

表单说明

根据全球中央对手方协会《CCP12量化披露实务标准》披露

中央对手方代码和
清算服务代码：

中央对手方	违约基金	清算服务
上海清算所	债券	债券
上海清算所	大宗商品	大宗商品
上海清算所	利率互换	利率互换
上海清算所	标准债券远期	标准债券远期
上海清算所	人民币外汇	人民币外汇
上海清算所	外币对	外币对

文件命名约定：

数据表单命名： [中央对手方代码]_数据表单_披露编号_年-季度.csv
例子： SHCH_表单_4_3_2016Q1.csv

综合表单命名： [中央对手方代码]_综合表单_年-季度.csv
例子： SHCH_综合表单_2016Q1.csv

补充说明：

- 1. 为了操作的便利，中央对手方可以选择对每一个清算业务生成单独的表单。
- 2. 数字格式约定是小数(不含逗号)
例如 100万 = 1000000.00. 四舍五入到相关的小数点，不要截断。
- 3. 双引号应该用作CSV文件中的所有字段的文本限定符，以帮助数据解释。

披露时间

披露	量化披露：11月		量化披露：4月		量化披露：5月		量化披露：8月	
	开始时间	结束时间	开始时间	结束时间	开始时间	结束时间	开始时间	结束时间
4.1 违约资源总额	9月30日	9月30日	12月31日	12月31日	3月31日	3月31日	6月30日	6月30日
4.2 KCCP	9月30日	9月30日	12月31日	12月31日	3月31日	3月31日	6月30日	6月30日
4.3 预先缴纳的违约资源总额	9月30日	9月30日	12月31日	12月31日	3月31日	3月31日	6月30日	6月30日
4.4 压力敞口	10月1日	9月30日	1月1日	12月31日	4月1日	3月31日	7月1日	6月30日
5.1 可作为初始保证金的资产	9月30日	9月30日	12月31日	12月31日	3月31日	3月31日	6月30日	6月30日
5.2 可作为由清算参与者缴纳的预先准备违约资源的资产	9月30日	9月30日	12月31日	12月31日	3月31日	3月31日	6月30日	6月30日
5.3 折扣率测试结果	7月1日	9月30日	10月1日	12月31日	1月1日	3月31日	4月1日	6月30日
6.1 要求提交的初始保证金总额	9月30日	9月30日	12月31日	12月31日	3月31日	3月31日	6月30日	6月30日
6.2 投入总额	9月30日	9月30日	12月31日	12月31日	3月31日	3月31日	6月30日	6月30日
6.3 单个合约的初始保证金率	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用
6.4 初始保证金模型的类型	9月30日	9月30日	12月31日	12月31日	3月31日	3月31日	6月30日	6月30日
6.5 回溯测试	10月1日	9月30日	1月1日	12月31日	4月1日	3月31日	7月1日	6月30日
6.6 变动保证金总额	7月1日	9月30日	10月1日	12月31日	1月1日	3月31日	4月1日	6月30日
6.7 变动保证金最大值	7月1日	9月30日	10月1日	12月31日	1月1日	3月31日	4月1日	6月30日
6.8 某天初始保证金追加的最大值	7月1日	9月30日	10月1日	12月31日	1月1日	3月31日	4月1日	6月30日
7.1 合格流动性风险资源来源	9月30日	9月30日	12月31日	12月31日	3月31日	3月31日	6月30日	6月30日
7.2 补充的流动性风险资源	9月30日	9月30日	12月31日	12月31日	3月31日	3月31日	6月30日	6月30日
7.3 支付义务	10月1日	9月30日	1月1日	12月31日	4月1日	3月31日	7月1日	6月30日
12.1 结算金额	7月1日	9月30日	10月1日	12月31日	1月1日	3月31日	4月1日	6月30日
12.2 结算量	7月1日	9月30日	10月1日	12月31日	1月1日	3月31日	4月1日	6月30日
13.1 量化违约信息	7月1日	9月30日	10月1日	12月31日	1月1日	3月31日	4月1日	6月30日
14.1 持有的客户头寸总额	9月30日	9月30日	12月31日	12月31日	3月31日	3月31日	6月30日	6月30日
15.1 净资产和运营成本	12月31日	12月31日	12月31日 (年度审计)	12月31日	12月31日	12月31日	12月31日	12月31日

