

# 深圳排放权交易所 结算细则 (暂行)

二〇一四年十二月

# 目 录

|                  |    |
|------------------|----|
| 第一章 总 则 .....    | 3  |
| 第二章 结算机构 .....   | 4  |
| 第三章 结算银行 .....   | 6  |
| 第四章 清算交收账户 ..... | 8  |
| 第五章 日常结算 .....   | 10 |
| 第六章 交收违约处理 ..... | 13 |
| 第七章 风险与责任 .....  | 15 |
| 第八章 附 则 .....    | 17 |

## **第一章 总则**

**1.1** 为规范深圳排放权交易所（以下简称“本所”）碳排放权交易结算行为，保护交易当事人的合法权益和社会公众利益，防范和化解交易市场风险，保障交易结算的正常进行，根据《深圳排放权交易所现货交易规则（暂行）》的有关规定，制定本细则。

**1.2** 结算是指本所根据交易结果和本所有关规定对交易参与人的碳排放权交易产品、交易资金、交易经手费、佣金及其它有关款项进行计算和划拨的业务活动。

上述交易参与人包括本所交易会员以及通过本所经纪会员开户的投资机构和自然人。

**1.3** 本所对碳排放权交易产品和资金实行一级结算制度，由本所为所有交易参与人统一进行结算。

**1.4** 除另行规定外，本所对碳排放权交易产品实行每日全额逐笔结算制度；对资金实行每日净额结算制度。

**1.5** 本细则适用于本所所有结算活动。本所、注册登记簿管理机构、交易参与人和指定结算银行（以下简称“结算银行”）及相关工作人员应当遵守本细则。

## **第二章 结算机构**

**2.1** 结算机构是指本所设置的结算部门。结算机构负责本所交易的统一结算，对交易参与人的碳排放权交易产品进行清算，对交易资金及其他款项进行计算、划拨，同时管理和防范结算风险。

**2.2** 本所结算机构的主要职责是：

- （一）控制结算风险；
- （二）对交易参与人的交易结果进行结算，并编制交易参与人的结算账表；
- （三）审核、办理资金往来汇划业务；
- （四）统计、登记和报告交易结算情况，为本所提供各种结算统计报表；
- （五）办理交易参与人资金及其他有关款项结算业务；
- （六）妥善保管结算资料、结算报表及相关凭证、账册；
- （七）处理交易参与人资金延误纠纷；
- （八）处理与结算有关的其他业务。

**2.3** 所有在本所交易系统中成交的交易应当通过本所结算机构进行统一结算。

**2.4** 机构会员必须有专职部门（或专人）负责结算工作，并将专职部门（或专人）的名单上报交易所备案。

**2.5** 本所在认为必要时有权检查交易参与人的结算资料、财务报表及相关的凭证和账册，交易参与人应当予以配合。

交易参与人应当妥善保管结算资料、财务报表及相关凭证和账册，以备查询和核实，保管期限不得少于 20 年。

**2.6** 结算机构及其工作人员应当保守本所和交易参与人的商业秘密。

### **第三章 结算银行**

**3.1** 本所实行交易资金第三方存管制度，切实维护交易参与人资金安全。

结算银行是指本所指定的、存放交易参与人交易结算资金、协助本所办理交易资金结算业务的商业银行。

**3.2** 结算银行须符合以下条件：

- （一）全国性商业银行，资金雄厚，信誉良好；
- （二）在全国各主要城市设有分支机构和营业网点；
- （三）拥有先进、快速的异地资金划拨手段；
- （四）具有健全的资金管理制度，以及具备监管交易资金的功能系统；
- （五）拥有懂得专业知识、风险防范意识强的结算专业技术人员；
- （六）本所认为应当具备的其他条件。

