

中国金融期货交易所

指定存管银行管理办法

(2013年8月14日实施 2015年4月3日第一次修订)

第一章 总则

第一条 为规范中国金融期货交易所(以下简称交易所)期货保证金存管业务,确保期货保证金存管安全和期货交易的平稳运行,根据《中国金融期货交易所交易规则》、《中国金融期货交易所结算细则》等规定,制定本办法。

第二条 本办法所称期货保证金存管业务是指银行业金融机构吸收期货保证金进行存管并从事与此相关业务的行为。银行业金融机构从事期货保证金存管业务应当经交易所审核指定。

第三条 银行业金融机构从事期货保证金存管业务应当遵守法律、行政法规、规章和交易所业务规则,接受交易所自律监管。

第二章 资格申请

第四条 银行业金融机构申请期货保证金存管业务资格，应当具备下列条件：

（一）中华人民共和国境内设立的全国性银行业金融机构法人；

（二）注册资本达到 100 亿元人民币；总资产在 15000 亿元人民币以上，净资产在 1000 亿元人民币以上，最近 3 个会计年度连续盈利；

（三）符合中国银行业监督管理机构对银行业金融机构资本充足率、流动性、资产负债比例等的规定；

（四）分支机构在 600 个以上，且在期货交易所所在地设有可以办理期货保证金存管业务及资金结算相关业务的分支机构；

（五）具有良好的公司治理、风险管理体系和内部控制制度；

（六）设有专门机构或部门负责期货保证金存管业务；

（七）具有健全的期货保证金存管制度，制定与期货保证金存管业务相关的内部管理制度、操作流程以及技术和通讯系统故障等异常情况下的应急处理预案；

（八）具有开展期货保证金存管业务和配合期货保证金安全存管监控所需的设施和技术水平，最近 3 年高效稳定的异地资金划拨系统，覆盖全国范围的行内实时汇划系统，以及服务良好的全国集中式银期转账系统；

（九）交易所指定的期货保证金存管网点人员中，至少3名已取得期货从业资格，且交易所结算专柜人员必须取得期货从业资格，其中管理人员还应当具有5年以上银行业金融机构从业经验；

（十）最近3年内无重大违法违规行为，未发生过重大事故及未受到过监管机构的重大行政处罚；

（十一）无严重影响其资信状况的未决诉讼或未清偿债务；

（十二）交易所规定的其他条件；

合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者的托管银行，申请仅为其所托管的合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者开展期货保证金存管业务的，应当具备前款第（三）项、第（五）项至第（十二）项规定的条件，并取得中国证券登记结算有限责任公司结算银行资格。

第五条 银行业金融机构申请期货保证金存管业务资格，应当向交易所提交下列预审材料并加盖公章；

（一）期货保证金存管业务资格申请表、申请报告、可行性报告及业务计划书；

（二）分支机构、营业网点以及开展期货保证金存管业务所需设施的情况说明；

（三）期货保证金存管制度、内部管理制度以及相关的应急处理预案；

(四) 期货保证金存管业务部门的岗位设置和职责规定,以及部门负责人和业务人员名单、履历;

(五) 遵守期货保证金安全存管监控有关规定的承诺书;

(六) 最新年检的《企业法人营业执照》复印件;

(七) 《金融业务许可证》复印件;

(八) 最近三年的审计报告以及内部控制评价报告;

(九) 企业法人的授权书及经办人员的身份证明文件;

(十) 交易所要求提供的其他文件。

第六条 银行业金融机构申请并通过交易所对其期货保证金存管银行资格预审后,应当按照交易所及中国期货保证金监控中心(以下简称监控中心)的要求通过相关业务、技术、通讯设备等方面的测试,并向交易所提供下列材料:

(一) 监控中心出具的关于通过期货保证金安全存管监控数据报送测试的书面证明材料;

(二) 与期货公司(或其他期货市场参与者)进行全国集中式银期转账系统测试报告;

(三) 交易所指定期货保证金存管业务分支机构(以下简称指定网点)营业执照复印件;

