

中国证券登记结算有限责任公司 关于上海证券交易所股票期权试点结算规则

关于发布《中国证券登记结算有限责任公司 关于上海证券交易所股票期权试点结算规则》的通知

中国结算发字[2015]2号

各市场参与者:

为规范股票期权试点结算业务,根据中国证监会《股票期权交易试点管理办法》及其他有关规定,中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)制定了《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所股票期权试点结算规则》(以下简称“期权结算规则”)。现予发布,并就有关事项通知如下:

一、请结算参与人、期权经营机构按照《期权结算规则》的规定,尽快做好业务和技术准备。

二、关于中国结算委托结算银行直接扣款(第四十七条)、结算参与人提前申报暂不交付合约标的及提交其他交收担保品(第六十条第三款)的规定暂不实施,具体实施时间另行通知。

三、关于组合策略维持保证金收取(第四十二条)、结算参与人利用自营证券完成经纪业务中的行权交割义务(第六十一条)的规定暂不实施,具体实施时间另行通知。

四、关于证券形式交纳保证金(第十条、第三十六条、第三十七条)的规定暂不实施,中国结算及上海证券交易所将就此进一步作出具体规定,具体实施时间另行通知。

特此通知。

中国证券登记结算有限责任公司
二〇一五年一月九日

第一章 总则

第一条 为规范上海证券交易所(以下简称“上交所”)股票期权(以下简称“期权”)结算业务,明确相关当事人之间的权利义务关系,防范和化解风险,根据《证券法》、《期货交易管理条例》、《股票期权交易试点管理办法》等法律、行政法规、部门规章以及中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“本公司”)相关业务规则,制定本规则。

第二条 期权结算业务包括日常交易结算和行权结算,是指本公司根据本规则对期权日常交易和行权进行清算,并完成期权合约记录、资金收入、合约标的划转的行为。

第三条 期权经营机构(以下简称“经营机构”),具有期权结算业务资格的结算银行(以下简称“结算银行”),投资者应当遵守本规则的规定。本规则未作规定的,适用本公司其他有关规定。

结算银行申请本公司期权结算业务资格的有关事项由本公司另行规定。

第四条 本公司对经营机构和参与期权结算业务活动的主体进行自律管理。

第二章 期权结算参与人管理

第五条 经营机构直接参与本公司期权结算业务的,应当首先按照本公司结算参与人管理有关规定,向本公司申请多边净额担保结算业务资格。

非证券公司类经营机构申请多边净额担保结算业务资格的,除符合本公司结算参与人管理有关规定外,还应当满足净资本不低于人民币3亿元的条件。

具有本公司多边净额担保结算业务资格的经营机构,可以向本公司申请期权结算业务资格。

第六条 具有本公司期权结算业务资格的经营机构(以下简称“结算参与人”),开展期权结算业务的,应当与本公司签订结算协议。

不具有本公司期权结算业务资格的经营机构(以下简称“非结算参与人机构”),应当按照本公司结算参与人管理有关规定的要求,委托具有本公司期权委托结算业务资格的结算参与人为办理期权结算业务。

非结算参与人机构委托具有本公司期权委托结算业务资格的结算参与人与本公司进行期权结算的,应当与其签订委托结算协议。委托结算协议应当包括本公司制定的必备条款,并向本公司报备。

第七条 经营机构申请本公司期权结算业务资格的,应当同时符合以下条件:

(一)具有本公司多边净额担保结算业务资格;

(二)符合中国证监会规定的开展股票期权业务相关要求;

第二章 账户管理

第一节 保证金账户

第九条 结算参与人应当以自己的名义,向本公司申请开立股票期权资金保证金账户(以下简称“资金保证金账户”),用于存放结算参与人期权交易的权利金、行权资金、以现金形式提交的保证金。

第十条 结算参与人应当以自己的名义,向本公司申请开立股票期权保证金账户(以下简称“证券保证金账户”),用于存放结算参与人期权交易业务中以证券形式提交的保证金。

第十一条 结算参与人同时开展自营与经纪业务的,应当分别开立自营资金保证金账户、自营证券保证金账户、客户资金保证金账户以及客户证券保证金账户。

第十二条 结算参与人申请开立资金保证金账户和证券保证金账户时,应当向本公司提交以下材料:

(一)结算参与人资格申请报告和申请表;

(二)企业法人营业执照正本复印件;

(三)具有证券期货相关业务资格的会计师事务所出具的最近两年财务审计报告或者公司设立时的验资报告;

(四)公司组织结构说明;

(五)结算风险内部控制制度说明;

(六)法定代表人对经办人的授权书;

(七)经办人有效身份证明文件及复印件;

(八)预留印鉴卡一式两份;

(九)本公司要求的其他资料。

第十三条 本公司按照与结算银行商定的利率、计息方法以及计息日期,向结算参与人计付资金保证金账户内的资金利息。

第十四条 结算参与人应当在本公司预留指定收款银行账户,用于接收从其资金保证金账户划出的资金。指定收款银行账户名称应当与结算参与人名称一致,另有规定的除外。

结算参与人应当在本公司预留直接扣款银行账户,用于交易结算保证金不足时的直接扣款。结算参与人应当事先与结算银行签订相关协议,授权结算银行根据本公司发送的划款指令从结算参与人直接扣款银行账户直接扣划资金至本公司在该结算银行开立的账户。

投资者应当在本公司预留直接扣款银行账户,用于交易结算保证金不足时的直接扣款。结算参与人应当事先与结算银行签订相关协议,授权结算银行根据本公司发送的划款指令从结算参与人直接扣款银行账户直接扣划资金至本公司在该结算银行开立的账户。

投资者应当在本公司预留直接扣款银行账户,用于交易结算保证金不足时的直接扣款。结算参与人应当事先与结算银行