

关于做好股票期权业务上线相关工作的通知

各结算参与者：

为做好股票期权业务上线准备工作，确保结算业务平稳运行，现将有关注意事项通知如下：

一、结算准备金最低余额

本公司对结算参与者股票期权保证金账户设置结算准备金最低余额（经纪业务和自营业务各人民币 200 万元），结算参与者需以自有资金缴纳结算准备金最低余额。

二、结算担保金

业务开展初期，本公司向结算参与者收取结算担保金基础部分，具有本公司期权委托结算业务资格的结算参与者缴纳基础结算担保金的标准为人民币 1000 万元，不具有本公司期权委托结算业务资格的结算参与者缴纳基础结算担保金的标准为人民币 500 万元，结算参与者需按法人为单位以自有资金缴纳结算担保金。结算担保金变动部分暂不收取，具体收取时间另行通知。

三、股票期权结算银行

目前，获得本公司股票期权结算银行资格的银行为工商银行、建设银行、农业银行，中国银行、交通银行、浦发银行、招商银行、兴业银行、中信银行。结算参与者需通过上述银行办理股票期权结算相关的资金划拨业务。

四、资金划拨

1、资金划入

股票期权资金保证金账户的入金办理时间为工作日 8:30-16:00。结算参与者将资金划入至本公司股票期权结算银行 A 股结算备付金专用存款账户（详见附件一），并注明股票期权资金保证金账户账号（18 位），本公司 9:00 开始将股票期权资金保证金账户入金情况实时转发上海证券交易所（15:00 以后的入金除外）。

2、资金划出

业务初期，股票期权资金保证金账户的日间实时出金业务暂不实施，本公司日终根据结算参与者预约划款申请完成资金划出。结算参与者资金预约划出申报时间为 8:30-15:30，本公司处理时间为 16:30-17:00。

五、ETF 现货结算安排

本公司对ETF交易结算实施证券待交收制度，结算参与者需注意现货市场T+0资金预交收情况，避免因T+0预交收资金不足导致合约标的ETF被待交收，进而导致出现备兑证券锁定不足、认沽期权行权申报检查失败和行权交割可用证券不足等情况。

六、上线演练

请各结算参与者抓紧完成技术系统准备，认真按要求参与上海证券交易所与本公司组织的上线演练和通关测试，使

用真实衍生品合约账户进行测试。

特此通知。

中国证券登记结算有限责任公司

二〇一五年一月二十九日

附件一

股票期权结算银行账户一览表

银行账户户名	开户银行名称	结算备付金专用存款账户
中国证券登记结算有限责任公司上海分公司（备付金）	工商银行上海分行营业部	1001202919025768019
中国证券登记结算有限责任公司上海分公司（备付金）	中国建设银行上海市分行营业部	31001550400056002423
中国证券登记结算有限责任公司上海分公司（备付金）	中国农业银行股份有限公司上海卢湾支行	03492308781000326
中国证券登记结算有限责任公司上海分公司（备付金）	交通银行上海分行第一支行	310066726018150001873
中国证券登记结算有限责任公司上海分公司（备付金）	上海浦东发展银行上海分行营业部	97020153500000011
中国证券登记结算有限责任公司上海分公司（备付金）	兴业银行上海分行营业部	216200143300010514
中国证券登记结算有限责任公司上海分公司（备付金）	招商银行股份有限公司上海分行营业部	216089139210001
中国证券登记结算有限责任公司上海分公司（备付金）	中信银行上海分行	086780-87000001506
中国证券登记结算有限责任公司上海分公司（备付金）	中国银行股份有限公司上海市分行营业部	453359213693