(四) 交易所要求提供的其他文件。

第七条 银行业金融机构应当在交易所审核决定做出后3个工作日内向银行业监督管理机构报告。

第八条 银行业金融机构取得期货保证金存管银行资

格后，应当与交易所签订《期货保证金存管银行协议》，明确双方各自的权利和义务。

第三章 业务要求

第九条 从事期货保证金存管业务的银行业金融机构（以下简称存管银行）应当为其期货保证金存管业务的客户及交易所提供安全、准确、迅捷的期货保证金存管及划转服务。

第十条 存管银行应在距离交易所指定范围内设置交易所指定网点，网点内应当设置交易所结算专柜，并提供专项服务。

第十一条 存管银行应当根据交易所提出的申请为交易所开立专用结算账户、结算担保金专用账户等账户，账户信息应当体现业务性质。

第十二条 存管银行应当根据交易所结算会员的申请和交易所签发的专用通知书为结算会员开立、变更或者注销专用资金账户、结算担保金专用账户等账户，账户信息应当体现业务性质。

第十三条 交易所与会员之间期货业务资金的往来通过第十一条与第十二条中开设的专用账户办理。

第十四条 存管银行应当根据交易所交易和结算时间

的变化，相应调整业务办理时间，满足期货保证金存管业务的需要。

第十五条 存管银行应当按照与交易所协商确定的存款利率向交易所支付利息。

第十六条 当交易所的资金结算出现流动性需求时，经交易所申请，存管银行应当给予相应的资金配合，协助化解交易所风险。

第十七条 存管银行应当拒绝任何其他单位或个人对交易所专用结算账户内的资金进行冻结、扣划，确保交易所存放的期货保证金资金的安全；如有其他机构拟对结算会员专用资金账户采取冻结等影响保证金存管业务的措施时，存管银行应当及时通知交易所。

第十八条 存管银行应当按照由交易所资金划转系统发送的电子划款指令或书面划款指令及时办理划款业务：

（一）对于划入交易所专用结算账户的款项，应当在资金到账后立即记入交易所账户，并实时通过资金划转系统或书面传真将收款信息通知交易所；

（二）对于本行系统内账户的资金划拨，应当在收到交易所划款指令后立即（最长不得超过1小时）将资金汇划至交易所指定的结算会员专用资金账户；

（三）对于跨行的资金划拨，应当在收到交易所划款指令后立即以最快捷的方式划出款项，并保证该款项即时到达

交易所指定的收款账户开户银行。如遇特殊情况，应在当日下午四时前到达交易所指定的收款账户开户银行。

第十九条 存管银行应当按照以下规定每日与交易所进行专用结算账户账务核对：

（一）每日结算业务结束后进行对账；

（二）在营业时间内，交易所可以随时查询在存管银行的专用结算账户的余额及变动情况，且存管银行应当实时回送查询结果。

（三）向交易所送达当日交易所进账单、收付款明细清单等业务凭证；

（四）按照交易所的要求及时提供资金结算账户对账单。

第二十条 存管银行应当按照期货保证金安全存管的有关规定，通过转账方式办理期货保证金存取业务，对期货保证金实行封闭运行。

第二十一条 存管银行应当按照期货保证金安全存管监控的有关规定通过网络专线在规定时间内向监控中心报送在该行开设的全部期货保证金账户前一交易日的账户余额、变动明细等相关信息。

第二十二条 存管银行应当采取有效措施，减少资金的流动性风险，未经交易所书面同意，不得无故限制会员出入金。

第二十三条 存管银行应当保证交易所指定营业网点

的业务和人员的稳定性，定期组织业务人员培训，积极参加交易所组织的业务培训，保证业务人员熟练掌握期货保证金存管业务的流程及交易所关于期货保证金存管和资金结算业务的规则、要求。

