

中国证券登记结算有限责任公司
结算参与者期权结算业务
管理指引

中国证券登记结算有限责任公司

目录

第一章	期权结算业务资格申请	1
第一节	期权结算业务资格准入条件	1
第二节	申请流程	2
第二章	委托结算	4
一、	委托结算的建立	4
二、	委托结算的解除	5
第三章	常规管理与风险管理	6
第一节	监督检查	7
一、	年度报告	7
二、	年度检查	7
三、	自律管理措施	9
第二节	注销或终止资格	9
一、	资格注销或终止的情形	9
二、	结算参与人申请注销期权结算业务资格流程	9
第四章	附则	10

中国证券登记结算有限责任公司

结算参与人期权结算业务管理指引

为规范股票期权（以下简称“期权”）结算业务结算参与人的结算业务行为，防范结算风险，根据《股票期权交易试点管理办法》、《结算参与人管理规则》、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 期权结算业务资格申请

第一节 期权结算业务资格准入条件

一、期权经营机构拟申请本公司期权结算业务资格的，应满足以下条件：

（一）依据《结算参与人管理规则》获得本公司参与多边净额担保结算业务资格。其中，非证券公司类期权经营机构申请多边净额担保结算业务资格的，除符合《结算参与人管理规则》第七条的规定外，还应当满足净资本不低于人民币 3 亿元的条件；

（二）符合中国证监会《证券期货经营机构参与股票期权交易试点指引》关于开展股票期权业务的相关要求；

（三）具备完善的期权结算内部控制制度和技术系统；

（四）具有符合资格的期权结算业务人员及管理人员，其中负责股票期权经纪业务的高级管理人员应具备股票期权业务知识和相应

的专业能力以及与拟任职务相适应的管理经历，拟从事期权结算业务人员中同时取得证券和期货从业人员资格的专业人员不少于 3 人；

（四）最近一年内未发生重大违规违约行为；

（五）本公司认为须具备的其他条件。

二、不具有本公司期权结算业务资格的期权经营机构，应当按照本公司《结算参与者管理规则》关于委托结算的相关要求，委托获得本公司证券公司类结算参与者（甲类）资格的期权经营机构代为办理期权结算业务，具体办理流程见本指引第二章。

第二节 申请流程

期权经营机构拟申请期权结算业务资格的，应当按以下程序向本公司提出申请。

一、提交申请材料

期权经营机构拟申请期权结算业务资格的，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）：

（一）申请书（含申请表）；

申请书至少应当包含下列内容：

- 1、人员配置、技术准备情况；
- 2、公司治理结构与组织机构说明；
- 3、最近一年内未发生重大违规违约行为情况说明；
- 4、期权业务部门负责人和业务经办人员的姓名、通讯方式等信息；

(二) 符合中国证监会规定的开展股票期权业务相关条件的情况说明和承诺(仅适用于证券公司类申请人);

(三) 监管部门授予申请人金融期货经纪业务资格的批复文件(仅适用于期货公司类申请人);

(四) 与本公司签订的《股票期权业务试点证券资金结算协议》(申请人法定代表人签字、盖申请人法人公章及骑缝章);

(五) 内部结算风险控制制度及说明;

(六) 法定代表人授权委托书;

(七) 经办人有效身份证明文件的复印件;

(八) 本公司要求的其他材料。

二、资格审核

本公司依据上述申请材料以及相关交易所核准申请人开办期权业务的来函开展资格审核工作。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,做出核准或者不核准期权结算业务资格的决定。决定核准的,出具书面核准文件,向中国证监会报告并在本公司网站予以公告;决定不核准的,书面通知申请人。

三、开展期权结算业务

经核准取得期权结算业务资格的结算参与者(以下简称“期权结算参与者”),应当根据本公司期权结算相关规则和业务通知的要求,及时向本公司分支机构申请设立相关结算账户、分别缴纳期权结算准备金最低余额部分和结算担保金基础部分、报备业务联系人信息,并完成本公司要求的其他事项后,方可开展期权结算业务。

