附件

上海期货交易所

国债作为保证金业务指引

（2023年9月）

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

1. 业务准备
2. **期货公司会员业务准备**
3. **向中央结算公司申请开立专用账户**

期货公司会员开展国债作为保证金业务的，应在中央国债登记结算有限责任公司（以下简称中央结算公司）开立债券作为期货保证金业务专用账户。专用账户的开立按照中央结算公司债券作为期货保证金业务操作指引(详见中央结算公司网站)有关规定办理。

1. **向中央结算公司申请开通业务资格**

期货公司会员开展国债作为保证金业务的，应事先向中央结算公司申请开通业务资格。期货公司会员申请开通相关业务资格按照中央结算公司债券作为期货保证金业务操作指引有关规定办理。

1. **向上期所申报专用账户**

期货公司会员开展国债作为保证金业务的，应向上期所申报在中央结算公司开立的债券作为保证金业务专用账户信息，并提供下列材料：（1）《上海期货交易所会员国债作为保证金业务申请表》（附件1）；（2）中央结算公司开具的开户通知书复印件或其他相关证明材料（加盖公章）；（3）营业执照和金融业务许可证复印件（加盖公章）；（4）交易所要求的其他材料。

**4.专用账户变更或注销**

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

1. **非期货公司会员业务准备**

**1.向中央结算公司申请开通业务资格**

非期货公司会员参与国债作为期货保证金业务的，应事先向中央结算公司申请开通业务资格，具体要求按照中央结算公司债券作为期货保证金业务操作指引有关规定办理。

**2.向上期所申报债券账户**

非期货公司会员参与国债作为保证金业务的，应向上期所申报用于国债作为保证金业务的债券账户，并提交以下材料：（1）《上海期货交易所会员国债作为保证金业务申请表》（附件2）；（2）中央结算公司开具的开户通知书复印件或其他相关证明材料（加盖公章）；（3）营业执照和金融业务许可证复印件（加盖公章）；（4）交易所要求的其他材料。

**3.债券账户变更或注销**

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

1. **客户业务准备**

**1.向中央结算公司申请开通业务资格**

客户参与国债作为保证金业务的，需事先与中央结算公司沟通，申请开通业务资格，具体要求按照中央结算公司债券作为期货保证金业务操作指引有关规定办理。

**2.向上期所申报债券账户**

客户参与国债作为保证金业务的，须通过会员向上期所申报用于国债作为保证金业务的债券账户，客户应当**通过期货公司会员**向交易所提交以下材料：（1）《上海期货交易所客户国债作为保证金业务申请表》（附件3）；（2）中央结算公司开具的开户通知书复印件或其他相关证明材料（加盖公章）；（3）营业执照和金融业务许可证复印件（加盖公章）；（4）交易所要求的其他材料。

**3.债券账户变更或注销**

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

1. 国债交存和提取

会员通过会员服务系统办理交易所端国债交存和提取的申请。客户交存和提取作为保证金的国债的，应通过会员向交易所提交申请。

国债交存和提取的质押和解押操作按照中央结算公司债券作为期货保证金业务操作指引有关规定办理。期货公司会员在中央结算公司系统提交的质押及解押指令中应包含会员号及客户号等信息；非期货公司会员在中央结算公司系统提交的质押指令中应包含非期货公司会员交易编码等信息。

交易所受理国债交存和提取的截止时间为每个交易日14:30。会员办理国债提取业务的，上期所通过中央结算公司的担保品管理服务系统客户端向会员发起国债提取指令，会员应在当日该系统关闭前确认国债提取指令。若会员当日未能确认国债提取指令，应在下一交易日中午12:00之前向上期所提交书面说明，上期所再向该会员发起国债提取指令。

1. 到期处理

国债到期日前一个月的第一个交易日结算时起，上期所不再将该国债计入实际可用金额的计算，并不再接受该国债交存。国债到期日前一个月的第一个交易日结算后，会员不主动提取该国债的，上期所可以通过中央结算公司的担保品管理服务系统客户端向会员发起国债提取指令，会员应在当日该系统关闭前确认国债提取指令。若会员当日未能确认国债提取指令，需在第二个交易日中午12:00之前向上期所提交书面说明，上期所再向该会员发起国债提取指令。

1. 应急处理

若期货公司会员、非期货公司会员无法通过会员服务系统完成国债交存和提取等操作，应填写并提交《上海期货交易所国债交存/提取应急申请表》（附件5）。

1. 业务手续费

办理国债作为保证金业务的，会员应当按照《上海期货交易所结算细则》有关规定向上期所缴纳手续费。国债作为保证金的手续费率为年化0.05%，手续费以每日结算后国债折后金额为基数计费，按月收取。

交易所可以根据市场运行情况对手续费标准进行调整。

附件1：

**上海期货交易所**

**会员国债作为保证金业务申请表**

**（期货公司会员专用）**

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

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 以下由交易所填写 | | | | | |
| 经办人 |  | 复核人 |  | 日期 |  |

附件2：

**上海期货交易所**

**会员国债作为保证金业务申请表**

**(非期货公司会员专用)**

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

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 以下由交易所填写 | | | | | |
| 经办人 |  | 复核人 |  | 日期 |  |

附件3：

**上海期货交易所**

**客户国债作为保证金业务申请表**

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 申请日期 | |  | 会员全称 |  | | |
| 会员号 | |  | 会员简称 |  | | |
| 期货客户号 | |  | 期货客户名 |  | | |
| 客户债券  账户信息 | | 登记机构 | **中央结算公司** | | | |
| 账户全称 |  | | | |
| 账户号码 |  | | | |
| 公司证件 | 营业执照 | | 证件号 |  |
| 联系人1 | |  | 办公电话 |  | 手机 |  |
| 联系人2 | |  | 办公电话 |  | 手机 |  |
| 客户 | 1、本公司委托\_\_\_\_\_\_\_\_（会员简称）办理国债作为保证金有关事项，本公司承诺遵守国债作为保证金业务的有关法律法规和业务规则，愿意承担本公司的相关责任。  2、本公司同意将国债提交\_\_\_\_\_\_\_\_（会员简称）作为保证金，本公司不履行或不能完全履行交易保证金债务时，本公司同意\_\_\_\_\_\_\_\_（会员简称）处置相关国债，所得款项用于清偿本公司的交易保证金债务和相关债务。  3、本公司同意\_\_\_\_\_\_\_\_（会员简称）将本公司的国债提交交易所作为保证金，\_\_\_\_\_\_\_\_（会员简称）不履行或不能完全履行交易保证金债务时，本公司同意交易所处置相关国债，所得款项用于清偿\_\_\_\_\_\_\_\_（会员简称）的交易保证金债务和相关债务。  签字或盖章：  年 月 日 | | | | | |
| 会员 | 本公司保证按照客户意愿办理有关国债作为保证金业务，本公司承诺遵守国债作为保证金业务的有关法律法规和业务规则。  会员单位公章：  年 月 日 | | | | | |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 以下由交易所填写 | | | | | |
| 经办人 |  | 复核人 |  | 日期 |  |

附件4：

**中央结算公司账户变更/注销告知书**

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

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 以下由交易所填写 | | | | | |
| 经办人 |  | 复核人 |  | 日期 |  |

附件5：

**上海期货交易所国债交存/提取应急申请表**

上海期货交易所：

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

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

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 以下由交易所填写 | | | | | |
| 经办人 |  | 复核人 |  | 日期 |  |