按照出资比例行使表决权。

第三十六条 期货公司的股东及实际控制人出现下列情形之一的，应当在 3 日内通知期货公司：

- （一）所持有的期货公司股权被冻结、查封或者被强制执行；
- （二）质押所持有的期货公司股权；
- （三）决定转让所持有的期货公司股权；
- （四）不能正常行使股东权利或者承担股东义务，可能造成期货公司治理的重大缺陷；
- （五）涉嫌严重违法违规经营，被有权机关调查、采取强制措施；
- （六）变更名称；
- （七）合并、分立或者进行重大资产、债务重组；
- （八）被撤销、接管、托管、关闭，或者解散、破产；
- （九）其他可能影响期货公司股权变更的情形。

期货公司股东发生前款规定情形的，期货公司及其相关股东应当在 5 日内向期货公

司住所地的中国证监会派出机构提交书面报告；期货公司实际控制人发生前款第（五）项至第（八）项所列情形的，期货公司及其实际控制人应当在5日内向期货公司住所地的中国证监会派出机构提交书面报告。

第三十七条 期货公司有下列情形之一的，应当立即书面通知全体股东，并向期货公司住所地的中国证监会派出机构报告：

（一）公司或其董事、监事、高级管理人员因涉嫌重大违法违规被有权机关立案调查或者采取强制措施；

（二）拟更换董事长、总经理；

（三）财务状况恶化，不符合中国证监会规定的风险监控指标标准；

（四）客户发生重大透支、穿仓；

（五）发生突发事件，对期货公司和客户利益产生或者可能产生重大不利影响；

（六）其他可能影响期货公司持续经营的情形。

中国证监会及其派出机构对期货公司及其营业部作出的整改通知、监管措施和行政处罚等，期货公司应当书面通知全体股东。

第三十八条 期货公司应当设立董事会。董事会每年应当至少召开两次会议。董事会会议记录应当真实、准确、完整。

第三十九条 期货公司的董事会除应当行使《公司法》规定的职权外，还应当履行下列职责：

（一）审议并决定客户保证金安全存管制度，确保客户保证金存管符合有关客户资产保护和期货保证金安全存管监控的各项要求；

（二）审议并决定风险管理、内部控制制度。

第四十条 具有实行会员分级结算制度期货交易所结算业务资格的期货公司和独资期货公司等应当设独立董事。

独立董事应当保持独立性，不得在期货公司担任除董事以外的其他职务，不得与期货公司及其控股股东、实际控制人或者其他关联人存在可能妨碍其进行独立客观判断的关系。

独立董事应当遵守法律、行政法规和中国证监会的规定，遵守公司章程，对期货公司负有忠实义务和勤勉义务，维护客户、期货公司和全体股东的合法权益。期货公司的其他董事、监事和高级管理人员应当积极配合、协助独立董事履行职责。

第四十一条 期货公司应当按照《公司法》的规定设立监事会或监事，切实保障监事会和监事对公司经营情况的知情权。监事会或者监事应当按照《公司法》和公司章程的规定履行其职责。

第四十二条 期货公司章程应当就法定代表人对外代表公司进行经营活动时，违反董事会决定的公司经营计划和期货保证金安全存管、风险管理、内部控制等制度或者其他董事会决议的行为，规定法定代表人应当承担的责任与相应的责任追究程序。

第四十三条 期货公司应当设首席风险官，对期货公司经营管理行为的合法合规性、风险管理进行监督、检查。

首席风险官发现涉嫌占用、挪用客户保证金等违法违规行为或者可能发生风险的，应当立即向中国证监会派出机构和公司董事会报告。

期货公司拟解聘首席风险官的，应当有正当理由并向中国证监会派出机构报告。首席风险官不履行职责的，中国证监会及其派出机构有权责令更换。

第四十四条 期货公司的董事长、总经理、首席风险官之间不得存在近亲属关系。董事长和总经理不得由一人兼任。

第四十五条 期货公司应当合理设置业务部门及其职能，建立交易、结算、风险管理、财务等岗位责任制度，对关键岗位及业务实施重点控制，确保前、中、后台业务分开。

期货公司交易、结算、财务业务应当由不同部门和人员分开办理。

第四十六条 期货公司应当设立风险管理部门或者岗位，管理和控制期货公司的经营风险。

期货公司应当设立合规审查部门或者岗位，对期货公司经营管理行为的合法合规性进行审查、稽核。

第四十七条 期货公司应当按照中国证监会的规定对营业部实行统一结算、统一风险管理、统一资金调拨、统一财务管理和会计核算，建立规范、完善的营业部岗位责任制度和业务操作规程。

期货公司不得与他人合资、合作经营管理营业部，不得将营业部承包、租赁或者委托给他人经营管理。

第四章 经纪业务规则

第四十八条 期货公司应当按照审慎经营的原则，建立并有效执行风险管理、内部控制、期货保证金存管等业务制度和流程，保持财务稳健并持续符合中国证监会规定的

风险监控指标标准，确保客户的交易安全和资产安全。

第四十九条 期货公司应当遵循诚实信用原则，以专业的技能，勤勉尽责地执行客户的委托，维护客户的合法权益。

期货公司应当避免与客户的利益冲突，当无法避免时，应当确保客户利益优先。

第五十条 除《期货交易管理条例》第二十六规定的情形外，下列人员不得以本人或者他人名义从事期货交易：

（一）无民事行为能力人或者限制民事行为能力人；

（二）期货公司的工作人员及其配偶；

（三）中国证监会及其派出机构、期货交易所、期货保证金安全存管监控机构和中期期货业协会的工作人员及其配偶。

第五十一条 客户开立账户，必须出具中国公民身份证明或者中国法人资格或者其他经济组织资格的合法证件，中国证监会另有规定的除外。

第五十二条 期货公司在为客户开立账户前，应当向客户出示《期货交易风险说明书》，由客户签字确认已了解《期货交易风险说明书》的内容，并签订期货经纪合同。期货公司不得为未签订《期货经纪合同》的客户开立账户。

《〈期货经纪合同〉指引》、《期货交易风险说明书》的内容和格式由中国期货业协会制定。

期货公司应当根据《〈期货经纪合同〉指引》及时更新《期货经纪合同》格式文本，报中国期货业协会审查备案，并报住所地的中国证监会派出机构备案。

期货公司对外发布的广告宣传材料，应当自发布之日起5个工作日内报住所地的中国证监会派出机构备案。

第五十三条 期货公司应当向客户充分揭示期货交易的风险，在其营业场所备置期货交易相关法规、期货交易所业务规则，并公开相关期货经纪业务流程、相关从业人员资格证明等资料供客户查阅。

期货公司应当在期货经纪合同、本公司网站和营业场所提示客户可以通过中国期货业协会网站查询其从业人员资格公示信息。

第五十四条 期货公司应当按照规定为客户申请交易编码。期货公司办理客户销户手续时，应当按照规定及时向期货交易所申请注销客户的交易编码。

第五十五条 客户需要委托他人办理下达指令、调拨资金等事项的，应当在期货经纪合

同中指定受托人及明确其受托权限，约定联络方式、指令下达方式并预留受托人签字。

第五十六条 客户可以通过书面、电话、计算机、互联网等委托方式下达交易指令。以书面方式下达交易指令的，客户应当填写书面交易指令单；以电话方式下达交易指令的，期货公司应当同步录音；以计算机、互联网等委托方式下达交易指令的，期货公司应当以适当的方式保存该交易指令。

第五十七条 期货公司为客户提供互联网委托服务的，应当建立互联网交易风险管理制度，并对客户进行互联网交易风险的特别提示。

第五十八条 期货公司应当按照时间优先的原则传递客户交易指令。

第五十九条 期货公司应当在期货经纪合同中约定风险管理的标准、条件及处置措施。

第六十条 期货公司应当在每日交易闭市后为客户提供交易结算报告。客户应当按照期货经纪合同约定的时间和方式查询交易结算报告的内容。

期货公司应当根据期货交易所或者有结算业务资格的机构的结算结果对客户进行当日结算，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。

期货公司应当在期货经纪合同、本公司网站和营业场所提示客户可以通过期货保证金安全存管监控机构查询服务系统，查询期货交易结算结果和有关期货交易的其他信息。

第六十一条 客户对交易结算报告的内容有异议的，应当在期货经纪合同约定的时间内向期货公司提出书面异议；客户对交易结算报告的内容无异议的，应当按照期货经纪合同约定的方式确认。客户既未对交易结算报告的内容确认，也未在期货经纪合同约定的时间内提出异议的，视为对交易结算报告内容的确认。

客户有异议的，期货公司应当在期货经纪合同约定的时间内予以核实。

第六十二条 期货公司应当制定并执行错单处理业务规则。

第六十三条 期货公司应当建立客户资料档案，除依法接受调查和检查外，应当为客户保密。

第六十四条 期货公司应当建立、健全客户投诉处理制度。期货公司应当将客户的投诉材料及处理结果存档。

第六十五条 期货公司之间或者期货公司与客户之间发生期货业务纠纷的，可以提请中国期货业协会、期货交易所调解处理。

第六十六条 客户与期货公司的委托关系终止的，应当办理相关的销户手续。期货

公司不得将客户未注销的资金账号、交易编码借给他人使用。

第六十七条 期货公司应当建立交易、结算、财务数据的备份制度。

有关开户、变更、销户的客户资料档案应当自期货经纪合同终止之日起至少保存 20 年；交易指令记录、交易结算记录、错单记录、客户投诉档案以及其他业务记录应当至少保存 20 年。