四、 业务联系人信息报备

期权结算参与人应当指定一名部门负责人和两名联系人。

部门负责人是结算参与人与本公司进行期权结算业务联络的指定负责人。两名联系人分别由一名业务联系人与一名技术联系人担任，具体负责与本公司进行期权结算业务联系。

期权业务部门负责人和联系人发生变更、或其联系方式发生变更的，应提前 5 个工作日以电子或书面方式向本公司总部及相关分支机构备案。

第二章 委托结算

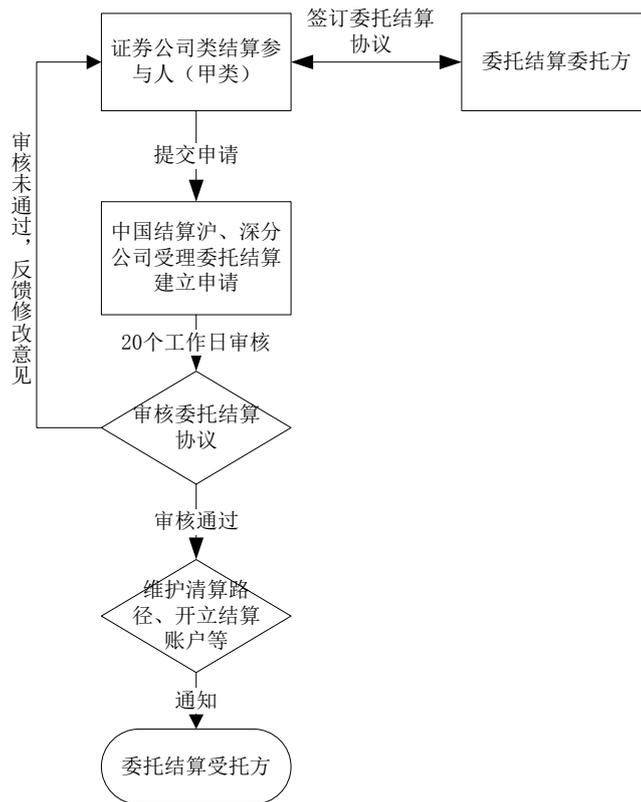
一、 委托结算的建立

（一）根据本公司《结算参与人管理规则》、期权结算相关制度规则的规定，直接参与交易但没有取得本公司结算参与人资格的机构可委托获得本公司期权结算业务资格的证券公司类结算参与人（甲类）为其办理期权结算业务，双方签订委托结算协议。委托结算协议是受托方与委托方据以建立法律关系、约定权利义务、开展委托结算业务活动、明确争议解决方式的法律文件。