披露时间

披露	量化披露：11月		量化披露：4月		量化披露：5月		量化披露：8月	
	开始时间	结束时间	开始时间	结束时间	开始时间	结束时间	开始时间	结束时间
15.2 财务信息	9月30日	9月30日	12月31日	12月31日	3月31日	3月31日	6月30日	6月30日
15.3 收入分项	9月30日	9月30日	12月31日	12月31日	3月31日	3月31日	6月30日	6月30日
16.1 从参与者处收到的总现金	9月30日	9月30日	12月31日	12月31日	3月31日	3月31日	6月30日	6月30日
16.2 如何从参与者处收到现金	9月30日	9月30日	12月31日	12月31日	3月31日	3月31日	6月30日	6月30日
16.3 参与者资产再抵押	9月30日	9月30日	12月31日	12月31日	3月31日	3月31日	6月30日	6月30日
17.1 核心清算系统的运营可得性目标	7月1日	9月30日	10月1日	12月31日	1月1日	3月31日	4月1日	6月30日
17.2 核心清算系统的实际运营可得性	10月1日	9月30日	1月1日	12月31日	4月1日	3月31日	7月1日	6月30日
17.3 核心清算系统故障	10月1日	9月30日	1月1日	12月31日	4月1日	3月31日	7月1日	6月30日
17.4 系统恢复响应时间目标	7月1日	9月30日	10月1日	12月31日	1月1日	3月31日	4月1日	6月30日
18.1 清算会员数量	9月30日	9月30日	12月31日	12月31日	3月31日	3月31日	6月30日	6月30日
18.2 持仓集中度	7月1日	9月30日	10月1日	12月31日	1月1日	3月31日	4月1日	6月30日
18.3 初始保证金集中度	7月1日	9月30日	10月1日	12月31日	1月1日	3月31日	4月1日	6月30日
18.4 分离的清算基金	7月1日	9月30日	10月1日	12月31日	1月1日	3月31日	4月1日	6月30日
19.1 代理清算集中度	7月1日	9月30日	10月1日	12月31日	1月1日	3月31日	4月1日	6月30日
20.1 清算的交易额	7月1日	9月30日	10月1日	12月31日	1月1日	3月31日	4月1日	6月30日
20.2 提交给每个相连接的CCP的初始保证金或等价金融资源	9月30日	9月30日	12月31日	12月31日	3月31日	3月31日	6月30日	6月30日
20.3 从每个相连接的CCP处收取的初始保证金或等价金融资源	9月30日	9月30日	12月31日	12月31日	3月31日	3月31日	6月30日	6月30日
20.4 回溯测试覆盖率的结果	10月1日	9月30日	1月1日	12月31日	4月1日	3月31日	7月1日	6月30日
20.5 向每个相连接的CCP提供的初始保证金及等价金融资源以外的预留资金	9月30日	9月30日	12月31日	12月31日	3月31日	3月31日	6月30日	6月30日
20.6 从每个相连接的CCP处收取的初始保证金及等价金融资源以外的预留资金	9月30日	9月30日	12月31日	12月31日	3月31日	3月31日	6月30日	6月30日
20.7 跨市场保证金金额	9月30日	9月30日	12月31日	12月31日	3月31日	3月31日	6月30日	6月30日
23.1 日均清算手数	7月1日	9月30日	10月1日	12月31日	1月1日	3月31日	4月1日	6月30日
23.2 已进行合约替代但尚未结算的证券交易结算金额	9月30日	9月30日	12月31日	12月31日	3月31日	3月31日	6月30日	6月30日
23.3 由各交易平台提交的日均合约数量和名义金额	7月1日	9月30日	10月1日	12月31日	1月1日	3月31日	4月1日	6月30日

