附件2

《上海国际能源交易中心结算细则》条文修订对照表

注：红色字体加粗表示新增内容 双删除线表示删除内容

|  |  |
| --- | --- |
| **修订草案** |  **现行版本** |
| 第十一条 结算交割员具有下列业务职责：（一）办理所属机构出入金业务；（二）获取并及时核对能源中心提供的结算数据；（三）办理作为保证金使用的资产的交存与提取手续；（四）办理实物交割手续；（五）办理其他结算、交割业务。 | 第十一条 结算交割员具有下列业务职责：（一）办理所属机构出入金业务；（二）获取并及时核对能源中心提供的结算数据；（三）办理作为保证金使用的资产的交存与提取手续；（四）办理实物交割手续；（五）办理其他结算、交割业务。 |
| 第二十三条 能源中心实行保证金制度。保证金分为结算准备金和交易保证金。人民币作为能源中心结算币种。经能源中心同意，外汇资金和价值稳定、流动性强的标准仓单、国债等资产（以下统称作为保证金使用的资产）可以作为保证金。 | 第二十三条 能源中心实行保证金制度。保证金分为结算准备金和交易保证金。人民币作为能源中心结算币种。经能源中心同意，外汇资金和价值稳定、流动性强的标准仓单、国债等资产（以下统称作为保证金使用的资产）可以作为保证金。 |
| 第三十八条 当日结算准备金余额的具体计算公式如下：当日结算准备金余额=上一交易日结算准备金余额+上一交易日交易保证金－当日交易保证金+当日**资产**作为保证金使用的资产的实际可用金额－上一交易日**资产**作为保证金使用的资产的实际可用金额+当日盈亏+入金－出金－手续费等**资产**作为保证金使用的资产的**实际可用金额的**具体计算方法**见**由本细则第六章**的有关**规定。 | 第三十八条 当日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+当日作为保证金使用的资产的实际可用金额－上一交易日作为保证金使用的资产的实际可用金额+当日盈亏+入金－出金－手续费等作为保证金使用的资产的具体计算方法由本细则第六章规定。 |
| 第四十三条 会员划拨资金的方式包括：（一）银行扣划。会员应当通过期货资金管理系统或者能源中心规定的其他方式提交出入金申请。会员在收市前提交入金申请的，经能源中心审核后，于当日收市结算前办理入金划转；在收市前提交出金申请的，经能源中心审核后，于当日收市结算后集中办理出金划转；在收市结算后提交出入金申请的，经能源中心审核后，于下一个交易日办理出入金划转。交易期间不予办理浮动盈亏及相关资金的出金划转，其他资金出金需求可向能源中心申请办理。连续交易期间，能源中心不办理出金业务以及作为保证金使用的资产的提取业务。（二）票据支付。经能源中心同意，会员可以使用基于保证金专用账户签发的支票、本票和贷记凭证入金。能源中心将在确认到账的下一节交易前增加会员结算准备金。 | 第四十三条 会员划拨资金的方式包括：（一）银行扣划。会员应当通过期货资金管理系统或者能源中心规定的其他方式提交出入金申请。会员在收市前提交入金申请的，经能源中心审核后，于当日收市结算前办理入金划转；在收市前提交出金申请的，经能源中心审核后，于当日收市结算后集中办理出金划转；在收市结算后提交出入金申请的，经能源中心审核后，于下一个交易日办理出入金划转。交易期间不予办理浮动盈亏及相关资金的出金划转，其他资金出金需求可向能源中心申请办理。连续交易期间，能源中心不办理出金业务以及作为保证金使用的资产的提取业务。（二）票据支付。经能源中心同意，会员可以使用基于保证金专用账户签发的支票、本票和贷记凭证入金。能源中心将在确认到账的下一节交易前增加会员结算准备金。 |
| 第四十四条 会员出金应当符合能源中心规定。出金标准为：（一）作为保证金使用的资产的实际可用金额大于等于交易保证金的80%时：可出金额=实有货币资金－交易保证金×20%－结算准备金最低余额（二）作为保证金使用的资产的实际可用金额小于交易保证金的80%时：可出金额=实有货币资金－（交易保证金－作为保证金使用的资产的实际可用金额）－结算准备金最低余额实有货币资金是指实有人民币资金和折成人民币的外汇资金的合计数，外汇资金的折算方法由本细则第六章规定。能源中心可以根据市场风险状况和允许使用的外汇种类对出金标准做适当调整。 | 第四十四条 会员出金应当符合能源中心规定。出金标准为：（一）作为保证金使用的资产的实际可用金额大于等于交易保证金的80%时：可出金额=实有货币资金－交易保证金×20%－结算准备金最低余额（二）作为保证金使用的资产的实际可用金额小于交易保证金的80%时：可出金额=实有货币资金－（交易保证金－作为保证金使用的资产的实际可用金额）－结算准备金最低余额实有货币资金是指实有人民币资金和折成人民币的外汇资金的合计数，外汇资金的折算方法由本细则第六章规定。能源中心可以根据市场风险状况和允许使用的外汇种类对出金标准做适当调整。 |
