

上海航运运价交易有限公司

结算细则

(2011年1月制定, 2015年6月、2017年11月、2018年12月修订)

第一章 总则

第一条 为规范航运运价交易(以下简称“交易”)的结算业务,维护交易结算业务参与各方的合法权益,防范交易结算风险,根据国家有关法律、法规、《国务院关于清理整顿各类交易场所切实防范金融风险的决定》(国发【2011】38号)和《上海航运运价交易有限公司交易规则》,上海航运运价交易有限公司(以下简称“本公司”)特制定本结算细则(以下简称“本细则”)。

第二条 结算是指根据交易结果、交易系统公布的结算价格和本公司有关规定对交易双方的定金、交易损益、交收损益、交易手续费、交收手续费等各项费用及其他有关款项进行资金清算和划转的业务活动。

第三条 交易实行定金制度、每日结算制度。

第四条 本公司、会员、交易商和定金存管银行应当遵守本细则。

第二章 结算机构

第五条 本公司结算部门负责交易的统一结算、定金的管理及结算风险的防范。

结算部门的主要职责是:

(一)编制结算账表;

- (二) 办理资金往来汇划业务；
- (三) 办理结算业务；
- (四) 统计、登记和报告结算情况；
- (五) 管理定金；
- (六) 控制结算风险；
- (七) 法律、行政法规、规章和本公司规定的其他职责。

第六条 定金存管银行是指由本公司指定的，用于存管交易商交易资金、并协助本公司对该资金进行结算和划拨的银行。

第三章 日常结算

第七条 本公司在定金存管银行开设定金专用结算账户，用于存放交易商的定金及相关款项。

交易商应在本公司指定的定金存管银行开立专用资金账户。

第八条 本公司与交易商之间资金的往来通过本公司定金专用结算账户和交易商银行资金账户办理。

第九条 交易商应当与本公司和定金存管银行签订定金三方存管协议。

第十条 本公司对交易商存入本公司专用结算账户的定金实行分账管理，为每一交易商设立明细账户，按日、序时登记核算交易商的入金、出金、损益、定金、手续费等。

第十一条 定金分为可用资金和占用定金。

可用资金是指交易商在本公司定金专用结算账户中未被合

同占用的定金。

占用定金是指交易商存入本公司定金专用结算账户中确保合同履约的资金，是已被合同占用的定金。

第十二条 交易成交后，本公司根据交易定金标准和签订合同的价值向双方收取占用定金。

第十三条 占用定金的收取标准按照《上海航运运价交易有限公司风险控制管理办法》的有关规定执行。

占用定金计算公式为：

成交时：成交价×交易汇率×合同数量×定金比例

结算时：结算价×结算汇率×合同数量×定金比例

交易汇率采用中国外汇交易中心上一工作日公布的人民币对美元汇率中间价。

结算汇率采用中国外汇交易中心当日公布的人民币对美元汇率中间价。

第十四条 当日交易结束后，本公司按照当日结算价对交易商当日所有合同的交易损益、交收损益、占用定金、交易手续费、交收手续费等款项进行清算，并对各项费用和款项提供代收代付或暂存暂付服务，采取“一收一付、先收后付、收支相抵”的原则实行净额一次划转，相应增加或者减少交易商的可用资金。

第十五条 本公司按照规定标准向成交双方收取交易手续费。

交易手续费标准详见合同挂牌公告。

本公司有权对交易手续费标准进行调整。

第十六条 结算价是指某一合同当日全部成交的成交价格按照成交量计算的加权平均价。

合同当日无成交的，以上一交易日结算价作为当日结算价。

合同当日无成交且以涨跌停板价格收盘的，以涨跌停板价格为结算价。

第十七条 实时损益

合同以最新价作为计算当日交易时段内的实时损益的依据。实时盈利不可出金，不可用于新订合同。具体计算公式为：

实时损益 = 历史签订合同实时损益 + 当日签订合同实时损益

1、历史签订合同实时损益 = (最新价 × 交易汇率 - 上一交易日结算价 × 交易汇率) × 买入合同数量 + (上一交易日结算价 × 交易汇率 - 最新价 × 交易汇率) × 卖出合同数量