委托结算协议应包含本公司要求的必备条款，受托方与委托方也可以根据实际需要自行补充其他条款，补充内容不得与必备条款的规定相抵触。

（二）本公司相关分支机构将按照结算路径管理的要求，受理委托结算建立申请。申请人应提交双方签字盖章的委托结算协议，以及

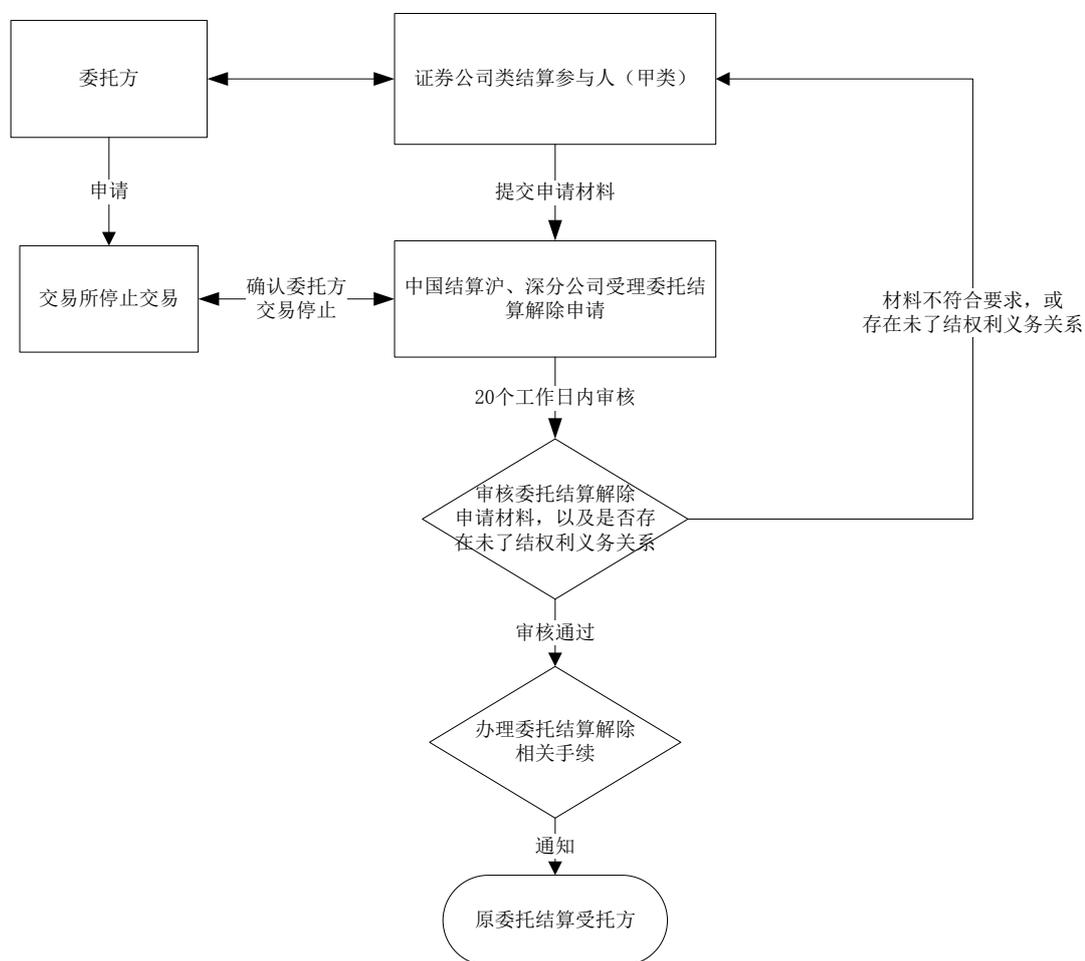
本公司相关分支机构要求的其他相关材料。本公司相关分支机构自收到完整的申请材料之日起 20 个工作日内予以审核，如有意见将通知受托方修改；审核通过后，为其办理委托结算建立手续。具体流程如下图所示：



二、委托结算的解除

(一) 委托结算双方拟解除委托结算的，委托方应首先向交易所申请停止交易，本公司相关分支机构确认交易所已停止委托方交易，且受托方不存在因委托方或委托方客户原因产生的与本公司尚未了结的权利义务关系的，本公司相关分支机构将按照结算路径管理等要求，受理委托结算解除申请。申请人应提交双方签字盖章的委托结算解除申请以及本公司相关分支机构要求的其他材料。申请人应在委托

结算关系解除前至少 20 个工作日提出申请，相关分支机构审核通过后，为其办理委托结算解除手续。 具体流程如下图所示：



（二）委托方拟直接参与本公司期权结算业务的，应首先按照前述流程解除委托结算后，按照本指引向本公司申请期权结算业务资格。

（三）委托方拟更换受托方的，应首先按照前述流程解除原委托结算关系后，方可办理新的委托结算关系的建立。

第三章 常规管理与风险管理

本公司按照相关业务规则对期权结算参与人实施持续性管理。

第一节 监督检查

一、年度报告

期权结算参与者应当按照《结算参与者管理规则》第二十条相关规定，于每一会计年度结束后4个月内向本公司提交年度结算业务工作报告，并在年度结算业务工作报告中补充期权结算业务相关内容，包括但不限于以下内容：

- 1、 期权结算业务的基本情况；
- 2、 对本公司相关规则的执行情况；
- 3、 发生的结算风险、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、 客户保证金存管情况；
- 7、 本公司要求的其他内容。