| 第六十六条会员与委托其结算的境外特殊参与者应当签署包括下列内容的委托结算的协议：（一）结算准备金最低余额和交易保证金收取标准；（二）办理作为保证金使用的资产及其费用标准；（三）风险管理措施、条件及程序；（四）账户类型及管理模式、结算流程，包括结算数据收取、查询和确认的时间和方式；（五）手续费标准；（六）通知事项、方式及时限；（七）不可归责于协议双方当事人所造成损失的情形及其处理方式；（八）协议变更和解除；（九）违约责任；（十）争议处理方式；（十一）其他事项。 | 第六十六条会员与委托其结算的境外特殊参与者应当签署包括下列内容的委托结算的协议：（一）结算准备金最低余额和交易保证金收取标准；（二）办理作为保证金使用的资产及其费用标准；（三）风险管理措施、条件及程序；（四）账户类型及管理模式、结算流程，包括结算数据收取、查询和确认的时间和方式；（五）手续费标准；（六）通知事项、方式及时限；（七）不可归责于协议双方当事人所造成损失的情形及其处理方式；（八）协议变更和解除；（九）违约责任；（十）争议处理方式；（十一）其他事项。 |
| 第六章 作为保证金使用的资产 | 第六章 作为保证金使用的资产 |
| 第七十二条 经能源中心批准，非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者、客户可以将标准仓单、外汇资金等资产作为保证金使用。非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者、客户将标准仓单以外的有价证券作为保证金的，视为授权能源中心委托托管机构对其申报账户内的对应有价证券进行划转或者质押登记处理。有价证券的划转、质押登记以及管理等相关业务按照托管机构有关规定办理。**客户、境外中介机构、境外特殊参与者以资产作为保证金的，视为同意期货公司会员将其资产提交能源中心作为保证金。****客户、境外特殊参与者、境外中介机构、会员以资产作为保证金的，视为授权能源中心对相应资产进行划转或者作质押处理。** | 第七十二条 经能源中心批准，非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者、客户可以将标准仓单、外汇资金等资产作为保证金使用。非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者、客户将标准仓单以外的有价证券作为保证金的，视为授权能源中心委托托管机构对其申报账户内的对应有价证券进行划转或者质押登记处理。有价证券的划转、质押登记以及管理等相关业务按照托管机构有关规定办理。 |
| 第七十三条 能源中心结算机构负责办理资产作为保证金使用的业务，受理截止时间为每一交易日15:00。遇有特殊情况的，能源中心可以延长受理时间。 | 第七十三条 能源中心结算机构负责办理资产作为保证金使用的业务，受理截止时间为每一交易日15:00。遇有特殊情况的，能源中心可以延长受理时间。 |
| 第七十**三**四条 本细则所指的作为保证金使用的资产限于以下种类**经能源中心批准，以下资产可以作为保证金**：（一）标准仓单；**（二）中华人民共和国财政部在境内发行的记账式国债；**（二**三**）外汇资金（币种类别、折算方式和适用范围**等**由能源中心另行公布）；（三**四**）能源中心另行确**认**定的其他资产。**作为保证金的资产具体由能源中心确定并向市场公布。** | 第七十四条 本细则所指的作为保证金使用的资产限于以下种类：（一）标准仓单；（二）外汇资金（币种类别、折算方式和适用范围由能源中心另行公布）；（三）能源中心另行确定的其他资产。 |
| **第七十四条 以国债作为保证金的，每次提交的国债面值不得低于100万元人民币。** |  |