2、当日签订合同实时损益 = Σ [(最新价 × 交易汇率 - 新订买入价 × 交易汇率) × 新订买入合同数量] + Σ [(新订卖出价 × 交易汇率 - 最新价 × 交易汇率) × 新订卖出合同数量]

第十八条 结算损益

结算损益是指交易商已经签订的合同的浮动损益。

合同以结算价作为计算当日交易结束后的结算损益的依据。

结算盈利不可出金、可以用于新订合同。具体计算公式为：

结算损益 = 历史签订合同结算损益 + 当日签订合同结算损

益；

1、历史签订合同结算损益 = (当日结算价 × 结算汇率 - 上一交易日结算价 × 交易汇率) × 买入合同量 + (上一交易日结算价 × 交易汇率 - 当日结算价 × 结算汇率) × 卖出合同量；

2、当日签订合同结算损益 = Σ [(当日结算价 × 结算汇率 - 新订买入价 × 交易汇率) × 新订买入合同数量] + Σ [(新订卖出价 × 交易汇率 - 当日结算价 × 结算汇率) × 新订卖出合同数量]。

第十九条 转让损益

转让损益是指交易商签订的合同在实际转让时所产生的损益。具体计算公式为：

转让损益 = 历史签订合同转让损益 + 当日签订合同转让损益；

1、历史签订合同转让损益 = Σ [(上一交易日结算价 × 交易汇率 - 转让买入价 × 交易汇率) × 买入转让合同数量] + Σ [(转让卖出价 × 交易汇率 - 上一交易日结算价 × 交易汇率) × 卖出转让合同数量]；

2、当日签订合同转让损益 = Σ [(新订卖出价 × 交易汇率 - 转让买入价 × 交易汇率) × 买入转让合同数量] + Σ [(转让卖出价 × 交易汇率 - 新订买入价 × 交易汇率) × 卖出转让合同数量]。

第二十条 交易损益

交易损益为转让损益和结算损益之和。

合同以当日结算价作为计算当日交易损益的依据。具体计算

公式为：

交易损益=转让损益+结算损益；

当日交易损益在每日结算时进行划转，当日交易盈利增加交易商可用资金，当日交易亏损减少交易商可用资金。

第二十一条 交收损益

交收损益是指交易商签订的合同在最后交易日根据交收结算价了结时所产生的损益。具体计算公式为：

交收损益=历史签订合同交收损益+当日签订合同交收损益；

1、历史签订合同交收损益= $\Sigma[(\text{上一交易日结算价} \times \text{交易汇率} - \text{交收结算价} \times \text{结算汇率}) \times \text{交收买入转让量}] + \Sigma[(\text{交收结算价} \times \text{结算汇率} - \text{上一交易日结算价} \times \text{交易汇率}) \times \text{交收卖出转让量}]$ ；

2、当日签订合同交收损益= $\Sigma[(\text{当日卖出新订价} \times \text{交易汇率} - \text{交收结算价} \times \text{结算汇率}) \times \text{交收买入转让量}] + \Sigma[(\text{交收结算价} \times \text{结算汇率} - \text{当日买入新订价} \times \text{交易汇率}) \times \text{交收卖出转让量}]$ 。

第二十二条 可用资金的计算公式如下：

当日可用资金余额=上一交易日可用资金余额+上一交易日占用定金-当日占用定金+当日交易损益+当日交收损益+当日入金-当日出金-当日交易手续费-当日交收手续费-报单冻结-风控冻结等。

第二十三条 交易商的可用资金余额为负数时，本公司向交易商发出追加定金通知。

第二十四条 本公司发出追加定金通知后，交易商应当在通知规定的时间内补足追加定金。交易商未能在本公司通知的期限内补足定金的，本公司有权按照《上海航运运价交易有限公司风险控制管理办法》的有关规定进行处理。

第二十五条 本公司本着安全、准确、快捷的原则为交易商办理入金和出金业务。

入金是指从交易商银行账户向本公司定金专用结算账户划入资金的行为；

出金是指从本公司定金专用结算账户向交易商绑定银行结算账户划出资金的行为。

（一）入金流程

交易商发出入金指令。

入金指令内容包括：指令类别（入金）、交易商编码、交易商名称、开户行、账号、金额。

入金指令当日有效且发出后不得撤销。

定金存管银行根据交易商上述入金指令，核对户名、账号等与交易商在定金存管银行系统中登记的信息相符后，以转账的形式将资金从交易商银行账户划入本公司定金存管专用结算账户。