除《结算参与者管理规则》第二十条规定的材料外，非证券公司类期权结算参与者还应提交上年度经审计的财务报告，以及具有证券期货相关业务资格的会计师事务所出具的内部控制报告。

二、年度检查

本公司按照《结算参与者管理规则》第二十二条规定，在每一会计年度结束后6个月内，对结算参与者进行年度检查。对于不符合期权结算业务资格的，本公司可以实施降级（仅适用于甲类结算参与者）或取消期权结算业务资格等措施。年度检查包括现场检查和非现场检

查。

（一）现场检查

本公司可以根据中国证监会的统一安排，或根据实际业务需要自行安排，进行现场检查。

本公司根据实际业务需要实施现场检查的，实施现场检查前将通过电话或邮件形式与相关结算参与人进行前期沟通，并将至少提前5个工作日以发函的形式通知结算参与人，并向结算参与人明确检查提纲及需要其提供的文件。实施现场检查时，检查人员应当出示身份证和本公司出具的检查通知。

检查人员进行现场检查时，在不违反相关法律法规的前提下，检查人员应按照《结算参与人管理规则》第二十四、二十五、二十六条的规定开展现场检查工作，并可采取如下检查形式，结算参与人应积极配合：

- 1、查阅、记录、复制相关情况资料及文件；
- 2、检查期权结算业务相关技术系统的运行状况；
- 3、约谈技术或业务相关人员；
- 4、本公司要求的其他检查形式。

（二）非现场检查

本公司按照《结算参与人管理规则》、期权结算相关业务规则等对期权结算参与人进行日常风险监测、突发事件专项报告、临时压力测试等非现场检查工作。

三、 自律管理措施

本公司有权依据《结算参与者管理规则》、参与机构自律管理规定以及本公司期权结算相关业务规则，对期权结算参与人和参与期权结算业务活动的主体进行自律管理。

第二节 注销或终止资格

一、 资格注销或终止的情形

结算参与者出现下列情况之一的，本公司可以注销其期权结算业务资格：

- （一） 向本公司申请注销其期权结算业务资格；
- （二） 不再具备本指引规定的期权结算业务资格条件；
- （三） 严重违反本公司相关业务规则；
- （四） 被依法撤销、关闭、解散或宣告破产；
- （五） 证券交易所取消其会员或非会员交易资格；
- （六） 本公司认为应当注销期权结算业务资格的其他情况。

二、 结算参与者申请注销期权结算业务流程

结算参与者申请注销其期权结算业务资格的，应以电子或书面方式提交以下材料：

- （一） 申请书；
- （二） 法定代表人委托授权书；
- （三） 经办人的有效身份证明文件的复印件；
- （四） 本公司要求的其他材料。

申请人在提交完整有效的申请材料后，需尽快与本公司相关分支机构办理期权结算业务相关的债权债务关系的结清、结算路径及交易单元的清理、期权相关保证金账户和衍生品合约账户的销户等手续。

相关手续办理完成且申请材料审核通过的，本公司向申请人出具期权结算业务资格注销书面核准文件，同时，向中国证监会报备，并在本公司网站予以公告。

第四章 附则

一、本指引未明确事项，按照本公司《结算参与者管理规则》、《证券登记结算业务参与机构自律管理措施实施细则》、期权结算相关制度规则以及本公司相关业务规则等相关业务规定办理。

二、本指引由本公司负责解释。

三、本指引自发布之日起实施。

附件：期权结算业务资格申请等材料范本

附件：期权结算业务资格申请等材料范本

中国证券登记结算有限责任公司
期权结算业务资格
申请等材料范本

目 录

文件一：期权结算业务资格申请书

文件二：符合中国证监会规定的开展股票期权业务相关条件的情况说明和承诺（证券公司类申请人）

文件三：法定代表人授权委托书

文件四：结算参与者申请注销期权结算业务资格申请书

文件五：内部结算风险控制制度及说明

文件一：期权结算参与人资格申请书

**关于办理中国证券登记结算有限责任公司
期权结算业务资格的申请**

中国证券登记结算有限责任公司：

本公司成立时间 XX、注册地 XX、注册资本 XX。本公司已于 X 年 X 月获得贵公司参与多边净额担保结算业务结算参与人资格。本公司已通过 XX 交易所股票期权业务技术系统测试。