符合以上条件，并经本所同意成为结算银行后，结算银行与本所应当签订相应协议，明确双方权利和义务，规范相关业务手续。

**3.3** 结算银行的职责与义务包括：

（一）开设交易所交易结算资金汇总账户、交易参与人交易结算资金管理账户及其他与结算有关的账户；

（二）根据本所提供的交易清算数据及时划转交易参与人的交易资金，并向本所及时反馈交易资金划转情况；

（三）协助本所在不同结算银行的交易结算资金汇总账户间的资金划转；

（四）根据本所要求，协助本所核查交易参与人交易资金的来源和去向；

（五）向本所及时通报交易参与人在资金结算方面的不良行为；

（六）配合本所建立数据对账制度；

（七）保守本所、交易参与人的商业秘密；

（八）其他法律法规、规章和本所规定的义务。

## 第四章 清算交收账户

4.1 本所在结算银行以本所的名义，开立交易结算资金汇总账户，用于存放交易参与人的交易资金及其他款项。

4.2 交易参与人应当在深圳市碳排放权注册登记簿中开立碳排放权账户，用于存放交易参与人的碳排放权交易产品。

4.3 交易参与人应当在本所指定的结算银行，开立交易结算资金管理帐户，用于记载交易参与人交易结算资金的变动情况。

4.4 交易参与人在办理入市手续时，应当与本所、结算银行签订三方银行资金存管协议或与结算银行签订双边交易结算资金存管协议。

4.5 本所对交易参与人划入本所交易结算资金汇总账户的交易结算资金实行分账管理，为每一交易参与人设立明细账户，按日序时登记核算每一笔出金、入金、交易经手费、税费、佣金等。

