

中国证券登记结算有限责任公司
结算银行期权资金结算
业务指引

中国证券登记结算有限责任公司

目录

第一章	期权资金结算业务资格申请	1
第一节	资格管理要求	1
第二节	申请流程	2
第三节	业务开展相关管理要求	3
一、	签订备忘录等业务开通手续	3
二、	向本公司分支机构办理业务开通手续	3
三、	衍生品保证金账户开立及资金存放	4
四、	其他事项	4
第二章	常规管理与风险管理	4
第一节	监督考评	4
一、	季度考评	4
二、	年度报告	5
三、	日常监督	5
四、	风险防范措施	6
第二节	注销或终止资格	6
第三章	附则	7
附件：	期权资金结算业务资格申请材料范本	8

中国证券登记结算有限责任公司

结算银行期权资金结算业务指引

根据《股票期权交易试点管理办法》、《结算银行证券资金结算业务管理办法》、中国证券监督管理委员会以及中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“本公司”）的有关制度、规则，制定本指引。

第一章 期权资金结算业务资格申请

商业银行（指总行，下同）拟申请期权资金结算业务资格的，应当按照本指引向本公司提出申请。

第一节 资格管理要求

商业银行拟申请期权资金结算业务资格的，应当符合以下条件：

（一）已根据《结算银行证券资金结算业务管理办法》要求取得本公司结算银行资格，且可为本公司所有结算参与人提供结算服务；

（二）净资产不低于 1000 亿元人民币，最近三个会计年度连续盈利；

（三）向本公司提供最低 100 亿元的日间免费授信额度及最低 100 亿元的隔夜授信额度，此授信额度在足以用于期权业务的情况下，也可用于其他业务；

（四）具备开展期权资金结算业务所需的业务和技术条件；

（五）本公司要求的其他条件。

第二节 申请流程

商业银行拟申请期权资金结算业务资格的,应当按以下程序向本公司提出申请。

(一) 提交申请材料

商业银行拟申请期权资金结算业务资格的,须向本公司提交以下材料(均为加盖申请人公章,具体格式见附件):

1. 申请书(含申请表);

申请书至少应当包含下列内容:

① 商业银行结算服务运行情况、期货存管业务开展情况;

② 可以办理衍生品保证金资金结算相关业务的分支机构分布情况,其中北京、上海、深圳三地均各有一家可以办理衍生品保证金资金结算相关业务的分支机构;

③ 实时划汇系统、银行转账系统及与本公司的技术衔接等技术、通信设施情况;

④ 公司治理结构与组织机构说明;

⑤ 最近三年发生重大事故、监管机构重大行政处罚情况说明;

⑥ 最近三年经审计的净资产及盈利情况;

⑦ 期权资金结算业务银行代表及相关业务、技术负责人信息;

⑧ 向本公司承诺根据本公司业务进展情况,配合本公司实施直接扣款,并严格遵守股票期权试点相关结算规则、本指引、双方约定的备忘录及本公司相关制度、规则进行期权资金结算

操作；

⑨承诺对与本公司有关的任何非公开信息负有保密责任；

⑩承诺向本公司提供的授信额度满足期权资金结算日间及隔夜授信额度要求；

2. 法定代表人授权委托书；

3. 衍生品保证金资金结算业务相关的内部管理制度、操作流程说明以及技术和通讯系统出现故障等异常情况下的应急处理预案；

4. 本公司要求提供的其他文件。

（二） 资格审核

本公司自收到上述完整的申请材料之日起 20 个工作日内，对申请材料进行审核，做出是否核准其期权资金结算业务资格的决定，向符合期权资金结算业务资格管理要求的商业银行出具相关书面意见，报中国证监会备案，并在本公司网站公告。

第三节 业务开展相关管理要求

一、 签订备忘录等业务开通手续

获得期权资金结算业务资格的商业银行（以下简称“期权业务结算银行”）在正式开展期权资金结算业务前，其相关分支机构应当与本公司分支机构就期权业务资金结算涉及的资金划付等业务流程、授信安排及应急处理等事项签订备忘录。

二、 向本公司分支机构办理业务开通手续

符合要求的期权业务结算银行，在获得本公司总部出具的书面核

准文件后，应当及时联系本公司分支机构办理后续业务开通手续。

三、衍生品保证金账户开立及资金存放

符合要求的期权业务结算银行，在获得本公司总部出具的书面核准文件后，可以接受本公司开展期权结算业务的结算参与人（以下简称“期权结算参与人”）及其他期权经营机构开设自营及投资者衍生品保证金账户，分别存放自营及投资者缴纳的用于期权交易的资金。