期货公司以电子数据方式保存或者备份相关资料的，应当确保电子数据的真实、可靠，采取有效措施防止电子数据被篡改、损毁，保存的电子数据资料应当能随时转化为纸质形式。

第六十八条 期货公司可以委托经中国证监会批准的其他机构从事中间介绍业务。

第五章 客户资产保护

第六十九条 期货公司存管的期货保证金属于客户所有，除依据《期货交易管理条例》第二十九条划转客户保证金外，禁止任何单位或者个人以任何形式占用、挪用。期货公司破产或者清算时，客户的保证金和充抵保证金的其他资产不属于破产财产或者清算财产。非因客户本身的债务或者法律、行政法规规定的其他情形，不得查封、冻结、扣划或者强制执行客户的保证金和充抵保证金的其他资产。

客户的保证金应当与期货公司的自有资产相互独立、分别管理。

第七十条 期货公司应当在依法批准的期货保证金存管银行开立期货保证金账户。

期货公司开立、变更或者撤销期货保证金账户的，应在当日向其住所地的中国证监会派出机构和期货保证金安全存管监控机构备案，并通过规定的方式向客户披露期货保证金账户开立、变更或者撤销情况。

客户应当将保证金存入期货公司通过期货保证金安全存管监控机构网站披露的期货保证金账户。

期货保证金账户是指期货公司在期货保证金存管银行开立的用于存放和管理客户保证金的专用存款账户，包括期货公司在期货交易所所在地开立的、用于与期货交易所办理期货业务资金往来的专用资金账户。

第七十一条 期货公司存管的客户保证金应当全额存放在期货保证金账户和期货交易所专用结算账户内，严禁在期货保证金账户和期货交易所专用结算账户之外存放客户保证金。

第七十二条 客户应当向期货公司登记以本人名义开立的用于存取保证金的期货结算账户。

期货公司和客户应当通过备案的期货保证金账户和登记的期货结算账户转账存取保证金。

第七十三条 期货公司应当按照期货保证金安全存管监控的规定，及时向期货保证金安全存管监控机构报送信息。

第七十四条 期货保证金存管银行未能按照中国证监会有关规定向期货保证金安全存管监控机构报送有关期货保证金信息的，期货公司应当按照中国证监会及其派出机构的要求将期货保证金转存至其他符合规定的期货保证金存管银行。

第七十五条 期货公司应当按照期货交易所规则，使用自有资金缴存结算担保金、结算准备金，并维持最低数额的结算准备金等专用资金，确保客户期货交易的正常进行和客户保证金的安全。

第七十六条 客户在期货交易中违约造成保证金不足的，期货公司应当以风险准备金和自有资金垫付，不得占用其他客户的保证金。

期货公司应当按照规定提取、管理和使用风险准备金，不得挪作他用。

第六章 监督管理

第七十七条 期货公司应当按照规定定期报送年度报告、月度报告等有关资料。

期货公司的董事、高级管理人员、财务负责人应当对年度报告签署确认意见；法定代表人、经营管理的主要负责人和财务负责人应当对月度报告签署确认意见。

在期货公司年度报告、月度报告上签字的人员，应当保证报告的内容真实、准确、完整；对报告内容有异议的，应当注明自己的意见和理由。

第七十八条 中国证监会及其派出机构可以要求下列机构或者个人，在指定的期限内报送与期货公司经营管理和财务状况等相关的资料：

（一）期货公司及其董事、监事、高级管理人员及其他工作人员；

（二）期货公司的股东、实际控制人或者其他关联人；

（三）为期货公司提供相关服务的会计师事务所、律师事务所、资产评估机构等中介服务机构。

第七十九条 期货公司的股东、实际控制人或者其他关联人在期货公司从事期货交易的，期货公司应当自开户之日起 5 个工作日内向其住所地的中国证监会派出机构备案，定期向全体股东、董事会和监事会或者监事报告相关交易情况，并定期向其住所地的中国证监会派出机构报告相关交易情况。

第八十条 发生下列事项之一的，期货公司应当在 5 个工作日内向其住所地的中国证监会派出机构书面报告：

（一）变更名称、公司章程；

（二）发生本办法第十四条规定情形以外的股权变更；

（三）作出终止业务等重大决议；

（四）任免董事、监事、高级管理人员、财务负责人、营业部负责人，或者高级管理人员的分工发生变更；

（五）被有权机关立案调查或者采取强制措施；

（六）中国证监会规定的其他事项。

发生影响或者可能影响期货公司经营管理、财务状况或者客户资产安全的重大事件的，期货公司应当立即向中国证监会派出机构报告，说明事件的起因、目前的状态、可能发生的后果以及应对方案或者措施。

第八十一条 期货公司聘请或者解聘会计师事务所的，应当自作出决定之日起 5 个工作日内向其住所地的中国证监会派出机构报告；解聘会计师事务所的，应当说明理由。

中国证监会派出机构有理由认为会计师事务所不适合从事期货公司审计业务的，可以要求期货公司予以更换。

第八十二条 期货公司应当按照中国证监会的规定公开披露其基本情况、经营管理状况等有关信息。

第八十三条 有关机构和个人报送、提供或者披露的资料、信息应当真实、准确、完整，不得有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

第八十四条 中国证监会可以组织派出机构对期货公司或者营业部实施定期或者不定期的现场检查。

中国证监会派出机构可以对辖区内期货公司或者营业部实施现场检查。

中国证监会及其派出机构依法履行职责进行检查时，检查人员不得少于 2 人，并应当出示合法证件和检查通知书，不得泄露所知悉的商业秘密。

第八十五条 中国证监会及其派出机构有权采取下列措施，对期货公司或者营业部的经营管理、业务活动、财务状况等进行检查：

（一）询问期货公司及其营业部的工作人员，要求其对被检查事项作出解释、说明；

- (二) 查阅、复制与被检查事项有关的文件、资料；
- (三) 查询期货公司及其营业部的期货保证金账户；
- (四) 检查期货公司及其营业部的交易、结算及财务等电脑系统。

第八十六条 中国证监会及其派出机构认为期货公司可能存在下列情形之一的，可以要求其聘请中介服务机构进行专项审计、评估或者出具法律意见：

- (一) 期货公司的年度报告、月度报告或者临时报告等存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- (二) 违反有关客户资产保护和期货保证金安全存管监控规定或者风险监管指标管理规定；
- (三) 中国证监会根据审慎监管原则认定的其他重大情形。

期货公司应当配合有关中介服务机构工作，如实提供有关文件和资料。

第八十七条 期货公司及其股东、实际控制人或者其他关联人，为期货公司提供相关服务的会计师事务所、律师事务所、资产评估机构等中介服务机构涉嫌违反本办法有关规定的，中国证监会及其派出机构可以与其负责人以及相关工作人员进行监管谈话，责令改正，出具警示函。

第八十八条 期货公司或其营业部有下列情形之一的，中国证监会及其派出机构可以依据《期货交易管理条例》第五十九条的规定，采取相应的监管措施：

- (一) 公司治理不健全或者未有效执行，部门或者岗位设置存在较大缺陷，关键业务岗位或者人员缺位或者未履行应有职责等情况，可能影响期货公司持续经营；
- (二) 期货经纪业务规则不健全或者未有效执行，风险管理或者内部控制等存在较大缺陷，经营管理混乱，可能影响期货公司持续经营或者客户交易安全；
- (三) 期货结算业务规则不健全或者未有效执行，可能损害其他期货公司或者客户的合法权益；
- (四) 不符合有关客户资产保护或者期货保证金安全存管监控规定，可能影响客户资产安全；
- (五) 未按规定实行营业部统一管理制度，经营管理存在较大风险或者风险隐患；
- (六) 未按规定委托中间介绍业务，业务活动存在较大风险或者风险隐患；

(七) 交易、结算或者财务系统存在重大缺陷的,可能造成有关数据失真或者损害客户合法权益;

(八) 股东、实际控制人或者其他关联人出现停业、重大风险或者涉嫌严重违法违规等重大情况,可能影响期货公司治理或者持续经营;

(九) 存在可能影响财务稳健状况的纠纷、仲裁、诉讼;

(十) 报送、提供或者出具的有关报告、材料或者信息等存在虚假、误导或者遗漏;

(十一) 不符合其他持续性经营规则规定或者出现其他经营风险的情形。

对经过整改仍未达到经营条件的期货公司营业部,中国证监会派出机构有权依法关闭该营业部。

第八十九条 未经中国证监会批准,任何个人或者单位及其关联人擅自持有期货公司 5% 以上股权,或者通过提供虚假申请材料等方式成为期货公司股东,中国证监会可以责令其限期转让股权。

该股权在转让之前,不具有表决权、分红权。

第九十条 期货公司的股东、实际控制人或其他关联人有下列情形之一的,中国证监会及其派出机构可以责令其限期整改:

(一) 占用期货公司的资产,可能影响期货公司持续经营;

(二) 直接任免期货公司的董事、监事、高级管理人员,或者非法干预期货公司经营管理活动;

(三) 股东未按照出资比例行使表决权;

(四) 报送、提供或者出具的有关报告、材料或者信息等存在虚假、误导或者遗漏。

因前款情形致使期货公司不符合持续性经营规则或者出现经营风险的,中国证监会及其派出机构可以依据《期货交易管理条例》第五十九条的规定责令控股股东转让股权或者限制其行使股东权利。

第七章 法律责任

第九十一条 未经中国证监会批准,任何个人或者单位及其关联人擅自持有期货公司 5% 以上股权,或者通过提供虚假申请材料等方式成为期货公司股东,情节严重的,给予警告,单处或者并处 3 万元以下罚款。