任何单位和个人不得擅自挪用、占用、借用以本所名义存放在结算银行的交易参与人的交易结算资金，不得擅自将交易参与人的交易结算资金为他人提供担保。



**4.6** 交易参与人需要变更银行结算账户或账户信息的，必须向本所清算部门提出书面申请，经本所清算部门批准后方可变更。

**4.7** 交易所有权在不通知交易参与人的情况下通过结算银行从交易参与人的交易结算资金管理账户中收取各项应收款项，并有权随时查询该账户的资金情况。

## **第五章 日常结算**

**5.1** 交易参与人进行买入申报时，其交易账户中应有足额的可用资金，否则该申报无效；交易参与人进行卖出申报时，其交易账户中应有足额的可交易碳排放权交易产品，否则该申报无效。

**5.2** 每笔交易的成交价为该笔交易的结算价。

**5.3** 交易日日终，本所依据成交结果和相关非交易数据，计算出各交易参与人各类碳排放权交易产品的应收和（或）应付额，轧差计算出各交易参与人应收或应付资金净额，形成碳排放权交易产品和资金的当日清算结果。

**5.4** 注册登记簿管理机构根据当日碳排放权交易产品清算结果，对碳排放权交易产品进行全额逐笔交收。

**5.5** 本所根据当日资金清算结果和交易参与人碳排放权交易产品交收完成情况，确定交收日交易参与人应付或应收资金。

**5.6** 结算银行根据当日资金清算结果和碳排放权交易产品交收完成情况，对交收日交易参与人应付或应收资金进行统一划转，相应减少或增加交易参与人的交易资金。

**5.7** 本所按规定的标准向交易参与者收取交易经手费、佣金和国家规定的相关税费。

佣金为本所代经纪会员向其代理开户的投资机构及自然人收取，由本所定期向经纪会员返还。

**5.8** 交易参与者应加强交易资金管理，严格执行本所有关规则 and 规定。交易参与者应及时获取和核对结算数据，妥善保管结算方面的资料、凭证、账册等以备查询。

**5.9** 当日结算完成后，交易参与者可通过交易系统获得相关的结算数据。

**5.10** 如遇特殊情况造成本所不能提供结算数据，本所将及时公告，并采取相应措施。

**5.11** 交易参与者对结算数据有异议的，应当在不迟于下一交易日开市前三十分钟以书面形式或电子邮件向本所结算机构提出，并电话通知结算机构工作人员。如交易参与者在上述时间内没有对结算数据提出异议，则视作交易参与者已认可结算数据的正确性。

以电子邮件形式提出的，应当在当天中午十二点前补交书面形式的结算数据异议材料。

**5.12** 交易参与者资金划转：

（一）入金。入金是指交易参与人从其银行结算账户向交易所交易结算资金汇总账户划入资金的行为。

交易参与人可以在开市时间内通过交易所客户端或银行端向交易所提出入金申请，经结算银行确认到账后，交易所将相应增加交易参与人交易账户内的交易资金。

（二）出金。出金是指交易参与人将其资金从交易所交易结算资金汇总账户向其银行结算账户划出的行为。

交易参与人可以在开市时间内通过交易所客户端或银行端向交易所提出出金申请，经交易所审核后通知结算银行划转。

#### **5.13 交易参与人出金标准为：**

可出金额=当前余额-冻结金额

**5.14** 有下列情况之一的交易参与人，本所可以限制其出金：

（一）涉嫌重大违规，被本所立案调查的；

（二）被司法或其他有关部门正式立案调查，且正处在调查期间的；

（三）本所认为必要的其它情况。

**5.15** 本所交易日所有交易的清算时间为当日15:30-17:00。本所可以根据需要调整清算交收时间。

## 第六章 交收违约处理

6.1 在交收日集中交收前，交易参与人碳排放权账户内应付碳排放权交易产品数量少于其清算应付额的，构成交易参与人碳排放权交易产品交收违约。

6.2 发生交易参与人碳排放权交易产品交收违约的，本所可采取以下措施对违约交易参与人进行碳排放权交易产品交收违约处理：

（一）暂不交付交易参与人相应的应收资金；

（二）通知交易参与人追加碳排放权交易产品，在下一交易日开市前补足。追加数量应当等于或大于交易参与人碳排放权交易产品违约数量；

（三）交易参与人在本所规定的期限内补足违约碳排放权交易产品的，本所将暂不交付的应收资金交付给该交易参与人；交易参与人未能在本所规定的期限内补足违约碳排放权交易产品的，按照《深圳排放权交易所违规违约处理规则（暂行）》的规定进行处理。

6.3 在交收日集中交收前，交易参与人交易结算资金管理账户内的可交收资金少于其交收日应付净额的，构成交易参与人资金交收违约。

交易参与人的交收日应付净额，由本所根据交易参与人资金清算结果和交易参与人碳排放权交易产品交收完成情况确定。

**6.4** 发生交易参与人资金交收违约的，本所有权采取以下措施对违约交易参与人进行处理：

（一）暂不交付交易参与人相应的应收碳排放权交易产品；

（二）发出追加资金通知，要求发生资金交收违约的交易参与人在下一交易日开市前补足。

（三）交易参与人在本所规定的期限内补足交收违约资金的，本所将暂不交付的相关碳排放权交易产品交付给该交易参与人；交易参与人未能在本所规定的期限内补足交收违约资金的，按照《深圳排放权交易所违规违约处理规则（暂行）》的规定进行处理。

**6.5** 交易参与人发生资金交收违约的，本所按照《深圳排放权交易所违规违约处理规则（暂行）》的规定对违约交易参与人计收违约交收资金的利息和违约金。

## 第七章 风险与责任

7.1 在结算过程中，出现下列情形之一的，本所有权宣布进入异常情况，采取紧急措施化解风险：

（一）因地震、水灾、火灾等不可抗力或者计算机系统故障等不可归责于本所的原因导致结算无法正常进行；

（二）本所规定的其他情况。

出现以上所列各项异常情况时，本所有权决定采取延期结算、限制交易、限制资金出入等紧急措施。

因本所采取应对异常情况的措施而造成的损失，本所不承担责任。

7.2 有证据显示交易参与者违反本所结算细则并且对市场正在产生或者将产生重大影响的，为防止违规行为后果进一步扩大，本所有权对该交易参与者采取下列临时处置措施：

（一）限制入金；

（二）限制出金；

（三）限制买卖；

（四）限期转让；

（五）强行转让。

因交易参与者违反本所结算细则，并在本所采取以上相应措施后造成的损失，本所不承担责任。



## 第八章 附则

8.1 本细则中下列用语定义如下：

（一）结算，指清算和交收。

（二）清算，指按照规则计算碳排放权交易产品和资金的应收应付数量。清算不发生碳排放权交易产品和资金的实际转移。

（三）交收，指根据确定的清算结果，通过转移碳排放权交易产品和资金履行交易中产生的债权和债务的问题。交收完成碳排放权交易产品和资金的实际转移。

（四）交易日日终，指交易日当日碳排放权交易时间结束。

（五）清算交收账户，指用于完成碳排放权交易产品及资金结算和结算风险处置的账户。

（五）银行结算账户，指客户在银行开立的，用于交易参与人资金往来结算的存款账户。

（六）交易结算资金汇总账户，指银行为本所开设的用于存放本所交易参与人交易资金及其他款项的结算账户，该账户与本所自有资金账户严格区分。

（七）交易结算资金管理账户，指银行为交易参与人在交易结算资金汇总账户下开立的子账户，是用于记载交易参与人交易结算资金变动情况的明细账。该账户与客户的银行结算账户和客户的交易账户之间建立一一对应关系。

**8.2** 本细则由本所负责解释和修订。

**8.3** 本细则自发布之日起实施。

附件一：结算流程图