| 第七十五条 **办理有价证券作为保证金的手续：  （一）申请：客户、境外特殊参与者、境外中介机构应当通过期货公司会员办理有价证券作为保证金业务。会员办理有价证券作为保证金业务时，应当向能源中心提出申请。具体办理时间由能源中心另行通知。****（二）验证交存：****1.会员将标准仓单通过标准仓单管理系统提交能源中心办理交存手续，获能源中心批准后，完成标准仓单作为保证金交存业务。****2. 以国债作为保证金的，客户、境外特殊非经纪参与者、非期货公司会员应当确保托管账户中存有数量足够的、无其他权利瑕疵的国债。能源中心按照会员的申请委托托管机构进行国债划转或者质押登记，托管机构对国债进行划转或者质押登记后视为办理完成。 3. 其他有价证券的验证交存应当符合能源中心的规定。**办理资产作为保证金使用业务的，非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者应当向能源中心提出申请。客户应当授权期货公司会员、境外特殊经纪参与者、境外中介机构为其向能源中心提出申请，由后者办理相关业务手续。能源中心对作为保证金使用的资产进行验证交存。 | 第七十五条 办理资产作为保证金使用业务的，非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者应当向能源中心提出申请。客户应当授权期货公司会员、境外特殊经纪参与者、境外中介机构为其向能源中心提出申请，由后者办理相关业务手续。能源中心对作为保证金使用的资产进行验证交存。 |
| 第七十六条 作为保证金使用的资产的市值按以下方法计算：（一）以标准仓单作为保证金的，**每日结算时，能源中心**以该**标准仓单对应**品种最近交割月份期货合约的当日结算价作为其市值核定的基准价**计算其市值**，**。**当日**闭**收市前**，**标准仓单的市值先**以**按照前一交易日该**标准仓单对应**品种最近交割月份期货合约的结算价**为基准价计算其市值**核算。作为保证金的金额不高于标准仓单市值的80%。**（二）国债作为保证金的，国债的基准价取托管机构估值数据的较小值，能源中心每日结算时以前一交易日该国债基准价的净价确定其市值。能源中心有权对国债的基准价进行调整。**（**三**二）其他资产作为保证金使用的**，其市值计算的**基准价由能源中心核定。作为保证金使用的资产市值折算以后用作保证金的金额称为折后金额。能源中心每日结算时按上述规定的方法重新确定作为保证金使用的资产的基准价并调整折后金额。 | 第七十六条 作为保证金使用的资产的市值按以下方法计算：（一）以标准仓单作为保证金的，以该品种最近交割月份期货合约的当日结算价作为其市值核定的基准价，当日收市前标准仓单的市值先按照前一交易日该品种最近交割月份期货合约的结算价核算。作为保证金的金额不高于标准仓单市值的80%。（二）其他资产作为保证金使用的基准价由能源中心核定。作为保证金使用的资产市值折算以后用作保证金的金额称为折后金额。能源中心每日结算时按上述规定的方法重新确定作为保证金使用的资产的基准价并调整折后金额。 |
| **第七十七条**  **作为保证金的资产的市值按照折扣比率计算后的金额称为折后金额。具体的折扣比率由能源中心确定、调整并公布，其中标准仓单、国债等有价证券的折后金额不高于其市值的80%。****能源中心每日结算时，按规定的基准价调整作为保证金的资产市值和折后金额。** |  |
| **第七十八条 能源中心按照会员在能源中心任一内部明细账中的实有货币资金的4倍（配比乘数）确定会员有价证券作为保证金的最大配比金额。**除外汇资金以外的其他资产作为保证金的，该资产的最大配比金额不超过会员在能源中心相应的内部明细账户或受托结算内部明细账户的实有货币资金的4倍（配比乘数）。能源中心可根据资产的流动性和风险性确定其配比乘数，并可以根据市场风险和资产所有人的资信调整资产配比乘数。**能源中心按照有价证券的**资产折后金额和最大配比金额中的较低金额是作为**会员作为**保证金使用的资产的实际可用金额。会员办妥作为保证金使用的**有价证券**资产交存手续**后**的，能源中心将该笔**有价证券**资产的实际可用金额划**计**入**会员**结算准备金。**能源中心在每日结算时，根据以上原则自动调整会员有价证券作为保证金的实际可用金额。** | 第七十七条 除外汇资金以外的其他资产作为保证金的，该资产的最大配比金额不超过会员在能源中心相应的内部明细账户或受托结算内部明细账户的实有货币资金的4倍（配比乘数）。能源中心可根据资产的流动性和风险性确定其配比乘数，并可以根据市场风险和资产所有人的资信调整资产配比乘数。资产折后金额和最大配比金额中的较低金额是作为保证金使用的资产的实际可用金额。会员办妥作为保证金使用的资产交存手续的，能源中心将该笔资产的实际可用金额划入结算准备金。 |