第九十二条 期货公司及其营业部接受未办理开户手续的单位或者个人委托进行期

货交易，或者将客户的资金账号、交易编码借给其他单位或者个人使用的，给予警告，单处或者并处 3 万元以下罚款。

第九十三条 会计师事务所、律师事务所、资产评估机构等中介服务机构不按照规定履行报告义务，提供或者出具的报告、材料、意见不完整，责令改正，没收业务收入，单处或者并处 3 万元以下罚款。对直接负责的主管人员和其他责任人员给予警告，并处 3 万元以下罚款。

第九十四条 期货公司及其营业部有下列行为之一的，根据《期货交易管理条例》第七十条处罚：

(一)未按照规定将客户保证金与期货公司的自有资产相互独立、分别管理；

(二)未按照规定缴存结算担保金、结算准备金，或者未维持最低数额的结算准备金等专用资金；

(三)对股东、实际控制人及其关联人的期货交易降低风险管理要求，侵害其他客户合法权益；

(四)以合资、合作、联营方式设立营业部，或者将营业部承包、出租给他人，或者违反营业部集中统一管理规定；

(五)在期货保证金账户和期货交易所专用结算账户之外存放客户保证金；

(六)向期货保证金安全存管监控机构报送的信息存在虚假、误导或者重大遗漏；

(七)占用客户保证金；

(八)违反中国证监会有关结算业务管理规定，利用结算业务关系损害其他期货公司及其客户合法权益；

(九)违反规定委托中间介绍业务，损害客户合法权益；

(十)违反中国证监会有关风险监管指标规定；

(十一)拒不配合、阻碍或者破坏中国证监会及其派出机构监督管理；

(十二)违反有关期货投资者保障基金管理规定；

(十三)违反有关证券充抵保证金的有关规定。

第九十五条 期货公司及其营业部有下列情形之一的，根据《期货交易管理条例》第七十一条处罚：

(一)发布虚假广告或者进行虚假宣传，诱骗客户参与期货交易；

(二)不按照规定变更或者撤销期货保证金账户，或者不按照规定的方式向客户披露期货保证金账户信息。

第八章 附 则

第九十六条 香港、澳门服务提供者参股期货公司的，适用中国证监会有关规定。

第九十七条 本办法自2007年4月15日起施行。2002年5月17日发布的《期货经纪公司管理办法》(中国证券监督管理委员会令第7号)、中国证监会发布的《关于期货经纪公司营业部设立、变更、终止有关问题的通知》(证监期货字[2004]41号)、《关于期货经纪公司变更法定代表人、注册资本、股东或者股权结构、住所有关问题的通知》(证监期货字[2004]42号)、《关于期货经纪公司设立、解散、合并有关问题的通知》(证监期货字[2004]46号)、《关于期货经纪公司股东资格及相关问题的通知》(证监期货字[2005]155号)同时废止。

期货公司金融期货结算业务试行办法

中国证券监督管理委员会（证监发[2007]54号）2007年4月19日发布，自发布之日起施行。

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 risk 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本或者类似指标的，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。

证券公司为期货公司提供中间介绍业务试行办法

中国证券监督管理委员会（证监发[2007]56号） 2007年4月19日发布，自发布之日起施行。

第一章 总则

第一条 为了规范证券公司为期货公司提供中间介绍业务活动，防范和隔离风险，促进期货市场积极稳妥发展，根据《期货交易管理条例》，制定本办法。

第二条 本办法所称证券公司为期货公司提供中间介绍业务（以下简称介绍业务），是指证券公司接受期货公司委托，为期货公司介绍客户参与期货交易并提供其他相关服务的业务活动。

第三条 证券公司从事介绍业务，应当依照本办法的规定取得介绍业务资格，审慎经营，并对通过其营业部开展的介绍业务实行统一管理。

第四条 中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）及其派出机构依法对证券公司的介绍业务活动实行监督管理。

相关自律性组织依法对介绍业务活动实行自律管理。

第二章 资格条件与业务范围

第五条 证券公司申请介绍业务资格，应当符合下列条件：

（一）申请日前6个月各项风险控制指标符合规定标准；

（二）已按规定建立客户交易结算资金第三方存管制度；

（三）全资拥有或者控股一家期货公司，或者与一家期货公司被同一机构控制，且该期货公司具有实行会员分级结算制度期货交易所的会员资格、申请日前2个月的风险监管指标持续符合规定的标准；

（四）配备必要的业务人员，公司总部至少有5名、拟开展介绍业务的营业部至少有2名具有期货从业人员资格的业务人员；

(五) 已按规定建立健全与介绍业务相关的业务规则、内部控制、风险隔离及合规检查等制度;

(六) 具有满足业务需要的技术系统;

(七) 中国证监会根据市场发展情况和审慎监管原则规定的其他条件。

第六条 本办法第五条第(一)项所称风险控制指标标准是指:

(一) 净资本不低于 12 亿元;

(二) 流动资产余额不低于流动负债余额(不包括客户交易结算资金和客户委托管理资金)的 150%;

(三) 对外担保及其他形式的或有负债之和不高于净资产的 10%,但因证券公司发债提供的反担保除外;

(四) 净资本不低于净资产的 70%。

中国证监会可以根据市场发展情况和审慎监管原则对前款标准进行调整。

第七条 证券公司申请介绍业务,应当向中国证监会提交下列申请材料:

(一) 介绍业务资格申请书;

(二) 董事会关于从事介绍业务的决议,公司章程规定该决议由股东会或者股东大会做出的,应提供股东会或者股东大会的决议;

(三) 净资本等指标的计算表及相关说明;

(四) 客户交易结算资金独立存管制度实施情况说明及客户交易结算资金第三方存管制度文本;

(五) 分管介绍业务的有关负责人简历,相关业务人员简历、期货从业人员资格证明;

(六) 关于介绍业务的业务规则、内部控制、风险隔离和合规检查等制度文本;

(七) 关于技术系统准备情况的说明;

(八) 全资拥有或者控股期货公司,或者与期货公司被同一机构控制的情况说明,该期货公司在申请日前 2 个月月末的风险监管报表;

(九) 与期货公司拟签订的介绍业务委托协议文本。

第八条 中国证监会自受理申请材料之日起 20 个工作日内，作出批准或者不予批准的决定。

第九条 证券公司受期货公司委托从事介绍业务，应当提供下列服务：

- （一）协助办理开户手续；
- （二）提供期货行情信息、交易设施；
- （三）中国证监会规定的其他服务。

证券公司不得代理客户进行期货交易、结算或者交割，不得代期货公司、客户收付期货保证金，不得利用证券资金账户为客户存取、划转期货保证金。

第十条 证券公司从事介绍业务，应当与期货公司签订书面委托协议。委托协议应当载明下列事项：

- （一）介绍业务的范围；
- （二）执行期货保证金安全存管制度的措施；
- （三）介绍业务对接规则；
- （四）客户投诉的接待处理方式；
- （五）报酬支付及相关费用的分担方式；
- （六）违约责任；
- （七）中国证监会规定的其他事项。

双方可以在委托协议中约定前款规定以外的其他事项，但不得违反法律、行政法规和本办法的规定，不得损害客户的合法权益。

证券公司按照委托协议对期货公司承担介绍业务受托责任。基于期货经纪合同的责任由期货公司直接对客户承担。

第十一条 证券公司与期货公司签订、变更或者终止委托协议的，双方应当在 5 个工作日内报各自所在地的中国证监会派出机构备案。

第三章 业务规则

第十二条 证券公司只能接受其全资拥有或者控股的、或者被同一机构控制的期货

公司的委托从事介绍业务，不能接受其他期货公司的委托从事介绍业务。

第十三条 证券公司应当按照合规、审慎经营的原则，制定并有效执行介绍业务规则、内部控制、合规检查等制度，确保有效防范和隔离介绍业务与其他业务的风险。

第十四条 期货公司与证券公司应当建立介绍业务的对接规则，明确办理开户、行情和交易系统的安装维护、客户投诉的接待处理等业务的协作程序和规则。

第十五条 证券公司与期货公司应当独立经营，保持财务、人员、经营场所等分开隔离。

第十六条 证券公司应当根据内部控制和风险隔离制度的规定，指定有关负责人和有关部门负责介绍业务的经营管理。

证券公司应当配备足够的具有期货从业人员资格的业务人员，不得任用不具有期货从业人员资格的业务人员从事介绍业务。

证券公司从事介绍业务的工作人员不得进行期货交易。

第十七条 证券公司应当在其经营场所显著位置或者其网站，公开下列信息：

- （一）受托从事的介绍业务范围；
- （二）从事介绍业务的管理人员和业务人员的名单和照片；
- （三）期货公司期货保证金账户信息、期货保证金安全存管方式；
- （四）客户开户和交易流程、出入金流程；
- （五）交易结算结果查询方式；
- （六）中国证监会规定的其他信息。

中国证监会及其派出机构可以根据审慎监管原则，要求证券公司调整相关信息的公开方式。

第十八条 证券公司为期货公司介绍客户时，应当向客户明示其与期货公司的介绍业务委托关系，解释期货交易的方式、流程及风险，不得作获利保证、共担风险等承诺，不得虚假宣传，误导客户。

第十九条 证券公司应当建立完备的协助开户制度，对客户的开户资料 and 身份真实性等进行审查，向客户充分揭示期货交易风险，解释期货公司、客户、证券公司三者之间的权利义务关系，告知期货保证金安全存管要求。