指引表单

原则	条目	对应原则要点	披露描述	描述值（不适用于综合表单）	数字格式	所在表单	报告频率	备注
4.1	违约资源总额（除去初始和留存的变动保证金），如果违约基金分业务，则按各业务区分	4.1.1	预先缴纳的违约资源 - 清算所自有资本 - 在使用会员缴纳额之前使用的金额（季末数据）	不适用	数字，两位小数，货币单位	综合表单	季度	
4.1	违约资源总额（除去初始和留存的变动保证金），如果违约基金分业务，则按各业务区分	4.1.2	预先缴纳的违约资源 - 清算所自有资本 - 在使用会员缴纳额同时使用的金额（季末数据）	不适用	数字，两位小数，货币单位	综合表单	季度	
4.1	违约资源总额（除去初始和留存的变动保证金），如果违约基金分业务，则按各业务区分	4.1.3	预先缴纳的违约资源 - 清算所自有资本 - 在使用会员缴纳额之后使用的金额（季末数据）	不适用	数字，两位小数，货币单位	综合表单	季度	
4.1	违约资源总额（除去初始和留存的变动保证金），如果违约基金分业务，则按各业务区分	4.1.4	预先缴纳的违约资源 - 清算参与者缴纳总额 - 要求缴纳的金额（季末数据）	不适用	数字，两位小数，货币单位	综合表单	季度	
4.1	违约资源总额（除去初始和留存的变动保证金），如果违约基金分业务，则按各业务区分	4.1.5	预先缴纳的违约资源 - 清算参与者缴纳总额 - 扣除折扣率后的金额（季末数据）	不适用	数字，两位小数，货币单位	综合表单	季度	
4.1	违约资源总额（除去初始和留存的变动保证金），如果违约基金分业务，则按各业务区分	4.1.6	预先缴纳的违约资源 - 其他（季末数据）	不适用	数字，两位小数，货币单位	综合表单	季度	
4.1	违约资源总额（除去初始和留存的变动保证金），如果违约基金分业务，则按各业务区分	4.1.7	补充违约资源 - 中央对手方承诺用于应对单个或多个参与者违约的自有或母公司资金总额（季末数据）	不适用	数字，两位小数，货币单位	综合表单	季度	
4.1	违约资源总额（除去初始和留存的变动保证金），如果违约基金分业务，则按各业务区分	4.1.8	补充违约资源 - 清算参与者承诺用于应对单个或多个参与者首次违约的资金总额（季末数据）	不适用	数字，两位小数，货币单位	综合表单	季度	
4.1	违约资源总额（除去初始和留存的变动保证金），如果违约基金分业务，则按各业务区分	4.1.9	补充违约资源 - 单个或多个清算参与者首次违约问题解决后，清算参与者承诺重新补充清算基金以解决后续违约事件的资金总额（季末数据）	不适用	数字，两位小数，货币单位	综合表单	季度	
4.1	违约资源总额（除去初始和留存的变动保证金），如果违约基金分业务，则按各业务区分	4.1.10	补充违约资源 - 其他（季末数据）	不适用	数字，两位小数，货币单位	综合表单	季度	
4.2	Kccp	4.2.1	Kccp: 只有作为或根据相关法律申请成为“合格中央对手方”的中央对手方需要披露该指标	不适用	数字，两位小数	综合表单	季度	
4.3	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	4.3.1	预先缴纳的违约资源总额：存放在发行相关货币的中央银行里的现金存款；扣除折扣率前及后	扣除折扣率前 扣除折扣率后	数字，两位小数，货币单位	表单 4.3	季度	
4.3	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	4.3.2	预先缴纳的违约资源总额：存放在其他中央银行的现金存款；扣除折扣率前及后	扣除折扣率前 扣除折扣率后	数字，两位小数，货币单位	表单 4.3	季度	