| **第七十九条 能源中心有权根据市场状况调整资产作为保证金的基准价、折扣比率、配比乘数，由能源中心另行通知。** |  |
| **第八十条 国债作为保证金期间发生兑息的，利息归国债所有人所有，并按照托管机构有关规定办理。** |  |
| 第**八十一**七十八条 **有价证券**作为保证金使用的资产每次折算使用的期限不得超过能源中心规定的**该有价证券的**有效期，。届满后仍需作为保证金使用的，应当重新办理手续。 | 第七十八条 作为保证金使用的资产每次折算使用的期限不得超过能源中心规定的有效期，届满后仍需作为保证金使用的，应当重新办理手续。 |
| **第八十二条 国债作为保证金的，国债到期日前一个月的第一个交易日结算时起，能源中心不再将该国债计入实际可用金额计算。会员应当在国债到期日之前办理提取或者解除质押手续。** |  |
| 第**八十三**七十九条 具有**出现**下列情况之一的，能源中心可以取消**有关会员**以资产作为保证金**的额度**使用：（一）会员、境外特殊参与者、境外中介机构提取和运用资金出现较大风险并有可能危及能源中心合法权益的；（二）**作为保证金的资产**有价证券对应的标的物出现瑕疵或者发生重大风险的；（三）**能源中心认为必要的其他情形**由于其他原因需要取消的。能源中心取消**会员**以资产作为保证金**的额度**使用后，**会员**保证金不足的，相关主体应当**给**予以补足。 | 第七十九条 具有下列情况之一的，能源中心可以取消以资产作为保证金使用：（一）会员、境外特殊参与者、境外中介机构提取和运用资金出现较大风险并有可能危及能源中心合法权益的；（二）有价证券对应的标的物出现瑕疵或者发生重大风险的；（三）由于其他原因需要取消的。能源中心取消以资产作为保证金使用后，保证金不足的，相关主体应当予以补足。 |
| **第八十四条 会员办理资产提取或者解除质押的，应当弥补相应的保证金。具体办理时间由能源中心另行通知。**  |  |
| 第八十条 会员、境外特殊参与者、境外中介机构在折算期限内提取作为保证金使用的资产会造成保证金不足的，应当在补足相应的保证金后，方可办理提取手续，取回作为保证金使用的资产。会员、境外特殊参与者、境外中介机构提取作为保证金使用的资产的申请截止时间为每一交易日14:30。 | 第八十条 会员、境外特殊参与者、境外中介机构在折算期限内提取作为保证金使用的资产会造成保证金不足的，应当在补足相应的保证金后，方可办理提取手续，取回作为保证金使用的资产。会员、境外特殊参与者、境外中介机构提取作为保证金使用的资产的申请截止时间为每一交易日14:30。 |
| 第八十**五**一条 **办理**以资产作为保证金使用的，会员应当**向能源中心**交纳手续费。作为保证金使用的资产的手续费由能源中心按不高于中国人民银行公布的同期贷款利率计算并按月收取。具体计费金额和收费标准由能源中心确定、调整并公布。将标准仓单以外的有价证券作为保证金使用的，会员还应当承担有价证券作为保证金业务中托管机构收取的有关费用**，**；具体计费金额和收费标准按照托管机构的有关规定执行。 | 第八十一条 以资产作为保证金使用的，会员应当交纳手续费。作为保证金使用的资产的手续费由能源中心按不高于中国人民银行公布的同期贷款利率计算并按月收取。具体计费金额和收费标准由能源中心确定、调整并公布。将标准仓单以外的有价证券作为保证金使用的，会员还应当承担有价证券作为保证金业务中托管机构收取的有关费用；具体计费金额和收费标准按照托管机构的有关规定执行。 |
| 第八十**六**二条 **当**会员不履行或者不能完全履行交易保证金债务**时**的，能源中心**有权处置**可以将作为保证金使用的资产兑现或者提货后变现，从所得的款项中优先受偿交易保证金债务和其他相关债务。会员应当承担**处置**作为保证金使用的资产兑现或者变现时发**产**生的损失或**及**费用。 | 第八十二条 会员不履行或者不能完全履行交易保证金债务的，能源中心可以将作为保证金使用的资产兑现或者提货后变现，从所得的款项中优先受偿交易保证金债务和其他相关债务。会员应当承担作为保证金使用的资产兑现或者变现时发生的损失或费用。 |