证券公司应当及时将客户开户资料提交期货公司，期货公司应当复核后与客户签订期货经纪合同，办理开户手续。

第二十条 证券公司介绍其控股股东、实际控制人等开户的，证券公司应当将其期货账户信息报所在地中国证监会派出机构备案，并按照中国证监会的规定履行信息披露义务。

第二十一条 证券公司不得代客户下达交易指令，不得利用客户的交易编码、资金账号或者期货结算账户进行期货交易，不得代客户接收、保管或者修改交易密码。

第二十二条 证券公司不得直接或者间接为客户从事期货交易提供融资或者担保。

第二十三条 期货、现货市场行情发生重大变化或者客户可能出现风险时，证券公司及其营业部可以协助期货公司向客户提示风险。

第二十四条 证券公司应当协助维护期货交易系统的稳定运行，保证期货交易数据传送的安全和独立。

第二十五条 证券公司应当在营业场所妥善保存有关介绍业务的凭证、单据、账簿、报表、合同、数据信息等资料。

证券公司保存上述文件资料的期限不得少于 5 年。

第二十六条 证券公司应当建立并有效执行介绍业务的合规检查制度。

证券公司应当定期对介绍业务规则、内部控制、风险隔离等制度的执行情况和营业部介绍业务的开展情况进行检查，每半年向中国证监会派出机构报送合规检查报告。

发生重大事项的，证券公司应当在 2 个工作日内向所在地中国证监会派出机构报告。

第四章 监督管理

第二十七条 中国证监会及其派出机构按照审慎监管原则，对证券公司从事的介绍业务进行现场检查和非现场检查。

第二十八条 证券公司应当按照中国证监会的规定披露介绍业务的相关信息，报送介绍业务的相关文件、资料及数据信息。

第二十九条 证券公司取得介绍业务资格后不符合本办法第五条、第六条规定条件的，中国证监会及其派出机构责令其限期整改；经限期整改仍不符合条件的，中国证监会依法撤销其介绍业务资格。

第三十条 证券公司违反本办法第三章业务规则的，中国证监会及其派出机构可以采取责令限期整改、监管谈话、出具警示函等监管措施；逾期未改正，其行为可能危及

期货公司的稳健运行、损害客户合法权益的，中国证监会可以责令期货公司终止与该证券公司的介绍业务关系。

第三十一条 证券公司因其他业务涉嫌违法违规或者出现重大风险被暂停、限制业务或者撤销业务资格的，中国证监会可以责令期货公司终止与该证券公司的介绍业务关系。

第三十二条 证券公司有下列行为之一的，按照《期货交易管理条例》第七十条进行处罚：

- （一）未经许可擅自开展介绍业务；
- （二）对客户未充分揭示期货交易风险，进行虚假宣传，误导客户；
- （三）代理客户进行期货交易、结算或者交割；
- （四）收付、存取或者划转期货保证金；
- （五）为客户从事期货交易提供融资或者担保；
- （六）未按规定审查客户的开户资料 and 身份真实性；
- （七）代客户下达交易指令；
- （八）利用客户的交易编码、资金账号或者期货结算账户进行期货交易；
- （九）未将介绍业务与其他经营业务分开或者有效隔离；
- （十）未将财务、人员、经营场所与期货公司分开隔离；
- （十一）拒绝、阻碍中国证监会及其派出机构依法履行职责。

第五章 附则

第三十三条 本办法自发布之日起施行。

期货公司风险监管指标管理试行办法

中国证券监督管理委员会（证监发[2007]55号）2007年4月18日发布，自发布之日起施行。

第一章 总则

第一条 为了加强对期货公司的监督管理，促进期货公司加强内部控制，防范风险，根据《期货交易管理条例》，制定本办法。

第二条 期货公司应当按照本办法的规定编制、报送风险监管报表。

第三条 期货公司应当建立与风险监管指标相适应的内部控制制度，应当建立动态的风险监控和资本补足机制，确保净资本等风险监管指标持续符合标准。

第四条 期货公司扩大业务规模或者做出向股东分配利润等可能对净资本产生重大影响的决定前，应当对相应的风险监管指标进行敏感性测试。

第五条 期货公司应当聘请具备证券、期货相关业务资格的会计师事务所对期货公司年度风险监管报表进行审计。

会计师事务所及其注册会计师应当勤勉尽责，对出具报告所依据的文件资料内容的真实性、准确性和完整性进行核查和验证，并对出具审计报告的合法性和真实性负责。

第二章 风险监管指标的计算

第六条 期货公司风险监管指标包括期货公司净资本、净资本与净资产的比例、流动资产与流动负债的比例、负债与净资产的比例、规定的最低限额的结算准备金要求等衡量期货公司财务安全的监管指标。

第七条 本办法所称净资本是在期货公司净资产的基础上，按照变现能力对资产负债项目及其他项目进行风险调整后得出的综合性风险监管指标。

净资本的计算公式为：净资本=净资产-资产调整值+负债调整值-客户未足额追加的保证金-/+其他调整项。

第八条 期货公司应当按照分类、流动性、账龄和可回收性等不同情况采取不同比例对资产进行风险调整。

第九条 期货公司持有的金融资产，按照分类和流动性情况采取不同比例进行风险调整，分类中同时符合两个或者两个以上标准的，应当采用最高的比例进行风险调整。

第十条 期货公司应当按照账龄及其核算的具体内容，采取不同比例对应收项目进行风险调整，分类中同时符合两个或者两个以上标准的，应当采用最高的比例进行风险调整。

第十一条 期货公司计算净资本时，应当按照企业会计准则的规定对相关项目充分计提资产减值准备。

中国证监会派出机构可以要求期货公司对资产减值准备计提的充足性和合理性进行专项说明；有证据表明期货公司未能充分计提资产减值准备的，中国证监会派出机构应当要求期货公司相应核减净资本金额。

第十二条 期货公司计算净资本时，可以将“期货风险准备金”等有助于增强抗风险能力的负债项目加回。

除“期货风险准备金”外，期货公司认为某项负债需要在计算净资本时予以调整的，应当增加附注，详细说明该项负债反映的具体内容；中国证监会及其派出机构可以根据审慎监管原则决定是否同意对该项负债进行调整。

第十三条 期货公司应当按照企业会计准则的规定确认预计负债。

中国证监会派出机构可以要求期货公司对预计负债进行专项说明；有证据表明期货公司未能准确确认预计负债的，中国证监会派出机构应当要求期货公司相应核减净资本金额。

第十四条 客户保证金未足额追加的，期货公司应当相应调减净资本。客户保证金在报表报送日之前已足额追加的，期货公司可以在报表附注中说明。

未足额追加的客户保证金应当按期货交易所规定的保证金标准计算，不包括已经记入“应收风险损失款”科目的客户因穿仓形成的对期货公司的债务。

第十五条 期货公司应当在净资本计算表的附注中，充分披露期末未决诉讼、未决仲裁等或有负债的性质、涉及金额、形成原因、进展情况、可能发生的损失和预计损失的会计处理情况，并在计算净资本时按照一定比例扣减。

中国证监会及其派出机构可以根据审慎监管原则要求期货公司调整扣减比例。

第十六条 期货公司借入次级债务的，可以将所借入的次级债务按照中国证监会规定的比例计入净资本。

期货公司向股东或者其关联企业借入的具有次级债务性质的长期借款，可以在计算净资本时将所借入的长期借款按照中国证监会规定的比例计入净资本。

第十七条 客户保证金未足额追加的，期货公司在计算符合规定的最低限额的结算准备金时，应当相应扣除。客户保证金在报表报送日之前已足额追加的，期货公司可以在报表附注中说明。

未足额追加的客户保证金应当按期货交易所规定的保证金标准计算，不包括已经记入“应收风险损失款”科目的客户因穿仓形成的对期货公司的债务。

第三章 风险监管指标标准

第十八条 期货公司应当持续符合以下风险监管指标标准：

（一）净资本不得低于人民币 1500 万元；

（二）净资本不得低于客户权益总额的 6%；

（三）净资本按营业部数量平均折算额（净资本/营业部家数）不得低于人民币 300 万元；

（四）净资本与净资产的比例不得低于 40%；

（五）流动资产与流动负债的比例不得低于 100%；

（六）负债与净资产的比例不得高于 150%；

（七）规定的最低限额的结算准备金要求。

第十九条 期货公司委托其他机构提供中间介绍业务的，净资本不得低于人民币 3000 万元。

第二十条 从事交易结算业务的期货公司，净资本不得低于人民币 4500 万元。

第二十一条 从事全面结算业务的期货公司，净资本不得低于以下标准：

（一）人民币 9000 万元；

（二）客户权益总额与其代理结算的非结算会员权益或者非结算会员客户权益之和的 6%。

第二十二条 中国证监会及其派出机构可以根据审慎监管原则，结合期货公司的风险状况及风险管理能力，提高其风险监管指标标准。

第二十三条 中国证监会对第十八条至第二十一条规定的风险监管指标设置预警标准。规定“不得低于”一定标准的风险监管指标，其预警标准是规定标准的120%，规定“不得高于”一定标准的风险监管指标，其预警标准是规定标准的80%。

第四章 编制和披露

第二十四条 期货公司应当报送月度和年度风险监管报表。期货公司应当于月度终了后的7个工作日内向公司住所地中国证监会派出机构报送月度风险监管报表，在年度终了后的3个月内报送经具备证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计的年度风险监管报表。

中国证监会派出机构可以根据审慎监管原则，要求期货公司按周或者按日编制并报送风险监管报表。

第二十五条 期货公司应当指定专人负责风险监管报表的编制和报送工作。

第二十六条 期货公司法定代表人、经营管理主要负责人、财务负责人、结算负责人、制表人应当在风险监管报表上签字确认，并应当保证其真实、准确、完整。上述人员对风险监管报表内容持有异议的，应当书面说明意见和理由，向公司住所地中国证监会派出机构报送。