指引表单

原则	条目	对应原则要点	披露描述	描述值（不适用于综合表单）	数字格式	所在表单	报告频率	备注
4.3	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	4.3.3	预先缴纳的违约资源总额：存放在商业银行里的有担保的现金（包括逆回购）；扣除折扣率前及后	扣除折扣率前 扣除折扣率后	数字，两位 小数，货币 单位	表单 4.3	季度	
4.3	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	4.3.4	预先缴纳的违约资源总额：存放在商业银行里的无担保现金；扣除折扣率前及后	扣除折扣率前 扣除折扣率后	数字，两位 小数，货币 单位	表单 4.3	季度	
4.3	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	4.3.5	预先缴纳的违约资源总额：非现金主权政府债券 - 本国；扣除折扣率前及后	扣除折扣率前 扣除折扣率后	数字，两位 小数，货币 单位	表单 4.3	季度	
4.3	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	4.3.6	预先缴纳的违约资源总额：非现金主权政府债券 - 其他；扣除折扣率前及后	扣除折扣率前 扣除折扣率后	数字，两位 小数，货币 单位	表单 4.3	季度	
4.3	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	4.3.7	预先缴纳的违约资源总额：非现金机构债券；扣除折扣率前及后	扣除折扣率前 扣除折扣率后	数字，两位 小数，货币 单位	表单 4.3	季度	
4.3	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	4.3.8	预先缴纳的违约资源总额：非现金州或市政公债；扣除折扣率前及后	扣除折扣率前 扣除折扣率后	数字，两位 小数，货币 单位	表单 4.3	季度	
4.3	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	4.3.9	预先缴纳的违约资源总额：非现金公司债券；扣除折扣率前及后	扣除折扣率前 扣除折扣率后	数字，两位 小数，货币 单位	表单 4.3	季度	
4.3	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	4.3.10	预先缴纳的违约资源总额：非现金股权；扣除折扣率前及后	扣除折扣率前 扣除折扣率后	数字，两位 小数，货币 单位	表单 4.3	季度	
4.3	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	4.3.11	预先缴纳的违约资源总额：非现金大宗商品 - 黄金；扣除折扣率前及后	扣除折扣率前 扣除折扣率后	数字，两位 小数，货币 单位	表单 4.3	季度	
4.3	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	4.3.12	预先缴纳的违约资源总额：非现金大宗商品 - 其他；扣除折扣率前及后	扣除折扣率前 扣除折扣率后	数字，两位 小数，货币 单位	表单 4.3	季度	
4.3	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	4.3.13	预先缴纳的违约资源总额：非现金共同基金或 UCITs；扣除折扣率前及后	扣除折扣率前 扣除折扣率后	数字，两位 小数，货币 单位	表单 4.3	季度	
4.3	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	4.3.14	预先缴纳的违约资源总额：非现金 - 其他；扣除折扣率前及后	扣除折扣率前 扣除折扣率后	数字，两位 小数，货币 单位	表单 4.3	季度	
4.3	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	4.3.15	总额 季末披露；扣除折扣率前及后	扣除折扣率前 扣除折扣率后	数字，两位 小数，货币 单位	表单 4.3	季度	