（申请人现阶段业务开展的基本情况介绍，包括人员配置、资质情况及技术准备情况等；申请人公司治理结构与组织机构说明；申请人最近一年内未发生重大违规违约行为情况说明等）

本公司承诺除开展与股票期权备兑开仓以及行权相关的证券现货经纪结算业务外，不办理其他现货结算业务（仅适用于期货公司）。

本公司承诺所提交所有资料真实、完整、准确。

综上，本公司特向贵公司申请期权结算业务资格，请予受理。

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

期权结算业务资格申请表

申请人全称					
英文名称					
注册地址					
注册资本	(万元)	法定代表人			
通讯地址		邮政编码			
设立时间		批准机关			
结算参与人资格类型	<input type="checkbox"/> 证券公司类结算参与人（甲类） <input type="checkbox"/> 证券公司类结算参与人（乙类） <input type="checkbox"/> 其他类结算参与人				
经营证券业务许可证号		企业法人营业执照号			
申请人期权业务部门负责人信息					
姓名	职务	联系电话	移动电话	电子邮箱	身份证明
申请人业务技术联系人信息					
姓名	职务	联系电话	移动电话	电子邮箱	身份证明
<p>申请人承诺事项：</p> <p>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”）期权结算业务资格，保证提供的所有资料真实、完整、准确；</p> <p>2、本单位获得你公司期权结算业务资格后，将严格遵守你公司《结算参与人期权结算业务管理指引》、双方签订的协议及你公司相关制度、规则。</p>					
申请单位全称： （加盖公章） 年 月 日					

文件二：符合中国证监会规定的开展股票期权业务相关条件
的情况说明和承诺（证券公司类申请人）

关于符合中国证监会规定的开展股票期权业务 相关条件的情况说明和承诺

中国证券登记结算有限责任公司：

本公司已具备中国证监会规定的开展股票期权业务的相关条件，现说明如下：

- 一、具有证券经纪业务（及自营业务）资格；
- 二、股票期权经纪业务制度健全（附全文）；
- 三、具备符合资格的高级管理人员及专业人员（附人员的详细介绍）；
- 四、具有满足从事股票期权经纪业务相关要求的营业场所、经营设备、技术系统等软硬件设施；
- 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，股票期权经纪业务技术系统已通过相关证券交易所、贵公司组织的测试；
- 六、公司及其董事、监事、高级管理人员最近 1 年内未因重大违法违规行为受到行政处罚或刑事处罚。

本公司承诺上述事项真实、准确、完整。

特此说明。

申请单位全称：

（加盖公章）

年 月 日

文件三：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：

兹授权我单位_____部门_____同志
办理中国证券登记结算有限责任公司期权结算业务资格申
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

文件四： 结算参与者申请注销期权结算业务资格申请书

**关于办理注销中国证券登记结算有限责任公司
期权结算业务资格的申请**

中国证券登记结算有限责任公司：

本公司于 X 年 X 月 X 日获得贵公司期权结算业务资格。

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

特此申请，请予受理。

申请单位全称：

（加盖公章）

年 月 日

文件五：内部结算风险控制制度及说明

内部结算风险控制制度及说明

中国证券登记结算有限责任公司：

本公司根据贵司有关业务规则及本公司的有关结算风险控制要求（附相关要求文件名称），建立健全本公司清算业务内部控制管理，管理范围包括（附管理范围）。现对本公司的期权业务结算风险控制作如下说明：

- 一、期权业务结算技术设施和结算部门人员的配备情况
- 二、期权结算业务相关风险的防范和监控措施
- 三、压力测试实施方案及结果（仅适用于证券公司类申请人）
- 四、异常情况下的应急处理预案
- 五、主要风险控制制度（附全文）

申请单位全称：

（加盖公章）

年 月 日