第二十七条 期货公司应当按照中国证监会规定的方式报送风险监管报表。

期货公司应当保留书面风险监管报表，相应责任人员应当在书面报表上签字，并加盖公司印章。该报表的保存期限应当不少于5年。

第二十八条 期货公司应当每半年向公司全体董事提交书面报告，说明净资本等各项风险监管指标的具体情况，该书面报告应当经期货公司法定代表人签字确认。

期货公司应当每半年向公司全体股东提交书面报告，说明净资本等各项风险监管指标的具体情况，该书面报告应当经全体董事签字确认，并应当取得股东的签收确认证明。

第二十九条 风险监管指标与上月相比变动超过20%的，期货公司应当向公司住所地中国证监会派出机构书面报告，说明原因，并在5个工作日内向全体董事和全体股东书面报告。

第三十条 期货公司风险监管指标达到预警标准的，期货公司应当于当日向公司住所地中国证监会派出机构书面报告，详细说明原因、对公司的影响、解决问题的具体措施和期限，还应当向公司全体董事书面报告。

期货公司风险监管指标不符合规定标准的，期货公司除履行上述程序外，还应当于当日向全体股东书面报告。

第五章 监督管理

第三十一条 期货公司未按期报送风险监管报表或者报送的风险监管报表存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏的，中国证监会派出机构应当要求期货公司限期报送或者补充更正。

期货公司未在限期内报送或者补充更正的，公司住所地中国证监会派出机构应当对公司进行现场检查，发现期货公司违反企业会计准则和本办法有关规定的，可以认定风险监管指标不符合规定标准。

第三十二条 期货公司风险监管指标达到预警标准的，进入风险预警期。

中国证监会派出机构应当在5个工作日内对公司风险监管指标触及预警标准的情况和原因进行核实，对公司的影响程度进行评估，并视情况采取下列措施：

（一）向公司出具警示函，并抄送其全体股东；

（二）对公司高级管理人员进行监管谈话，要求其优化公司风险监管指标水平；

（三）要求公司进行重大业务决策时，应当至少提前5个工作日向公司住所地中国证监会派出机构报送临时报告，说明有关业务对公司财务状况和风险监管指标的影响；

（四）责令公司增加内部合规检查的频率，并提交合规检查报告。

第三十三条 期货公司风险监管指标优于预警标准并连续保持3个月的，风险预警期结束。

第三十四条 期货公司风险监管指标不符合规定标准的，中国证监会派出机构应当在2个工作日内对公司进行现场检查，对不符合规定标准的情况和原因进行核实，并责令期货公司限期整改，整改期限不得超过20个工作日。

第三十五条 经过整改，风险监管指标符合规定标准的，期货公司应当向公司住所地中国证监会派出机构报告，中国证监会派出机构应当进行验收。

期货公司风险监管指标符合规定标准的，中国证监会派出机构应当自验收合格之日起3个工作日内解除对期货公司采取的有关措施。

第三十六条 期货公司逾期未改正或者经过整改风险监管指标仍不符合规定标准的，中国证监会及其派出机构可以依据《期货交易管理条例》第五十九条采取监管措施。

第六章 附则

第三十七条 本办法下列用语的含义：

(一) 风险监管报表, 包括期货公司风险监管指标汇总表、净资本计算表、资产调整值计算表、客户分离资产报表、客户权益变动表、经营业务报表和客户管理报表等。

(二) 资产、流动资产, 是指期货公司的自身资产, 不含客户保证金。

(三) 负债、流动负债, 是指期货公司的对外负债, 不含客户权益。

(四) 重大业务, 是指可能导致期货公司净资本等风险监管指标发生 10% 以上变化的业务。

第三十八条 本办法自发布之日起施行。本办法施行前依法设立的期货公司, 不完全符合本办法规定的, 应当在 2007 年 8 月 1 日之前达到本办法的要求。

证券期货市场统计管理办法

作者：来源：

中国证券监督管理委员会令（第 60 号）2009 年 1 月 8 日发布，自 2009 年 3 月 1 日起施行

第一章 总则

第一条 为了规范证券期货市场统计行为，发挥统计在反映证券期货市场基础信息和动态状况、加强证券期货市场监管中的作用，根据《中华人民共和国统计法》、《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《期货交易管理条例》、《证券公司监督管理条例》和《中华人民共和国统计法实施细则》等法律、行政法规，制定本办法。

第二条 证券期货市场统计的基本任务是对证券期货市场发展情况进行统计调查、统计分析，提供证券期货市场统计资料和统计咨询意见，实行统计监督。

第三条 证券期货市场统计调查对象(以下简称统计调查对象)应当如实提供证券期货市场统计资料，不得虚报、瞒报、拒报、迟报，不得伪造、篡改。

本办法所称的统计调查对象，包括证券公司、证券投资基金管理公司、期货公司及其分支机构，基金托管银行、基金销售机构、合格境外机构投资者托管银行，从事证券期货服务业务的投资咨询机构、财务顾问机构、资信评级机构、资产评估机构、会计师事务所、律师事务所，上市公司、非上市公众公司，证券期货交易所、证券登记结算机构、证券业协会、期货业协会、证券投资者保护基金公司、期货保证金监控中心等市场主体。

第四条 中国证券监督管理委员会(以下简称中国证监会)建立集中统一领导，分业务、分级负责的统计管理体制。

中国证监会负责全国证券期货市场(以下简称证券期货市场)的统计工作，中国证监会派出机构负责辖区内的证券期货统计工作。

第五条 中国证监会制定证券期货市场统计标准，发布证券期货市场统计资料或者可能影响证券期货市场稳定运行的其他统计资料。

第六条 统计资料的管理、使用和公布，应当遵守国家档案管理制度、保密制度和证券期货监督管理信息公开制度、证券期货市场诚信档案管理制度，保守统计调查对象的商业秘密，维护证券期货市场公开、公平、公正的原则。

第二章 统计机构和统计人员

第七条 中国证监会统计部门履行以下职责：

(一)组织证券期货市场统计调查工作，搜集、整理证券期货统计资料，管理、公布、汇编、对外提供证券期货市场统计资料；

(二)对证券期货市场运行、发展、风险等情况进行统计分析，编制证券期货市场统计报表，出具统计报告，提出有关的政策建议；

(三)建立健全证券期货统计制度，制定证券期货市场统计标准，完善证券期货统计指标体系，对统计法律、行政法规、本办法及中国证监会制定的统计制度的执行情况进行指导和检查监督，对中国证监会派出机构、统计调查对象的统计工作进行考核评估；

(四)建设并管理证券期货统计信息自动化系统和统计数据库体系；

(五)负责办理与会外单位之间的统计协调工作；

(六)办理中国证监会派出机构统计调查项目和证券期货市场统计调查项目补充内容的备案；

(七)组织开展证券期货市场统计人员的业务培训。

第八条 中国证监会履行监管职责的其他部门(以下简称中国证监会其他部门)对其职责范围内的统计调查对象进行统计调查，搜集、整理证券期货统计资料。

中国证监会其他部门应当配合中国证监会统计部门的工作。

第九条 中国证监会统计部门建立证券期货市场统计工作联席会议机制，其成员单位包括中国证监会统计部门、中国证监会其他部门、证券期货交易所、证券登记结算机构等。

除中国证监会统计部门之外的其他成员单位按照约定的格式与内容，定期或者不定期地向中国证监会统计部门报送本单位搜集、整理、管理的证券期货统计资料。证券期货市场统计工作联席会议机制确保成员之间实现信息互联共享，并承担以下职能：

(一)分析评价证券期货统计标准，提出补充、修改的建议；

(二)研究统计工作中遇到的新问题、新情况，加强各单位间的协调、配合；

(三)讨论其他与证券期货统计工作有关的重大事项。

第十条 中国证监会派出机构应当指定或者设立专门处室履行统计职责，其统计职责包括：

(一)配合中国证监会统计部门完成证券期货市场统计调查任务，搜集、整理、提供辖区内证券期货统计资料；

(二)组织辖区内的证券期货统计调查工作，搜集、整理、管理、公布、对外提供证券期货统计资料；

(三)对辖区内证券期货发展情况进行统计分析，出具统计报告，提出有关政策建议；

(四)对辖区内统计调查对象执行统计法律、行政法规、本办法及中国证监会制定统计制度的情况进行检查监督。

第十一条 统计调查对象应当设立统计部门或者指定部门、人员负责统计工作。

第十二条 中国证监会其他部门、派出机构配置专职的统计人员。统计调查对象应当配备专职或者兼职的统计人员。

统计人员应当具备良好的职业道德，具备必要的证券期货市场基础知识、统计专业基础知识和必备的计算机操作技能。

第十三条 统计人员应当依法如实搜集、报送统计资料。

统计人员应当对其负责搜集、审核、录入的统计资料和调查对象报送的统计资料的真实性负责，不得伪造、篡改统计资料，不得以任何方式要求统计调查对象提供不真实的统计资料。

第十四条 统计人员依法履行统计职责，不受任何单位和个人非法干预。

第十五条 中国证监会统计部门组织对统计人员的专业培训，加强职业道德教育，提高统计工作水平。

第三章 统计调查和统计分析

第十六条 中国证监会统计部门负责制定证券期货市场统计调查项目。中国证监会派出机构在执行前述统计调查项目时，可以根据本辖区的实际情况和监管工作需要，对统计调查内容作出补充，并报中国证监会统计部门备案。

