

# 湖北碳排放权交易中心碳排放权现货远期交易 结算细则

## 第一章 总则

**第一条** 为规范湖北碳排放权交易中心（以下简称“交易中心”）现货远期交易的结算行为，保护市场参与人的合法权益和社会公众利益，防范和化解现货远期交易市场风险，根据《湖北碳排放权交易中心碳排放权现货远期交易规则》，制定本细则。

**第二条** 结算是指根据交易结果和交易中心有关规定对市场参与人交易保证金、盈亏、手续费、履约划款及其他有关款项进行计算、划拨的业务活动。

**第三条** 交易中心结算实行保证金制度、当日结算制度等。

**第四条** 交易中心实行统一结算制度，交易中心对所有市场参与人进行结算。

**第五条** 交易中心、市场参与人、交易中心指定结算银行（以下简称“结算银行”）必须遵守本细则。

## 第二章 结算机构

**第六条** 交易中心设立结算部，负责现货远期交易的统一结算、保证金管理。

**第七条** 交易中心结算部的主要职责：

- （一）编制市场参与人的结算账表；
- （二）办理资金往来汇划业务；
- （三）统计、登记和报告交易结算情况；
- （四）办理履约结算业务；
- （五）控制结算风险；

(六) 按规定管理保证金。

**第八条** 所有在交易中心交易系统中成交的订单必须通过交易中心进行统一结算。

**第九条** 交易中心应保证结算资料、财务报表及相关凭证、账册的完整和安全，保存期限应不少于 20 年。

### **第三章 结算银行**

**第十条** 结算银行是指由交易中心指定的、协助交易中心办理结算业务的银行。

**第十一条** 交易中心在各结算银行开设专用结算账户，用于结算市场参与人应交付的保证金及相关款项。

**第十二条** 市场参与人须在结算银行开设一个资金账户，用于资金的存放和划转。

**第十三条** 结算银行与交易中心须签订合作协议，明确双方的权利和义务，以规范相关业务流程。

**第十四条** 结算银行的职责和业务范围：

- (一) 为市场参与人开设资金账户；
- (二) 为交易中心开设专用结算账户；
- (三) 根据交易中心和市场参与人要求，在符合国家法律、法规及政策的前提下提供各类金融服务；
- (四) 协助交易中心管理市场参与人的资金划转；
- (五) 协助交易中心在不同结算银行的专用结算账户间的资金划转；
- (六) 配合交易中心建立数据对账制度；

（七）保守交易中心和市场参与人的商业秘密。

市场参与人在办理入市手续时，需要与交易中心、结算银行签订三方协议或与结算银行签订双方协议。

#### **第四章 日常结算**

**第十五条** 交易中心实行保证金制度。市场参与者应按规定向交易中心交纳一定的资金，用于结算和保证履约。

保证金分为结算准备金和交易保证金。

**第十六条** 结算准备金是指市场参与者为了交易结算在交易中心专用结算账户中预先准备的资金，是未被交易占用的保证金。结算准备金的最低余额由交易中心决定。

**第十七条** 若市场参与者结算准备金低于交易中心规定的最低余额时，须在下一个交易日开市前补足。未补足结算准备金禁止订立报价，且交易中心有权对其持仓强行转让，并以约定的方式通知市场参与者。

**第十八条** 交易保证金是指市场参与人在交易中心专用结算账户中确保订单履约的资金，是已被交易占用的保证金。当买卖双方成交后，交易中心按持仓订单价值的一定比例收取交易保证金。

**第十九条** 交易保证金收取标准按交易中心保证金制度有关规定执行。

**第二十条** 交易中心根据市场参与者当日成交金额收取交易手续费，收取标准由交易中心另行规定。

**第二十一条** 交易中心实行当日结算制度。

当日结算制度是指每日交易结束后，交易中心按当日结算价结算所有订单的盈亏及交易保证金等费用，对应收应付的款项实行划转，相应增加或减少市场参与人的结算准备金。

**第二十二条** 当日有成交价格的，当日结算价是指当日成交价格按照成交量的加权平均价。当日无成交价格的，当日结算价为前一交易日结算价。新标的物上市第一日若当日无成交则当日结算价=挂盘基准价。

**第二十三条** 现货远期交易以当日结算价作为计算当日盈亏的依据。具体计算公式如下：

当日盈亏 = 转让盈亏 + 持仓盈亏

转让盈亏 = 转让历史仓盈亏 + 转让当日仓盈亏

转让历史仓盈亏 =  $\sum[(\text{卖出转让价} - \text{上一交易日结算价}) \times \text{卖出转让量}] +$   
 $\sum[(\text{上一交易日结算价} - \text{买入转让价}) \times \text{买入转让量}]$