第二十四条 存管银行不得协助交易所会员在其期货保证金账户上设定担保。

第二十五条 存管银行承诺合规运行、不挪用客户保证金，并接受交易所自律监管。

第四章 技术要求

第二十六条 存管银行的资金划转系统应当满足交易所相关技术规范要求，并通过交易所的功能测试和性能测试。

第二十七条 存管银行的全国集中式银期转账系统应当能够支持交易所会员系统多点同时接入，并满足银期转账系统的冗余要求。

第二十八条 存管银行应当申请总行主备数据中心与交易所主备数据中心之间可靠冗余的数据通讯链路，相关网络参数由交易所统一分配。

第二十九条 存管银行应当将资金划转系统纳入技术系统的统一运维管理流程，对资金划转系统、数据链路和硬件平台进行实时监控。

第三十条 存管银行变更资金划转系统应用或网络系统的，应当提前 5 个工作日通知交易所技术中心，并提前做好系统测试工作。

第三十一条 存管银行应当积极配合参与交易所组织的应急演练和联合测试。

第三十二条 存管银行应当设立 7*24 小时的技术应急联系人，应急联系人发生变更时应当及时向交易所技术中心报备。

第五章 应急处理

第三十三条 存管银行应当建立完善的期货保证金存管银行网络与信息安全事件应急预案，做到职责明确、措施到位、反应快速、处置及时。

第三十四条 存管银行应当在交易所指定范围内设置应急网点（除交易所指定的营业网点外），应急网点在技术系统、通讯设备等方面应当符合交易所的要求。

第三十五条 存管银行发现资金划转系统发生故障的，应当立即通知交易所，并积极配合对系统进行检查，以确定原因、排除故障、明确责任。如有必要，可立即启动应急措施。

第三十六条 存管银行在其发生影响期货保证金存管

业务运行稳定和安全的条件下，应当立即启动应急预案，尽快恢复正常运行，并将相关情况报告交易所和监控中心。

第六章 监督管理

第三十七条 存管银行的期货保证金存管业务部门的岗位设置、职责规定、部门负责人、业务联系人等发生变更的，应当于变更发生之日起3个工作日内书面报告交易所和监控中心。

第三十八条 存管银行出现影响该行资信状况的重大业务风险或者损失时，应当于风险或损失发生之日起3个工作日内向交易所和监控中心报告，并提交有关该业务风险或损失对该行保证金存管业务的影响及应对措施的报告。

第三十九条 存管银行实施系统升级改造或者实施其他可能影响期货保证金存管业务的措施前，应当提前5个工作日书面通知交易所、监控中心和交易所相关会员，并做好信息披露和系统测试工作，并制定针对性应急预案。

第四十条 存管银行应当在每一年度结束后1个月内，向交易所和监控中心提交有关期货保证金存管业务经营、技术运行、风险管理以及相关法律、行政法规、规章、政策执行情况的报告。

第四十一条 交易所对存管银行期货保证金存管业务

资格条件进行复核、年度考核或者根据需要进行不定期考核时，存管银行应当予以配合。

第四十二条 交易所对存管银行的期货保证金存管业务进行年度考核，综合考核其开展期货保证金存管业务的时效性、安全性和准确性。考核内容包括资格条件、系统运维、人员配置、业务运营和风险控制等；考核方式包括存管银行自查、现场检查、结算会员评分等。

考核结果分为“优秀”、“良好”、“合格”、“不合格”四个档次，考核结果将向各存管银行进行通报。

第四十三条 交易所可以参考年度考评结果统筹安排存管银行的业务及双方合作项目，指导和监督存管银行的保证金存管业务。

第七章 违规处理

第四十四条 存管银行出现下列情形之一的，责令整改并根据情节轻重，采取书面警示、通报批评、暂停新增结算会员的存管业务等措施：

- （一）存管银行未按照本办法要求履行相关义务的；
- （二）发生影响或可能影响期货保证金存管业务的情况时，存管银行未采取有效措施，可能危及期货市场稳健运行，损害交易所结算会员、客户合法权益的；

（三）存管银行未能按照监控中心相关要求报送期货保证金安全存管业务数据的；

（四）未经交易所书面同意，无故限制会员公司出入金的；

（五）违反期货保证金存管业务协议或者交易所业务规则的；

（六）发生可能影响期货资金结算业务的业务操作失误或技术系统故障时，未立即通知交易所的，或未及时采取有效措施处理的；

（七）不符合银行业监督管理机构关于资本充足率、流动性、资产负债比例等指标要求的；

（八）未配合交易所对存管银行资金结算业务进行准入资格复核，不定期检查及年度考核，或者未按照要求提交上年度存管业务和期货结算业务总结报告或其他要求提供的材料的；

（九）结算会员普遍反映存管银行服务质量不佳，全国集中式银期转账系统不稳定的；

（十）交易所认定的其他情况。

第四十五条 存管银行出现以下情况之一的，暂停全部存管业务：

（一）未能采取有效措施，导致交易所专用结算账户内的资金被冻结或扣划的；

- (二) 协助交易所会员在期货保证金账户上设定担保;
- (三) 最近 1 个会计年度发生亏损的;
- (四) 交易所认定的其他情况。

第四十六条 对于暂停期货保证金存管业务的存管银行,交易所认为其整改后重新具备正常开展期货保证金存管业务能力的,可以恢复其业务资格。

第四十七条 存管银行出现以下情形之一的,交易所可以取消其期货保证金存管业务资格:

- (一) 申请终止其期货保证金存管业务资格;
- (二) 被依法撤销、解散或宣告破产;
- (三) 被收购或兼并且丧失法人地位;
- (四) 不再满足期货保证金存管业务资格条件;
- (五) 最近 3 个会计年度连续发生亏损;
- (六) 最近 1 个年度考核结果不合格;
- (七) 向交易所提供虚假材料信息的;
- (八) 交易所认为该存管银行存在重大风险隐患;
- (九) 交易所规定的其他情况。

第四十八条 交易所取消存管银行期货保证金存管业务资格的,提前 10 个工作日向存管银行发出取消通知,并上报中国证监会,同时通过交易所网站予以公告。

存管银行期货保证金存管业务资格的取消不影响该行与交易所已经存在的法律关系,交易所依法与该行了结

相关业务关系。

第四十九条 被交易所取消期货保证金存管业务资格的银行业金融机构，自取消之日起3年内不得再申请期货保证金存管业务资格。

第八章 附则

第五十条 除有国家法律、法规规定外，未经交易所同意，存管银行不得以任何方式向第三方披露其在期货保证金存管业务及期货资金结算业务过程中接触到的与交易所有关的任何非公开信息。

第五十一条 本办法实施前已开展业务的存管银行，无需重新申请期货保证金存管业务资格。

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2015年4月3日起实施。

附件 1:

期货保证金存管业务资格申请表

| | | |
|---------------|-------|--|
| 申请人全称 | | |
| 注册地址 | | |
| 注册资本 | | |
| 邮政编码 | | |
| 法定代表人姓名 | | |
| 企业法人营业执照号码 | | |
| 金融业务许可证号码 | | |
| 存管业务负责部门 | | |
| 联系电话 | | |
| 传真电话 | | |
| 存管银行业务 负责人 | 姓名 | |
| | 部门及职务 | |
| | 联系方式 | |
| 上海分行业务 负责人 | 姓名 | |
| | 部门及职务 | |
| | 联系方式 | |
| 上海分行技术 负责人 | 姓名 | |
| | 部门及职务 | |
| | 联系方式 | |

| | | | | |
|------------------------|--|--------|--|--|
| 指定网点上级 机构业务负责 人 | 姓名 | | | |
| | 部门及职务 | | | |
| | 联系方式 | | | |
| 经办人姓名 | | | | |
| 经办人身份证号码 | | | | |
| 经办人联系电话 | | | | |
| 申请人基本财 务状况及其他 情况 | 上一年度期末（经 审计）总资产、净 资产、净资本、资 本充足率、资产负 债率 | 总资产： | | |
| | | 净资产： | | |
| | | 净资本： | | |
| | | 资本充足率： | | |
| | | 资产负债率： | | |
| | 最近三年的净利润 | | | |
| | 最近三年资本充足 率 | | | |
| | 最近三年资产负债 率 | | | |
| | 最近三年流动比率 | | | |
| | 分支机构的数量 | | | |
| 与期货存管业务有 关的内部控制制度 | | | | |
| 其他情况说明 | | | | |

法定代表人或授权代表人（签字并盖章） 申请人盖章

附件 2:

授权书

中国金融期货交易所股份有限公司:

特授权我行职员_____ (女士/先生) (身份证号: _____) 代表我行前往贵所办理期货保证金存管银行资格的申请事宜。其权限范围: 代表我行办理与贵所期货保证金存管银行资格申请有关的全部工作, 包括但不限于向贵所提出期货保证金存管银行资格申请并提交申请文件、签署与期货保证金存管银行资格申请相关的文件, 接受贵所向我行提交的与期货保证金存管银行资格申请相关的文件。本授权有效期从____年____月____日到____年____月____日止。

特此授权。

授权人: 银行 (盖章)

法定代表人: (签字并盖章)

年 月 日