期权结算参与人可以选择任一家或一家以上的期权业务结算银行开立衍生品保证金账户，同时选定其中一个自营及投资者衍生品保证金账户分别作为本公司直接扣款账户。

四、其他事项

期权业务结算银行应当按照本公司期权结算相关规则、指南要求，进行期权结算业务保证金出入金、直接扣款等操作。

第二章 常规管理与风险管理

本公司按照相关业务规则对期权业务结算银行实施持续性管理。

第一节 监督考评

一、季度考评

每季末，本公司分支机构对期权业务结算银行进行季度考评，或根据需要进行不定期检查，综合考评其开展证券资金结算业务的时效性、安全性与准确性。

二、 年度报告

期权业务结算银行应当在书面报送的年度报告中增加期权业务资金结算内容，包括但不限于以下内容：

- 1、 期权业务资金结算业务的基本情况；
- 2、 对本公司相关规则的执行情况；
- 3、 发生的资金划付风险、风险隐患及应对措施；
- 4、 内部风险控制制度的完善和执行情况；
- 5、 技术系统的运行和故障情况；
- 6、 本公司要求的其他内容。

三、 日常监督

本公司分支机构每日跟踪结算银行期权资金结算业务运行情况。若银行出现以下情况之一的，本公司可以对其采取风险防范措施：

- 1、 违反《结算银行证券资金结算业务管理办法》、股票期权结算相关业务规则、本指引及与本公司分支机构签订的备忘录等相关规定；
- 2、 因违反相关备忘录或规定引发事故，导致资金结算业务无法正常进行；
- 3、 发生可能影响期权业务资金结算的操作失误或技术系统故障时，未立即通知本公司；
- 4、 未能确保本公司银行账户安全；
- 5、 本公司认定的其他情况。

四、风险防范措施

期权业务结算银行出现上述规定的情形之一，本公司可以根据情节轻重程度采取下列风险防范和处置措施：

- 1、 口头警告；
- 2、 书面警示；
- 3、 责令整改；
- 4、 约见结算银行代表和业务、技术负责人进行谈话；
- 5、 暂停期权资金结算业务资格；
- 6、 本公司认为必要的其他措施。

本公司跟踪期权业务结算银行整改情况，认为其整改有效、重新具备正常开展期权资金结算业务能力的，将停止采取上述规定的风险防范措施，对其恢复正常管理。

第二节 注销或终止资格

期权业务结算银行出现以下情况之一的，本公司可以终止其期权资金结算业务资格：

- 1、 申请终止其期权资金结算业务资格；
- 2、 被依法撤销、解散或宣告破产；
- 3、 被收购或兼并且丧失法人地位；
- 4、 季度考评结果不合格且整改不力；
- 5、 出现不满足期权资金结算业务资格条件的；
- 6、 本公司认为该期权业务结算银行存在重大风险隐患；
- 7、 本公司认定的其他情况。

决定终止商业银行的期权资金结算业务资格的，本公司将提前五个工作日向该商业银行发出终止通知，报中国证监会备案，并在本公司网站上公告。

期权资金结算业务资格终止不影响该商业银行与本公司已经存在的法律关系，本公司有权依法与该商业银行了结相关业务关系。

第三章 附则

一、对在与本公司进行期权资金结算业务的过程中，期权业务结算银行接触到的与本公司有关的任何非公开信息，包括但不限于资金结算账户、结算资金等方面的信息，除依法向有权机关披露外，期权业务结算银行均应当严守秘密，保证其及其相关业务人员不以任何方式向任何无关的第三人披露。

二、本指引未明确事项，按照备忘录及本公司其他相关规则办理。本指引未作规定的，按照本公司《股票期权试点结算规则》、《结算银行证券资金结算业务管理办法》、《证券登记结算业务参与机构自律管理措施实施细则》以及本公司相关业务规则等相关业务规定办理。

三、本指引由本公司负责解释。

四、本指引自发布之日起实施。

附件：

期权资金结算业务资格申请材料范本

附件：期权资金结算业务资格申请材料范本

中国证券登记结算有限责任公司
结算银行期权资金结算业务资格
申请材料范本

目 录

- 文件一：期权资金结算业务资格申请书
- 文件二：法定代表人授权委托书
- 文件三：内部管理制度、操作流程以及应急预案说明
- 文件四：结算银行申请注销资格申请报告