转让当日仓盈亏 =  $\sum[(\text{当日卖出转让价} - \text{当日买入订立价}) \times \text{卖出转让量}] +$   
 $\sum[(\text{当日卖出订立价} - \text{当日买入转让价}) \times \text{买入转让量}]$

持仓盈亏 = 历史持仓盈亏 + 当日订立持仓盈亏

历史持仓盈亏 =  $\sum[(\text{上一日结算价} - \text{当日结算价}) \times \text{卖出历史持仓量}] +$   
 $\sum[(\text{当日结算价} - \text{上一日结算价}) \times \text{买入历史持仓量}]$

当日订立持仓盈亏 =  $\sum[(\text{卖出订立价} - \text{当日结算价}) \times \text{卖出订立量}] +$   
 $\sum[(\text{当日结算价} - \text{买入订立价}) \times \text{买入订立量}]$

**第二十四条** 当日结算时的交易保证金超过昨日结算时的交易保证金部分从市场参与人结算准备金中扣划，当日结算时的交易保证金低于昨日结算时的交

易保证金部分划入市场参与人结算准备金。当日盈利划入市场参与人结算准备金，当日亏损从市场参与人结算准备金中扣划。

手续费等各项费用从市场参与人结算准备金中扣划。

**第二十五条** 结算准备金余额的具体计算公式如下：

当日结算准备金余额=上一交易日结算准备金余额+上一交易日交易保证金—当日交易保证金+当日盈亏+入金—出金—手续费等

**第二十六条** 结算完毕后，市场参与人的结算准备金低于交易中心规定的最低余额时，该结算结果即视为交易中心向市场参与人发出的追加保证金通知。

**第二十七条** 交易中心本着准确、快捷的原则为市场参与人办理出入金业务。正常情况下，市场参与人在每个交易日闭市之前提出的书面、电子等方式入金申请，交易中心将于当日闭市前完成市场参与人入金业务。特殊情况下，交易中心办理出入金业务时间顺延。

**第二十八条** 有下列情况之一的市场参与人，交易中心可限制市场参与人出金：

- （一）涉嫌重大违规，经交易中心立案调查的；
- （二）因投诉、举报、交易纠纷等被司法部门、交易中心或其他有关部门正式立案调查，且正处在调查期间；
- （三）交易中心认为必要的其他情况。

**第二十九条** 当日交易结束后，交易中心对每一市场参与人的盈亏、交易手续费、交易保证金等款项进行结算。交易中心采用发放结算单据或电子传输等方式向市场参与人提供当日结算数据。

**第三十条** 遇特殊情况造成交易中心不能按时提供结算数据，交易中心将另行通知提供结算数据的时间。

**第三十一条** 市场参与人如对结算数据有异议，应不迟于下一交易日开市前三十分钟以书面形式通知交易中心。遇特殊情况，市场参与人可在下一交易日开市后二小时内以书面形式通知交易中心。如在规定时间内市场参与人没有对结算数据提出异议，则视作市场参与人已认可结算数据的正确性。

## **第五章 履约结算**

**第三十二条** 市场参与人进行履约，应按规定向交易中心交纳履约手续费。具体标准在履约细则中载明。

履约手续费从市场参与人的结算准备金中扣划。

**第三十三条** 履约结算价采用现货远期交易自履约月第一个交易日起至最后交易日所有成交价格的加权平均价。

**第三十四条** 履约款项按履约结算价结算。

**第三十五条** 在履约期内，买方未能如数解付货款，卖方未能如数交付标的物，构成履约违约。

**第三十六条** 履约的结算业务按以下规定办理。

（一）最后交易日闭市后，买单持仓的交易保证金转为履约预付款，卖单持仓的交易保证金转为履约保证金；

（二）最后交易日结算时，交易中心对市场参与人的持仓按履约结算价进行结算处理，产生的盈亏计入当日转让盈亏；

（三）最后交易日结算时，交易中心从市场参与人的结算准备金中扣划履约手续费；

（四）标的物提交截止日 15:00 前，卖单持仓所有者应当将与其持仓相对应数量的标的物，从注册登记系统划转至交易系统；

标的物提交截止日为最后交易日后第四个交易日。

（五）最后履约日 15:00 前，买单持仓所有者应当将与其持仓相对应的货款与履约预付款的差额部分划入交易中心的专用结算账户；

（六）在规定时间内，卖方未能如数交付标的物，买方未能如数解付货款的，构成履约违约；

## **第六章 附录**

第三十七条 本细则中所称时间均为北京时间，除本细则有明确的规定外，“日”均指交易日。

第三十八条 本细则解释权属于湖北碳排放权交易中心。

第三十九条 本细则自公布之日起实施。