中国证监会派出机构负责制定辖区内证券期货统计调查项目，并报中国证监会统计部门备案。

第十七条 中国证监会统计部门制定证券期货市场统计标准，以保障统计调查中采用的指标涵义、计算方法、分类目录、调查表式等方面的标准化。

中国证监会其他部门、中国证监会派出机构开展统计调查的，应当适用中国证监会统计部门制定的统计标准。

第十八条 中国证监会及其派出机构在组织统计调查时，应当对统计调查内容、调查对象、统计资料的报送时间、格式及方式等内容作出明确规定。

中国证监会及其派出机构可以采用公文、传真、电话、电子邮件以及网络等统计调查方式。涉及保密内容的统计调查，应当遵循保密管理的相关规定。

第十九条 统计调查对象应当在规定时限内，按照规定的统计调查内容与格式，向中国证监会及其派出机构报送统计资料。统计资料还应当符合中国证监会统计部门制定的统计标准。

第二十条 统计调查对象应当做好基层统计报表的收集、审核和汇总工作，保证统计资料的真实、准确和完整。

统计调查对象应当向中国证监会及其派出机构报送经单位负责人审核、签署的统计数据，并在填报说明中，对基层数据的上报情况及本期数据的异常变动等情况作出说明。

第二十一条 统计调查对象发现报送的统计资料有误的，应当立即报告中国证监会及其派出机构，组织本单位的统计部门或者人员予以核实订正后，及时向中国证监会及其派出机构作出书面更正与说明。必要时，还应当依法及时公开披露。

第二十二条 统计调查应当以定期调查为基础，以抽样调查为补充，综合运用全面调查、重点调查、行政业务记录等方法，搜集、整理证券期货基本统计资料。

第二十三条 中国证监会统计部门应当定期分析、研究证券期货市场和宏观经济发展情况，并就其对证券期货业发展的影响等情况进行调查研究。

中国证监会统计部门可以根据证券期货监管工作的需要，对一些市场高度关注、关系证券期货市场发展大局的情况进行分析、研究。

第二十四条 地方各级人民政府或者国务院其他部门派出机构组织证券期货统计调查的，统计调查对象应当及时向中国证监会派出机构报告。

中国证监会派出机构应当及时了解统计调查内容及其进展情况；必要时，应当及时就统计资料的一致性等问题，与地方各级人民政府或者国务院其他部门派出机构协商。

统计调查属于证券期货市场统计调查一部分的，中国证监会派出机构应当及时报告中国证监会统计部门。中国证监会统计部门应当及时就统计资料的一致性等问题，与国务院其他部门协商。

第四章 统计资料管理和公布

第二十五条 中国证监会统计部门统一管理证券期货市场统计资料。

中国证监会其他部门、派出机构负责本部门或者单位统计资料的管理工作。
统计调查对象应当按照法律、行政法规的要求，加强统计资料的管理工作。
统计资料档案的保管、调用和移交，应当遵守国家有关档案管理的规定。

第二十六条 中国证监会及其派出机构应当建立健全统计资料的审核、整理、交接和存档等管理制度。

中国证监会统计部门应当建设统一的证券期货统计信息自动化系统，实现与中国证监会其他部门、中国证监会派出机构、证券期货交易所、证券登记结算机构等单位统计资料电子化管理系统、证券期货市场诚信档案系统的对接。

第二十七条 中国证监会及其派出机构应当建立健全统计资料提供和公布制度。

证券期货市场统计资料或者可能影响证券期货市场稳定运行的统计资料应当由中国证监会统计部门对外提供或者公布。

中国证监会派出机构可以对外提供或者公布本辖区证券期货统计资料。

第二十八条 统计调查对象或者其他单位公布统计资料应当遵守法律、行政法规和中国证监会的规定，不得编造、伪造统计资料，扰乱证券期货市场秩序。

第五章 监督管理与法律责任

第二十九条 中国证监会统计部门、中国证监会派出机构可以对统计调查对象的以下情况，实施定期或者不定期检查：

- (一)统计部门或者指定负责统计工作的部门、人员的配置情况；
- (二)统计工作的独立性；
- (三)基层统计报表的收集、审核和汇总工作及其真实、准确、完整程度；
- (四)有关统计法律、行政法规、中国证监会规定的其他要求的执行情况。

第三十条 检查分为现场检查与非现场检查。

现场检查时，检查人员不得少于两人，并应当出示合法证件和检查通知书。检查人员有权采取下列措施：

- (一)询问统计调查对象的有关人员，要求其就检查事项作出说明；
- (二)查阅、复制统计调查对象与检查事项有关的文件、资料、凭证等；
- (三)要求统计调查对象及其有关人员提交与检查事项有关的自查报告。

非现场检查时，中国证监会统计部门、中国证监会派出机构可以要求统计调查对象提供备查资料及其说明或者自查报告。

第三十一条 统计调查对象应当配合中国证监会统计部门、中国证监会派出机构的检查工作。任何单位、个人不得干扰和妨碍检查工作。

第三十二条 对于违反本办法规定的统计调查对象，中国证监会可以对其采取以下监督管理措施：

- (一)责令改正；
- (二)监管谈话；
- (三)出具警示函；
- (四)责令参加培训。

第三十三条 统计调查对象有下列行为之一的，中国证监会可以给予警告，单处或者并处罚款：

- (一)虚报、瞒报、漏报统计资料；
- (二)伪造、篡改统计资料；
- (三)拒报或者无故迟报统计资料；
- (四)拒绝或者妨碍统计检查。

对前款行为负有直接责任的管理人员和其他直接责任人员，中国证监会可以给予警告，单处或者并处罚款。

第三十四条 统计调查对象或者其他单位违反本办法第二十八条规定，作出虚假陈述或者信息误导，扰乱证券期货市场的，中国证监会按照《证券法》第二百零七条、《期货交易管理条例》第七十一条的规定予以处罚。

第三十五条 统计调查对象报送的监管信息包含统计资料，其报送或者信息披露行为违反法律、行政法规、中国证监会规定的，按照相关规定处理。

第三十六条 中国证监会统计部门、中国证监会其他部门和中国证监会派出机构的工作人员违反国家有关保密规定，擅自公开证券期货统计资料的，中国证监会依照有关规定给予行政处分。

第六章 附则

第三十七条 证券期货交易所、证券期货业协会、证券登记结算机构等自律组织组织统计调查的，应当适用中国证监会统计部门规定的统一的统计标准。

前款所称的自律组织可以制定本单位统计工作制度，并报中国证监会统计部门备案。

期货公司董事、监事和高级管理人员任职资格管理办法

中国证券监督管理委员会令(第 47 号) 2007 年 7 月 4 日公布,自公布之日起施行。

第一章 总 则

第一条 为了加强对期货公司董事、监事和高级管理人员任职资格的管理,规范期货公司运作,防范经营风险,根据《公司法》和《期货交易管理条例》,制定本办法。

第二条 期货公司董事、监事和高级管理人员的任职资格管理,适用本办法。

本办法所称高级管理人员,是指期货公司的总经理、副总经理、首席风险官(以下简称经理层人员),财务负责人、营业部负责人以及实际履行上述职务的人员。

第三条 期货公司董事、监事和高级管理人员应当在任职前取得中国证券监督管理委员会(以下简称中国证监会)核准的任职资格。

期货公司不得任用未取得任职资格的人员担任董事、监事和高级管理人员。

第四条 期货公司董事、监事和高级管理人员应当遵守法律、行政法规和中国证监会的规定,遵守自律规则、行业规范和公司章程,恪守诚信,勤勉尽责。

第五条 中国证监会依法对期货公司董事、监事和高级管理人员进行监督管理。

中国证监会派出机构依照本办法和中国证监会的授权对期货公司董事、监事和高级管理人员进行监督管理。

中国期货业协会、期货交易所依法对期货公司董事、监事和高级管理人员进行自律管理。

第二章 任职资格条件

第六条 申请期货公司董事、监事和高级管理人员的任职资格,应当具有诚实守信的品质、良好的职业道德和履行职责所必需的经营管理能力。

第七条 申请除董事长、监事会主席、独立董事以外的董事、监事的任职资格,应当具备下列条件:

(一)具有从事期货、证券等金融业务或者法律、会计业务 3 年以上经验,或者经济管理工作 5 年以上经验;

(二) 具有大学专科以上学历。

第八条 申请独立董事的任职资格，应当具备下列条件：

(一) 具有从事期货、证券等金融业务或者法律、会计业务 5 年以上经验，或者具有相关学科教学、研究的高级职称；

(二) 具有大学本科以上学历，并且取得学士以上学位；

(三) 通过中国证监会认可的资质测试；

(四) 有履行职责所必需的时间和精力。

第九条 下列人员不得担任期货公司独立董事：

(一) 在期货公司或者其关联方任职的人员及其近亲属和主要社会关系人员；

(二) 在下列机构任职的人员及其近亲属和主要社会关系人员：持有或者控制期货公司 5%以上股权的单位、期货公司前 5 名股东单位、与期货公司存在业务联系或者利益关系的机构；

(三) 为期货公司及其关联方提供财务、法律、咨询等服务的人员及其近亲属；

(四) 最近 1 年内曾经具有前三项所列举情形之一的人员；

(五) 在其他期货公司担任除独立董事以外职务的人员；

(六) 中国证监会认定的其他人员。

第十条 申请董事长和监事会主席的任职资格，应当具备下列条件：

(一) 具有从事期货业务 3 年以上经验，或者其他金融业务 4 年以上经验，或者法律、会计业务 5 年以上经验；

(二) 具有大学本科以上学历或者取得学士以上学位；

(三) 通过中国证监会认可的资质测试。

第十一条 申请经理层人员的任职资格，应当具备下列条件：

(一) 具有期货从业人员资格；

(二) 具有大学本科以上学历或者取得学士以上学位；

(三) 通过中国证监会认可的资质测试。

第十二条 申请总经理、副总经理的任职资格，除具备第十一条规定条件外，还应当具备下列条件：

(一) 具有从事期货业务 3 年以上经验，或者其他金融业务 4 年以上经验，或者法律、会计业务 5 年以上经验；

(二) 担任期货公司、证券公司等金融机构部门负责人以上职务不少于 2 年，或者具有相当职位管理工作经历。

第十三条 申请首席风险官的任职资格，除具备第十一条规定条件外，还应当具有从事期货业务 3 年以上经验，并担任期货公司交易、结算、风险管理或者合规负责人职务不少于 2 年；或者具有从事期货业务 1 年以上经验，并具有在证券公司等金融机构从事风险管理、合规业务 3 年以上经验。