指引表单

原则	条目	对应原则要点	披露描述	描述值（不适用于综合表单）	数字格式	所在表单	报告频率	备注
4.4	信用风险披露	4.4.1	说明中央对手方预先缴纳的违约资源总额是符合“Cover 1”还是“Cover 2”最低要求	不适用	文本	综合表单	季度	
4.4	信用风险披露	4.4.2	说明中央对手方在计算清算基金覆盖的信用风险敞口时假设的违约平仓天数	不适用	数字，整数	综合表单	季度	
4.4	信用风险披露	4.4.3	对各项清算业务，在极端但合理的市场条件下单个参与者及其附属机构（包括其为间接参与者清算的交易）造成的最大合计压力损失（超过初始保证金的部分）的估计值；最大值和平均值	过去12个月最大值； 过去12个月平均值	数字，两位 小数，百分比	表单 4.4a	季度，跨 度12个月	
4.4	信用风险披露	4.4.4	以上数字超过预先准备违约资源值的工作日天数	不适用	数字，整数	综合表单	季度	
4.4	信用风险披露	4.4.5	以上数字（4.4.3）超过预先缴纳的违约资源总额（超过初始保证金的部分）的金额大小	超出数量	数字，两位 小数，货币	表单 4.4b	季度	
4.4	信用风险披露	4.4.6	单个参与者造成的最大合计信用风险敞口（超过最低保证金及超限保证金总额的部分）的实际值，包括代理清算	过去12个月最大值 过去12个月平均值	数字，两位 小数，货币 单位	表单 4.4a	季度	
4.4	信用风险披露	4.4.7	对各项清算业务，在极端但合理的市场条件下两个参与者造成的最大合计压力损失（超过最低保证金及超限保证金总额的部分）的估计值，包括	过去12个月最大值 过去12个月平均值	数字，两位 小数，货币 单位	表单 4.4a	季度	
4.4	信用风险披露	4.4.8	以上数字（4.4.6）超过预先缴纳的违约资源总额（超过初始保证金的部分）的工作日天数	不适用	数字，整数	综合表单	季度	
4.4	信用风险披露	4.4.9	以上数字（4.4.6）超过预先缴纳的违约资源总额（超过初始保证金的部分）的金额大小	超出数量	数字，两位 小数，货币	表单 4.4b	季度	
4.4	信用风险披露	4.4.10	两个参与者造成的最大合计信用风险敞口（超过该会员最低保证金及超限保证金总额的部分）的实际值，包括代理清算；过去12个月的最大值和	过去12个月最大值 过去12个月平均值	数字，两位 小数，货币 单位	表单 4.4a	季度	
5.1	可作为初始保证金的资产类型，以及对应适用的折扣率	5.1.1	可作为初始保证金的资产类型，以及对应适用的折扣率	不适用	文本	综合表单	更新时	
5.2	可作为由清算参与者预先缴纳的违约资源的资产类型，以及对应适用的折扣率（如果与5.1不同的话）	5.2.1	可作为由清算参与者预先缴纳的违约资源的资产类型，以及对应适用的折扣率（如果与5.1不同的话）	不适用	文本	综合表单	更新时	
5.3	折扣率测试结果	5.3.1	计算折扣率时的目标置信区间	不适用	文本	综合表单	季度	
5.3	折扣率测试结果	5.3.2	可作为抵押品的资产的假设的持有/平仓期限	不适用	文本	综合表单	季度	
5.3	折扣率测试结果	5.3.3	测试折扣率所用的回溯期限	不适用	文本	综合表单	季度	
5.3	折扣率测试结果	5.3.4	在回溯期限内，资产价值在假设的持有/平仓期限内减记幅度超过折扣率的天数	不适用	数字，整数	综合表单	季度	
6.1	对于每一项清算服务的初始保证金总额，分自营和代理（如果自营和代理业务的初始保证金没有分类独立核算，就列出自营和代理的总额）	6.1.1	要求缴纳的初始保证金总额，分自营、代理全额、代理净额或自营和代理的总额（如果自营和代理业务的初始保证金没有分类独立核算）	自营净值 代理净值 代理全值	数字，两位 小数，货币 单位	表单 6.1	季度	