《上海国际能源交易中心交割细则》条文修订对照表

注：双删除线表示删除内容

|  |  |
| --- | --- |
| **修订草案** |  **现行版本** |
| 第五十条 厂库以自己作为货主签发的厂库标准仓单不得作为保证金使用。 | 第五十条 厂库以自己作为货主签发的厂库标准仓单不得作为保证金使用。 |
| 第一百零四条 标准仓单可以用于实物交割、作为保证金使用、质押、转让、提货以及能源中心规定的其他用途。 | 第一百零四条 标准仓单可以用于实物交割、作为保证金使用、质押、转让、提货以及能源中心规定的其他用途。 |
| 第一百零八条 会员直接向能源中心提交标准仓单作为保证金使用的申请。结算交割委托人将标准仓单授权会员作为保证金使用的业务流程如下：（一）结算交割委托人应当先将指定的标准仓单授权给会员作为会员的保证金使用。（二）会员选择其结算交割委托人授权的标准仓单，提交给能源中心。会员提交标准仓单时，应当注明标准仓单作为保证金使用，或者作为与其所示品种和数量相同的期货合约持仓的履约保证。（三）能源中心审核通过后，标准仓单方可以作为保证金使用。境外特殊经纪参与者或者境外中介机构的客户将标准仓单交存能源中心作为保证金使用的，应当授权并通过境外特殊经纪参与者、境外中介机构办理。 | 第一百零八条 会员直接向能源中心提交标准仓单作为保证金使用的申请。结算交割委托人将标准仓单授权会员作为保证金使用的业务流程如下：（一）结算交割委托人应当先将指定的标准仓单授权给会员作为会员的保证金使用。（二）会员选择其结算交割委托人授权的标准仓单，提交给能源中心。会员提交标准仓单时，应当注明标准仓单作为保证金使用，或者作为与其所示品种和数量相同的期货合约持仓的履约保证。（三）能源中心审核通过后，标准仓单方可以作为保证金使用。境外特殊经纪参与者或者境外中介机构的客户将标准仓单交存能源中心作为保证金使用的，应当授权并通过境外特殊经纪参与者、境外中介机构办理。 |
| 第一百零九条 结算交割委托人将标准仓单授权给会员作为保证金的，会员在弥补应交保证金后可以向能源中心申请办理提取标准仓单手续。会员、境外特殊经纪参与者、境外中介机构与客户之间就提取标准仓单产生纠纷的，能源中心可以根据会员、境外特殊经纪参与者、境外中介机构和客户之间达成的具有法律效力的协议将相应的标准仓单转入协议中约定的标准仓单账户，或者依据生效的法律文书作相应的处理。 | 第一百零九条 结算交割委托人将标准仓单授权给会员作为保证金的，会员在弥补应交保证金后可以向能源中心申请办理提取标准仓单手续。会员、境外特殊经纪参与者、境外中介机构与客户之间就提取标准仓单产生纠纷的，能源中心可以根据会员、境外特殊经纪参与者、境外中介机构和客户之间达成的具有法律效力的协议将相应的标准仓单转入协议中约定的标准仓单账户，或者依据生效的法律文书作相应的处理。 |
| 第一百一十条 会员提取作为保证金使用的标准仓单的，直接向能源中心提交申请。结算交割委托人提取作为保证金使用的标准仓单的，业务流程如下：（一）结算交割委托人提出申请。（二）会员收到申请后，及时向能源中心提交标准仓单提取申请。（三）能源中心进行审核，审核通过后，将对应标准仓单退还给该会员。（四）该会员应当及时将对应的标准仓单释放给其结算交割委托人；未及时释放标准仓单的，应当向能源中心报告原因。境外特殊经纪参与者或者境外中介机构的客户提取作为保证金使用的标准仓单的，应当授权并通过境外特殊经纪参与者、境外中介机构办理。 | 第一百一十条 会员提取作为保证金使用的标准仓单的，直接向能源中心提交申请。结算交割委托人提取作为保证金使用的标准仓单的，业务流程如下：（一）结算交割委托人提出申请。（二）会员收到申请后，及时向能源中心提交标准仓单提取申请。（三）能源中心进行审核，审核通过后，将对应标准仓单退还给该会员。（四）该会员应当及时将对应的标准仓单释放给其结算交割委托人；未及时释放标准仓单的，应当向能源中心报告原因。境外特殊经纪参与者或者境外中介机构的客户提取作为保证金使用的标准仓单的，应当授权并通过境外特殊经纪参与者、境外中介机构办理。 |
| 第一百一十一**零八**条 标准仓单作为保证金使用的**有关**其他事项按照《上海国际能源交易中心结算细则》的有关规定执行。 | 第一百一十一条 标准仓单作为保证金使用的其他事项按照《上海国际能源交易中心结算细则》的有关规定执行。 |