第十四条 申请财务负责人、营业部负责人的任职资格，应当具备下列条件：

(一) 具有期货从业人员资格；

(二) 具有大学本科以上学历或者取得学士以上学位。

申请财务负责人的任职资格，还应当具有会计师以上职称或者注册会计师资格；申请营业部负责人的任职资格，还应当具有从事期货业务 3 年以上经验，或者其他金融业务 4 年以上经验。

第十五条 期货公司法定代表人应当具有期货从业人员资格。

第十六条 具有从事期货业务 10 年以上经验或者曾担任金融机构部门负责人以上职务 8 年以上的人员，申请期货公司董事长、监事会主席、高级管理人员任职资格的，学历可以放宽至大学专科。

第十七条 具有期货等金融或者法律、会计专业硕士研究生以上学历的人员，申请期货公司董事、监事和高级管理人员任职资格的，从事除期货以外的其他金融业务，或者法律、会计业务的年限可以放宽 1 年。

第十八条 在期货监管机构、自律机构以及其他承担期货监管职能的专业监管岗位任职 8 年以上的人员，申请期货公司高级管理人员任职资格的，可以免试取得期货从业人员资格。

第十九条 有下列情形之一的，不得申请期货公司董事、监事和高级管理人员的任职资格：

(一)《公司法》第一百四十七条规定的情形；

(二)因违法行为或者违纪行为被解除职务的期货交易所、证券交易所、证券登记结算机构的负责人，或者期货公司、证券公司的董事、监事、高级管理人员，自被解除职务之日起未逾5年；

(三)因违法行为或者违纪行为被撤销资格的律师、注册会计师或者投资咨询机构、财务顾问机构、资信评级机构、资产评估机构、验证机构的专业人员，自被撤销资格之日起未逾5年；

(四)因违法行为或者违纪行为被开除的期货交易所、证券交易所、证券登记结算机构、证券服务机构、期货公司、证券公司的从业人员和被开除的国家机关工作人员，自被开除之日起未逾5年；

(五)国家机关工作人员和法律、行政法规规定的禁止在公司中兼职的其他人员；

(六)因违法违规行为受到金融监管部门的行政处罚，执行期满未逾3年；

(七)自被中国证监会或者其派出机构认定为不适当人选之日起未逾2年；

(八)因违法违规行为或者出现重大风险被监管部门责令停业整顿、托管、接管或者撤销的金融机构及分支机构，其负有责任的主管人员和其他直接责任人员，自该金融机构及分支机构被停业整顿、托管、接管或者撤销之日起未逾3年；

(九)中国证监会认定的其他情形。

第三章 任职资格的申请与核准

第二十条 期货公司董事长、监事会主席、独立董事、经理层人员的任职资格，由中国证监会依法核准。经中国证监会授权，可以由中国证监会派出机构依法核准。

除董事长、监事会主席、独立董事以外的董事、监事和财务负责人的任职资格，由期货公司住所地的中国证监会派出机构依法核准。

营业部负责人的任职资格由期货公司营业部所在地的中国证监会派出机构依法核准。

第二十一条 申请期货公司董事长、监事会主席、独立董事的任职资格，应当由拟任职期货公司向中国证监会或者其授权的派出机构提出申请，并提交下列申请材料：

(一)申请书；

(二)任职资格申请表；

(三)2名推荐人的书面推荐意见；

- (四) 身份、学历、学位证明；
- (五) 资质测试合格证明；
- (六) 中国证监会规定的其他材料。

申请独立董事任职资格的，还应当提供拟任人关于独立性的声明，声明应当重点说明其本人是否存在本办法第九条所列举的情形。

第二十二条 申请经理层人员的任职资格，应当由本人或者拟任职期货公司向中国证监会或者其授权的派出机构提出申请，并提交下列申请材料：

- (一) 申请书；
- (二) 任职资格申请表；
- (三) 2 名推荐人的书面推荐意见；
- (四) 身份、学历、学位证明；
- (五) 期货从业人员资格证书；
- (六) 资质测试合格证明；
- (七) 中国证监会规定的其他材料。

第二十三条 推荐人应当是任职 1 年以上的期货公司现任董事长、监事会主席或者经理层人员。

拟任人不具有期货从业经历的，推荐人中可有 1 名是其原任职单位的负责人。拟任人为境外人士的，推荐人中可有 1 名是拟任人曾任职的境外期货经营机构的经理层人员。

推荐人应当了解拟任人的个人品行、遵纪守法、从业经历、业务水平、管理能力等情况，承诺推荐内容的真实性，对拟任人是否存在本办法第十九条所列举的情形作出说明，并发表明确的推荐意见。

推荐人每年最多只能推荐 3 人申请期货公司董事长、监事会主席、独立董事或者经理层人员的任职资格。

第二十四条 申请除董事长、监事会主席、独立董事以外的董事、监事和财务负责人的任职资格，应当由拟任职期货公司向公司住所地的中国证监会派出机构提出申请，并提交下列申请材料：

- (一) 申请书;
- (二) 任职资格申请表;
- (三) 身份、学历、学位证明;
- (四) 中国证监会规定的其他材料。

申请财务负责人任职资格的,还应当提交期货从业人员资格证书,以及会计师以上职称或者注册会计师资格的证明。

第二十五条 申请营业部负责人的任职资格,应当由拟任职期货公司向营业部所在地的中国证监会派出机构提出申请,并提交下列申请材料:

- (一) 申请书;
- (二) 任职资格申请表;
- (三) 身份、学历、学位证明;
- (四) 期货从业人员资格证书;
- (五) 中国证监会规定的其他材料。

第二十六条 申请人提交境外大学或者高等教育机构学位证书或者高等教育文凭,或者非学历教育文凭的,应当同时提交国务院教育行政部门对拟任人所获教育文凭的学历学位认证文件。

第二十七条 中国证监会或者其派出机构通过审核材料、考察谈话、调查从业经历等方式,对拟任人的能力、品行和资历进行审查。

第二十八条 申请人或者拟任人有下列情形之一的,中国证监会或者其派出机构可以作出终止审查的决定:

- (一) 拟任人死亡或者丧失行为能力;
- (二) 申请人依法解散;
- (三) 申请人撤回申请材料;
- (四) 申请人未在规定期限内针对反馈意见作出进一步说明、解释;
- (五) 申请人或者拟任人因涉嫌违法违规行为被有权机关立案调查;

(六) 申请人被依法采取停业整顿、托管、接管、限制业务等监管措施;

(七) 申请人或者拟任人因涉嫌犯罪被司法机关立案侦查;

(八) 中国证监会认定的其他情形。

第二十九条 期货公司应当自拟任董事、监事、财务负责人、营业部负责人取得任职资格之日起 30 个工作日内, 按照公司章程等有关规定办理上述人员的任职手续。自取得任职资格之日起 30 个工作日内, 上述人员未在期货公司任职, 其任职资格自动失效, 但有正当理由并经中国证监会相关派出机构认可的除外。

第三十条 期货公司任用董事、监事和高级管理人员, 应当自作出决定之日起 5 个工作日内, 向中国证监会相关派出机构报告, 并提交下列材料:

- (一) 任职决定文件;
- (二) 相关会议的决议;
- (三) 相关人员的任职资格核准文件;
- (四) 高级管理人员职责范围的说明;
- (五) 中国证监会规定的其他材料。

第三十一条 期货公司免除董事、监事和高级管理人员的职务, 应当自作出决定之日起 5 个工作日内, 向中国证监会相关派出机构报告, 并提交下列材料:

- (一) 免职决定文件;
- (二) 相关会议的决议;
- (三) 中国证监会规定的其他材料。

期货公司拟免除首席风险官的职务, 应当在作出决定前 10 个工作日将免职理由及其履行职责情况向公司住所地的中国证监会派出机构报告。

第三十二条 期货公司任用境外人士担任经理层人员职务的比例不得超过公司经理层人员总数的 30%。

第三十三条 期货公司董事、监事和高级管理人员不得在党政机关兼职。

期货公司高级管理人员最多可以在期货公司参股的 2 家公司兼任董事、监事, 但不得在上述公司兼任董事、监事之外的职务, 不得在其他营利性机构兼职或者从事其他经营性活动。

期货公司营业部负责人不得兼任其他营业部负责人。

独立董事最多可以在 2 家期货公司兼任独立董事。

期货公司董事、监事和高级管理人员兼职的，应当自有关情况发生之日起 5 个工作日内向中国证监会相关派出机构报告。

第三十四条 期货公司董事、监事、财务负责人、营业部负责人离任的，其任职资格自离任之日起自动失效。

有以下情形的，不受前款规定所限：

（一）期货公司除董事长、监事会主席、独立董事以外的董事、监事，在同一期货公司内由董事改任监事或者由监事改任董事；

（二）在同一期货公司内，董事长改任监事会主席，或者监事会主席改任董事长，或者董事长、监事会主席改任除独立董事之外的其他董事、监事；

（三）在同一期货公司内，营业部负责人改任其他营业部负责人。

第三十五条 期货公司董事长、监事会主席、独立董事离任后到其他期货公司担任董事长、监事会主席、独立董事的，应当重新申请任职资格。上述人员离开原任职期货公司不超过 12 个月，且未出现本办法第十九条规定情形的，拟任职期货公司应当提交下列申请材料：