指引表单

原则	条目	对应原则要点	披露描述	描述值（不适用于综合表单）	数字格式	所在表单	报告频率	备注
6.2	对于每一项清算服务的初始保证金总额，分自营和代理	6.2.1	实际持有的初始保证金总额:存放在发行相关货币的中央银行里的现金存款，分自营和代理，或自营和代理的总额（如果自营和代理业务的初始保证金没有分类独立核算）；扣除折扣率前及后	自营-扣除折扣率前 自营-扣除折扣率后 代理-扣除折扣率前 代理-扣除折扣率后 总额-扣除折扣率前 总额-扣除折扣率后	数字，两位 小数，货币 单位	表单 6.2	季度	
6.2	对于每一项清算服务的初始保证金总额，分自营和代理	6.2.2	实际持有的初始保证金总额:存放在其他中央银行的现金存款，分自营和代理，或自营和代理的总额（如果自营和代理业务的初始保证金没有分类独立核算）；扣除折扣率前及后	自营-扣除折扣率前 自营-扣除折扣率后 代理-扣除折扣率前 代理-扣除折扣率后 总额-扣除折扣率前 总额-扣除折扣率后	数字，两位 小数，货币 单位	表单 6.2	季度	
6.2	对于每一项清算服务的初始保证金总额，分自营和代理	6.2.3	实际持有的初始保证金总额:存放在商业银行里的有担保的现金（包括逆回购），分自营和代理，或自营和代理的总额（如果自营和代理业务的初始保证金没有分类独立核算）；扣除折扣率前及后	自营-扣除折扣率前 自营-扣除折扣率后 代理-扣除折扣率前 代理-扣除折扣率后 总额-扣除折扣率前 总额-扣除折扣率后	数字，两位 小数，货币 单位	表单 6.2	季度	
6.2	对于每一项清算服务的初始保证金总额，分自营和代理	6.2.4	实际持有的初始保证金总额:存放在商业银行里的无担保现金，分自营和代理，或自营和代理的总额（如果自营和代理业务的初始保证金没有分类独立核算）；扣除折扣率前及后	自营-扣除折扣率前 自营-扣除折扣率后 代理-扣除折扣率前 代理-扣除折扣率后 总额-扣除折扣率前 总额-扣除折扣率后	数字，两位 小数，货币 单位	表单 6.2	季度	
6.2	对于每一项清算服务的初始保证金总额，分自营和代理	6.2.5	实际持有的初始保证金总额:非现金主权政府债券- 本国，分自营和代理，或自营和代理的总额（如果自营和代理业务的初始保证金没有分类独立核算）；扣除折扣率前及后	自营-扣除折扣率前 自营-扣除折扣率后 代理-扣除折扣率前 代理-扣除折扣率后 总额-扣除折扣率前 总额-扣除折扣率后	数字，两位 小数，货币 单位	表单 6.2	季度	
6.2	对于每一项清算服务的初始保证金总额，分自营和代理	6.2.6	实际持有的初始保证金总额:非现金主权政府债券- 其他，分自营和代理，或自营和代理的总额（如果自营和代理业务的初始保证金没有分类独立核算）；扣除折扣率前及后	自营-扣除折扣率前 自营-扣除折扣率后 代理-扣除折扣率前 代理-扣除折扣率后 总额-扣除折扣率前 总额-扣除折扣率后	数字，两位 小数，货币 单位	表单 6.2	季度	

