



# 连续交易会员培训——结算

结算部

# 连续交易相关流程

15:00收市、会员结算



20:30前，完成系统初始化

是

21:00开市

否

结算准备工作异常申报



正常入金

关注交易所通知

异常申报撤销



2:30收市



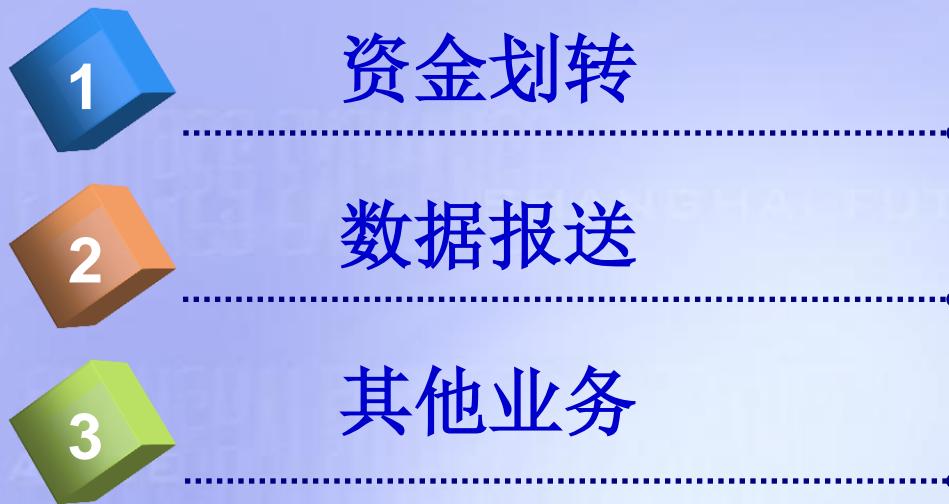
延迟开市

取消开市

15:00收市、会员结算



次日8:30前，  
完成系统初  
始化

- 
- 1 资金划转
  - 2 数据报送
  - 3 其他业务

1

# 资金划转

- 连续交易期间**会员入金**
- 连续交易期间**客户入金**
- 应急措施

# 连续交易期间会员入金



会员仍通过**期货资金管理系统**办理入金；

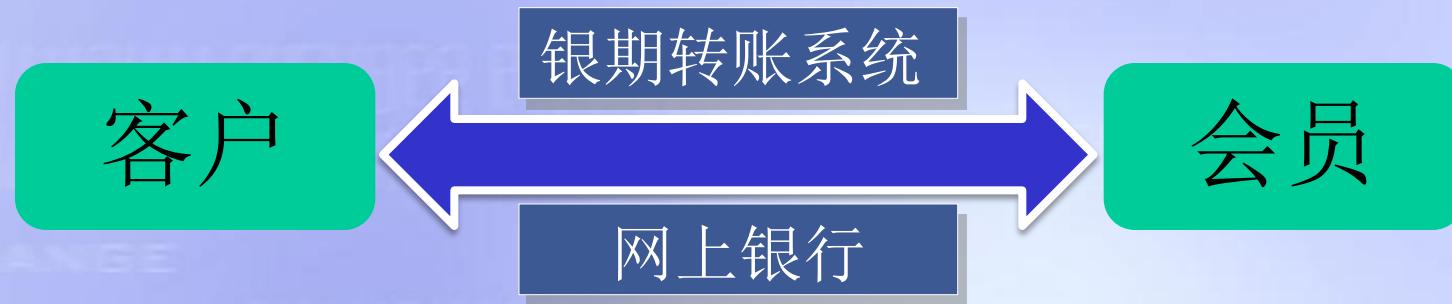
交易所**不办理**会员出金业务。

# 连续交易期间会员入金



- 不支持跨行划拨资金业务
- 为防范银行系统故障的风险，至少选择~~2家~~以上
- 提前做好资金调拨工作

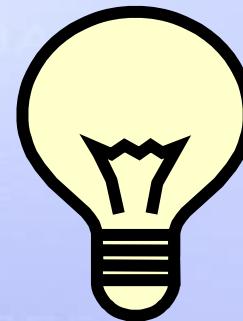
# 连续交易期间客户入金



- 银期转账系统
- 银期系统 **签到工作**
- 网银方式
- **确认网银方式的入金流程**

# 连续交易期间客户入金

- 5家存管银行
- 7\*24小时网上银行转账
- 17: 00之后 支持行内系统转帐  
不支持跨行系统的转帐



# 日盘出入金时间截点

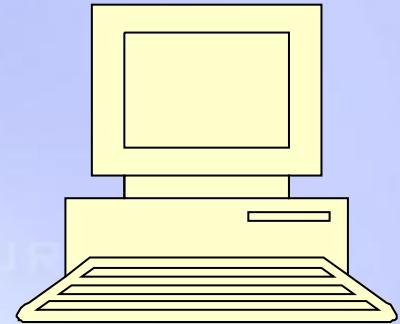
•15:00 日盘 入金转账截止

出金申请截止

# 应急情况

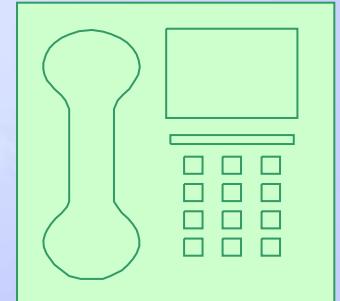
日常:

- 银行—交易所  
不同运营商 双线路备份



故障:

- 网银方式—交易所专用结算账户
- 联系连续交易值班人员
- 确认资金到账，结算系统中录入



# 数据报送

- 出入金切换时点
- 交易所日终结算数据发布
- 会员数据报送

# 出入金切换时点



- 出入金切换时点为17:00，即交易日切换时点
- 报送数据—保证金监控中心
- 17:00之前的出入金计入当前交易日，17:00之后的出入金计入下一个交易日

# 交易所日终结算数据发布

日终结算



发布数据

- 交易所最终数据发布：当日日盘结算后
- 正常：16:00前向会员端发送数据。

# 会员数据报送



- 有特殊情况应作说明
- 最终处理结果由保证金监控中心解释



# 其他业务

- 连续交易准备工作异常报告
- 连续交易期间有价证券充抵与提取
- 连续交易期间会员资金不足强平流程

# 连续交易准备工作异常报告

- 异常情况：20:30之前未完成结算或初始化工作的
- 申报（会员服务系统）
- 申报撤销（会员服务系统）
- 关注交易所开市情况

审慎原则

# 连续交易准备工作异常报告

- 原则：30%以上参与交易的会员未完成结算或初始化工作，交易所可以调整连续交易开市收市时间，或者暂停交易
- 百分比确定：  
异常申报会员数 / 参加连续交易会员数

# 连续交易期间有价证券充抵与提取

有价证券充抵业务



有价证券提取业务



期转现业务



# 会员资金不足强平流程

- 规则不变
- 连续交易和次日日盘交易的第一节作为**次日交易的第一节**
- 日盘结算完毕，结算准备金余额<最低余额时，该结算结果即视为交易所向会员发出的追加保证金通知
- 交易所通过存管银行从会员的专用资金账户中扣划

# 会员资金不足强平流程

- 若未能全额扣款成功，会员必须在当日连续交易开市前补足至结算准备金最低余额
- $0 < \text{结算准备金余额} < \text{结算准备金最低余额}$   
当日连续交易开市后**不得开新仓**
- $\text{结算准备金余额} < 0$   
按《上海期货交易所风险控制管理办法》的规定进行处理  
21:00~2:30+9:00~10:15会员自行处理时间段

谢谢！