文件一：期权资金结算业务资格申请书

关于办理中国证券登记结算有限责任公司

期权资金结算业务资格的申请

中国证券登记结算有限责任公司：

我行成立时间 XX、注册地 XX、注册资本 XX。我行已于 X 年 X 月获得贵公司结算银行 A 股结算业务资格。

（申请人期权资金结算业务开展的基本情况介绍，包括结算服务运行情况、相关技术、通信设施等；申请人公司治理结构与组织机构说明、人员配置情况；申请人最近三年发生重大事故、监管机构重大行政处罚情况说明等）

我行已向贵公司提供授信总额度 _____ 亿元人民币，其中日间额度为 _____ 亿元人民币，隔夜额度为 _____ 亿元人民币，该授信额度在足以用于期权业务的情况下，也可用于其他业务。

我行于 X 年 X 月 X 日提供的授信承诺函同时终止，以上述授信承诺为准（本段内容仅适用于前期向中国结算出具授信承诺函的银行）。

综上，本公司向贵公司申请期权资金结算业务资格。现按照贵公司的规定提交以下申请材料，请予审核。

申请单位全称：
(加盖公章)

年 月 日

**中国证券登记结算有限责任公司
期权业务结算参与人资格申请表**

申请人全称								
是否具有期货保证金存管业务资格	<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否		是否已向中国证券登记结算有限责任公司提供授信	<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否				
是否在北京、上海、深圳三个城市中均各有一家可以办理衍生品保证金资金结算相关业务的分支机构	<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否		是否拥有拥有全国范围内的实时汇划系统,以及服务良好的银行转账系统	<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否				
最近三年经审计的财务状况（亿元人民币）								
年份	净资产			净利润				
期权资金结算业务负责人及联系人								
	上海分行				深圳分行			
	业务负责人	业务联系人	技术负责人	技术联系人	业务负责人	业务联系人	技术负责人	技术联系人
姓名								
部门及职务								
联系方式								
申请人承诺事项:								

1. 本单位自愿申请中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“你公司”）的期权资金结算业务资格，保证提供的所有资料真实、完整、准确；
2. 本单位取得你公司期权资金结算业务资格后，将严格遵守你公司的有关业务规则、指南、双方约定的备忘录等相关制度、规则；
3. 本单位承诺根据你公司业务进展情况，按照你公司有关业务规则要求，配合你公司实施直接扣款；
4. 本单位承诺对与你公司有关的任何非公开信息负有保密责任；
5. 本单位服从你公司结算银行管理，积极配合结算银行管理工作，认真履行结算银行义务，履行义务主张权利发生任何争议的，均由你公司和我单位直接依法解决；
6. 本单位承诺在期权资金结算业务负责人及联系人信息发生变更前五个工作日向你公司重新报备；
7. 有违反你公司结算银行管理及相关期权资金结算业务规定的，本单位将承担由此引起的一切后果及法律责任。

经办人		联系电话	
法定代表人（签字）：		申请人（公章） 及日期：	年 月 日

文件二：法定代表人授权委托书

法定代表人授权委托书

中国证券登记结算有限责任公司：

兹授权我行_____部门_____同志办理中国证券登记结算有限责任公司期权资金结算业务资格申请相关事宜。

本授权委托书有效期：自生效日起至期权资金结算业务资格办理结束日。

被授权人姓名：_____

被授权人身份证件种类：_____

被授权人证件号码：_____

申请单位公章：

法定代表人签字或签章：

生效日期： 年 月 日

文件三：内部管理制度、操作流程以及应急预案说明

内部管理制度、操作流程及应急预案说明

中国证券登记结算有限责任公司：

我行根据贵司有关业务规则及我行的有关结算风险控制要求（附相关要求文件名称），建立健全我行期权资金结算业务内部控制管理。现对我行衍生品保证金资金结算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作如下说明：

一、衍生品保证金资金结算业务相关的内部管理制度、相关风险防范和监控措施

二、衍生品保证金资金结算业务相关操作流程

三、异常情况下的应急处理预案

四、主要风险控制制度（附全文）

申请单位全称：

（加盖公章）

年 月 日

文件四： 结算银行申请注销资格申请报告

关于办理中国证券登记结算有限责任公司
期权资金结算业务资格注销的申请

中国证券登记结算有限责任公司：

我行于 X 年 X 月 X 日获得贵公司期权资金结算业务资格。

目前，我行因 XX 原因向贵公司申请注销期权资金结算业务资格。现按照贵公司的规定提交如下申请材料，请予审核。

申请材料列表：

特此申请，请予受理。

申请单位全称：

（加盖公章）

年 月 日