（二）出金流程

交易商发出出金指令。

出金指令内容包括：指令类别（出金）、交易商编码、交易商名称、开户行、账号、金额。

出金指令当日有效且发出后不得撤销。

定金存管银行根据交易商上述出金指令，核对户名、账号等与交易商在定金存管银行系统中登记的信息相符后，以转账的形式将资金从本公司定金存管专用结算账户划入交易商绑定银行结算账户。

第二十六条 交易商入金和出金应当符合以下规定。

（一）入金时间为交易日内上午 8:30 至下午 15:00，出金时间为交易日内上午 9:00 至下午 15:00，下午 15:00 后停止接受入金和出金指令。

（二）入金额度无限制，但交易商绑定银行结算账户的资金余额必须大于入金金额与银行划款手续费的总和。

（三）出金额度有限制，必须小于等于“可出金额”。

交易商有签订合同时，可出金额具体计算公式如下：

可出金额 A = 当日可用资金 - 合同盈利 - 保底资金；

可出金额 B = 上日可用 + 上日占用 + 当日入金 - 当日出金 - 当日手续费 - 保底资金 - 当日报单冻结 - 当日风控冻结 - 合同盈利；

可出金额 = min(可出金额 A, 可出金额 B)

交易商未签订合同时，可出金额具体计算公式如下：

可出金额 A = 当日可用资金 - 当日转让盈利 - 保底资金；

可出金额 B= 上日可用 + 上日占用 + 当日入金 - 当日出金 - 当日手续费 - 保底资金 - 当日报单冻结 - 当日风控冻结 - 当日转让盈利；

可出金额 = min(可出金额 A, 可出金额 B)

保底资金标准：50 元（交易商销户除外）。

（一）当日盈利（包括交易损益、交收损益）不得在当日出金；

（二）当日无入金的，当日出金最高限额不得超过上一交易日可用资金与占用定金之和；

（三）自然人交易商一次性出金 50 万以上（含）、企业法人或其他经济组织交易商一次性出金 500 万元以上（含）的，应当提前一个工作日向本公司提出申请；

（四）单个交易商每日出金次数限两次。

本公司有权根据情况对上述入金和出金规定进行调整。

本公司认为市场出现重大风险或本公司认为必要时，可以限制全部或者部分交易商出金。

第二十七条 当日结算完成后，本公司将交易商资金划转的数据传递给有关定金存管银行。

第二十八条 当日结算完成后，交易商可通过本公司邮箱系统获得显示其账户资金和成交结果的结算报告。

因特殊情况造成本公司不能按时提供结算报告的，本公司将另行通知提供结算报告的时间和方式。

第二十九条 交易商每天应当及时查收本公司提供的结算报告，做好核对工作，并妥善保存。

第三十条 交易商对结算报告有异议的，应当在不迟于下一交易日上午 9:00 前以书面形式通知本公司。

交易商未在规定时间内对结算报告提出书面异议的，视为已经认可结算报告的正确性。

第三十一条 本公司在每月的第一个交易日向交易商提供上月的《交易商资金月结算表》，作为交易商核查的依据。

第三十二条 由于系统传输等原因导致交易结算报告的记载事项与实际交易结果和资金不符的，应以实际交易结果和资金为准，交易商的确认并不构成其实际交易结果和资金的变化。

第四章 交收结算

第三十三条 上海出口集装箱运价交易合同采用混合交收。

第三十四条 合同在最后交易日结算时，本公司以合同的交收结算价为基准，计算并划付合同双方的交收损益。

第三十五条 本公司按照规定标准向交收双方收取交收手续费。

交收手续费标准详见合同挂牌公告。

本公司有权对交收手续费标准进行调整。

第五章 附则

第三十六条 违反本细则规定的，按照本细则和《上海航运运价交易有限公司交易规则》的有关规定处理。

第三十七条 本细则由本公司负责解释及修订。

第三十八条 本细则自 2018 年 12 月 17 日起实施。