（一）申请书；

（二）任职资格申请表；

（三）拟任人在原任职期货公司任职情况的陈述；

（四）中国证监会规定的其他材料。

第三十六条 取得经理层人员任职资格的人员，担任董事（不包括独立董事）、监事、营业部负责人职务，不需重新申请任职资格，由拟任职期货公司按照规定依法办理其任职手续。

第四章 行为规则

第三十七条 期货公司董事应当按照公司章程的规定出席董事会会议，参加公司的活动，切实履行职责。

第三十八条 期货公司独立董事应当重点关注和保护客户、中小股东的利益，发表客观、

公正的独立意见。

第三十九条 期货公司高级管理人员应当遵循诚信原则，谨慎地在职权范围内行使职权，维护客户和公司的合法利益，不得从事或者配合他人从事损害客户和公司利益的活动，不得利用职务之便为自己或者他人谋取属于本公司的商业机会。

第四十条 期货公司董事、监事和高级管理人员的近亲属在期货公司从事期货交易的，有关董事、监事和高级管理人员应当在知悉或者应当知悉之日起 5 个工作日内向公司报告，并遵循回避原则。公司应当在接到报告之日起 5 个工作日内向中国证监会相关派出机构备案，并定期报告相关交易情况。

第四十一条 期货公司总经理应当认真执行董事会决议，有效执行公司制度，防范和化解经营风险，确保经营业务的稳健运行和客户保证金安全完整。副总经理应当协助总经理工作，忠实履行职责。

第四十二条 期货公司董事、监事和高级管理人员不得收受商业贿赂或者利用职务之便牟取其他非法利益。

第五章 监督管理

第四十三条 中国证监会对取得经理层人员任职资格但未实际任职的人员实行资格年检。

上述人员应当自取得任职资格的下一个年度起，在每年第一季度向住所地的中国证监会派出机构提交由单位负责人或者推荐人签署意见的年检登记表，对是否存在本办法第十九条所列举的情形作出说明。

第四十四条 取得经理层人员任职资格但未实际任职的人员，未按规定参加资格年检，或者未通过资格年检，或者连续 5 年未在期货公司担任经理层人员职务的，应当在任职前重新申请取得经理层人员的任职资格。

第四十五条 期货公司董事长、监事会主席、独立董事、经理层人员和取得经理层人员任职资格但未实际任职的人员，应当至少每 2 年参加 1 次由中国证监会认可、行业自律组织举办的业务培训，取得培训合格证书。

第四十六条 期货公司董事长、总经理、首席风险官在失踪、死亡、丧失行为能力等特殊情形下不能履行职责的，期货公司可以按照公司章程等规定临时决定由符合相应任职资格条件的人员代为履行职责，并自作出决定之日起 3 个工作日内向中国证监会及其派出机构报告。

公司决定的人员不符合条件的，中国证监会及其派出机构可以责令公司更换代为履行职责的人员。

代为履行职责的时间不得超过 6 个月。公司应当在 6 个月内任用具有任职资格的人员担

任董事长、总经理、首席风险官。

第四十七条 期货公司调整高级管理人员职责分工的，应当在 5 个工作日内向中国证监会相关派出机构报告。

第四十八条 期货公司董事、监事和高级管理人员因涉嫌违法违规行为被有权机关立案调查或者采取强制措施的，期货公司应当在知悉或者应当知悉之日起 3 个工作日内向中国证监会相关派出机构报告。

第四十九条 期货公司对董事、监事和高级管理人员给予处分的，应当自作出决定之日起 5 个工作日内向中国证监会相关派出机构报告。

第五十条 期货公司董事、监事和高级管理人员受到非法或者不当干预，不能正常依法履行职责，导致或者可能导致期货公司发生违规行为或者出现风险的，该人员应当及时向中国证监会相关派出机构报告。

第五十一条 期货公司有下列情形之一的，中国证监会及其派出机构可以责令改正，并对负有责任的主管人员和其他直接责任人员进行监管谈话，出具警示函：

- （一）法人治理结构、内部控制存在重大隐患；
- （二）未按规定报告高级管理人员职责分工调整的情况；
- （三）未按规定报告相关人员代为履行职责的情况；
- （四）未按规定报告董事、监事和高级管理人员的近亲属在本公司从事期货交易的情况；
- （五）未按规定对离任人员进行离任审计；
- （六）中国证监会认定的其他情形。

第五十二条 期货公司董事、监事和高级管理人员有下列情形之一的，中国证监会及其派出机构可以责令改正，并对其进行监管谈话，出具警示函：

- （一）未按规定履行职责；
- （二）未按规定参加业务培训；
- （三）违规兼职或者未按规定报告兼职情况；
- （四）未按规定报告近亲属在本公司从事期货交易的情况；
- （五）中国证监会认定的其他情形。

第五十三条 期货公司任用境外人士担任经理层人员职务的比例违反本办法规定的，中国证监会及其派出机构可以责令公司更换或调整经理层人员。

第五十四条 期货公司董事、监事和高级管理人员在任职期间出现下列情形之一的，中国证监会及其派出机构可以将其认定为不适当人选：

- （一）向中国证监会提供虚假信息或者隐瞒重大事项，造成严重后果；
- （二）拒绝配合中国证监会依法履行监管职责，造成严重后果；
- （三）擅离职守，造成严重后果；
- （四）1年内累计3次被中国证监会及其派出机构进行监管谈话；
- （五）累计3次被行业自律组织纪律处分；
- （六）对期货公司出现违法违规行为或者重大风险负有责任；
- （七）中国证监会认定的其他情形。

第五十五条 期货公司董事、监事和高级管理人员被中国证监会及其派出机构认定为不适当人选的，期货公司应当将该人员免职。

自被中国证监会及其派出机构认定为不适当人选之日起2年内，任何期货公司不得任用该人员担任董事、监事和高级管理人员。

第五十六条 中国证监会建立期货公司董事、监事和高级管理人员诚信档案，记录董事、监事和高级管理人员的合规和诚信情况。

第五十七条 推荐人签署的意见有虚假陈述的，自中国证监会及其派出机构作出认定之日起2年内不再受理该推荐人的推荐意见和签署意见的年检登记表，并记入该推荐人的诚信档案。

第五十八条 期货公司董事长、总经理辞职，或者被认定为不适当人选而被解除职务，或者被撤销任职资格的，期货公司应当委托具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所对其进行离任审计，并自其离任之日起3个月内将审计报告报中国证监会及其派出机构备案。

期货公司无故拖延或者拒不审计的，中国证监会及其派出机构可以指定具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所进行审计。有关审计费用由期货公司承担。

第六章 法律责任

第五十九条 申请人或者拟任人隐瞒有关情况或者提供虚假材料申请任职资格的，中

中国证监会及其派出机构不予受理或者不予行政许可，并依法予以警告。

第六十条 申请人或者拟任人以欺骗、贿赂等不正当手段取得任职资格的，应当予以撤销，对负有责任的公司和人员予以警告，并处以 3 万元以下罚款。

第六十一条 期货公司有下列情形之一的，根据《期货交易管理条例》第七十条处罚：

- （一）任用未取得任职资格的人员担任董事、监事和高级管理人员；
- （二）任用中国证监会及其派出机构认定的不适当人选担任董事、监事和高级管理人员；
- （三）未按规定报告董事、监事和高级管理人员的任免情况，或者报送的材料存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- （四）未按规定报告董事、监事和高级管理人员的处分情况；
- （五）董事、监事和高级管理人员被有权机关立案调查或者采取强制措施的，未按规定履行报告义务；
- （六）未按照中国证监会的要求更换或者调整董事、监事和高级管理人员。

第六十二条 期货公司董事、监事和高级管理人员收受商业贿赂或者利用职务之便牟取其他非法利益的，没收违法所得，并处 3 万元以下罚款；情节严重的，暂停或者撤销任职资格。

第六十三条 违反本办法，涉嫌犯罪的，依法移送司法机关，追究刑事责任。

第七章 附 则

第六十四条 期货公司现任法定代表人不具有期货从业资格，应当自本办法施行之日起 1 年内取得期货从业资格。逾期未取得期货从业资格的，不得继续担任法定代表人。

第六十五条 本办法自公布之日起施行。中国证监会发布的《期货经纪公司高级管理人员任职资格管理办法（修订）》（证监发[2002]6 号）、《关于期货经纪公司高级管理人员任职资格审核有关问题的通知》（证监期货字[2004]67 号）、《期货经纪公司高级管理人员任职资格年检工作细则》（证监期货字[2003]110 号）、《关于落实对涉嫌违法违规期货公司高管人员及相关人员责任追究的通知》（证监期货字[2005]159 号）同时废止。

沪深 300 股指期货合约

合约标的	沪深 300 指数
合约乘数	每点 300 元
报价单位	指数点
最小变动价位	0.2 点
合约月份	当月、下月及随后两个季月
交易时间	上午：9:15-11:30，下午：13:00-15:15
最后交易日交易时间	上午：9:15-11:30，下午：13:00-15:00
每日价格最大波动限制	上一个交易日结算价的±10%
最低交易保证金	合约价值的 12%
最后交易日	合约到期月份的第三个周五，遇国家法定假日顺延
交割日期	同最后交易日
交割方式	现金交割
交易代码	IF
上市交易所	中国金融期货交易所