指引表单

原则	条目	对应原则要点	披露描述	描述值（不适用于综合表单）	数字格式	所在表单	报告频率	备注
6.2	对于每一项清算服务的初始保证金总额，分自营和代理	6.2.7	实际持有的初始保证金总额:非现金机构债券，分自营和代理，或自营和代理的总额（如果自营和代理业务的初始保证金没有分类独立核算）；扣除折扣率前及后	自营-扣除折扣率前 自营-扣除折扣率后 代理-扣除折扣率前 代理-扣除折扣率后 总额-扣除折扣率前 总额-扣除折扣率后	数字，两位小数，货币单位	表单 6.2	季度	
6.2	对于每一项清算服务的初始保证金总额，分自营和代理	6.2.8	实际持有的初始保证金总额:非现金州或市政公债，分自营和代理，或自营和代理的总额（如果自营和代理业务的初始保证金没有分类独立核算）；扣除折扣率前及后	自营-扣除折扣率前 自营-扣除折扣率后 代理-扣除折扣率前 代理-扣除折扣率后 总额-扣除折扣率前 总额-扣除折扣率后	数字，两位小数，货币单位	表单 6.2	季度	
6.2	对于每一项清算服务的初始保证金总额，分自营和代理	6.2.9	实际持有的初始保证金总额:非现金公司债券，分自营和代理，或自营和代理的总额（如果自营和代理业务的初始保证金没有分类独立核算）；扣除折扣率前及后	自营-扣除折扣率前 自营-扣除折扣率后 代理-扣除折扣率前 代理-扣除折扣率后 总额-扣除折扣率前 总额-扣除折扣率后	数字，两位小数，货币单位	表单 6.2	季度	
6.2	对于每一项清算服务的初始保证金总额，分自营和代理	6.2.10	实际持有的初始保证金总额:非现金股权，分自营和代理，或自营和代理的总额（如果自营和代理业务的初始保证金没有分类独立核算）；扣除折扣率前及后	自营-扣除折扣率前 自营-扣除折扣率后 代理-扣除折扣率前 代理-扣除折扣率后 总额-扣除折扣率前 总额-扣除折扣率后	数字，两位小数，货币单位	表单 6.2	季度	
6.2	对于每一项清算服务的初始保证金总额，分自营和代理	6.2.11	实际持有的初始保证金总额:非现金大宗商品 - 黄金，分自营和代理，或自营和代理的总额（如果自营和代理业务的初始保证金没有分类独立核算）；扣除折扣率前及后	自营-扣除折扣率前 自营-扣除折扣率后 代理-扣除折扣率前 代理-扣除折扣率后 总额-扣除折扣率前 总额-扣除折扣率后	数字，两位小数，货币单位	表单 6.2	季度	
6.2	对于每一项清算服务的初始保证金总额，分自营和代理	6.2.12	实际持有的初始保证金总额:非现金大宗商品 - 其他，分自营和代理，或自营和代理的总额（如果自营和代理业务的初始保证金没有分类独立核算）；扣除折扣率前及后	自营-扣除折扣率前 自营-扣除折扣率后 代理-扣除折扣率前 代理-扣除折扣率后 总额-扣除折扣率前 总额-扣除折扣率后	数字，两位小数，货币单位	表单 6.2	季度	

指引表单

原则	条目	对应原则要点	披露描述	描述值（不适用于综合表单）	数字格式	所在表单	报告频率	备注
6.2	对于每一项清算服务的初始保证金总额，分自营和代理	6.2.13	实际持有的初始保证金总额:非现金共同基金或 UCITs，分自营和代理，或自营和代理的总额（如果自营和代理业务的初始保证金没有分类独立核算）；扣除折扣率前及后	自营-扣除折扣率前 自营-扣除折扣率后 代理-扣除折扣率前 代理-扣除折扣率后 总额-扣除折扣率前 总额-扣除折扣率后	数字，两位 小数，货币 单位	表单 6.2	季度	
6.2	对于每一项清算服务的初始保证金总额，分自营和代理	6.2.14	实际持有的初始保证金总额:非现金其他，分自营和代理，或自营和代理的总额（如果自营和代理业务的初始保证金没有分类独立核算）；扣除折扣率前及后	自营-扣除折扣率前 自营-扣除折扣率后 代理-扣除折扣率前 代理-扣除折扣率后 总额-扣除折扣率前 总额-扣除折扣率后	数字，两位 小数，货币 单位	表单 6.2	季度	
6.2	对于每一项清算服务的初始保证金总额，分自营和代理	6.2.15	实际持有的初始保证金总额:持有的初始保证金总额，分自营和代理，或自营和代理的总额（如果自营和代理业务的初始保证金没有分类独立核算）	自营-扣除折扣率前 自营-扣除折扣率后 代理-扣除折扣率前 代理-扣除折扣率后 总额-扣除折扣率前 总额-扣除折扣率后	数字，两位 小数，货币 单位	表单 6.2	季度	
6.3	中央对手方设置的单个合约的初始保证金率	6.3.1	中央对手方设置的单个合约的初始保证金率	不适用	文本	综合表单	更新时	
6.4	对每个清算服务的初始保证金模型的类型（例如：模拟投资组合或风险整合）及其关键模型设计	6.4.1	初始保证金模型的类型		文本	综合表单	季度	
6.4	对每个清算服务的初始保证金模型的类型（例如：模拟投资组合或风险整合）及其关键模型设计	6.4.2	初始保证金模型的类型变化生效日期		ISO 8601 日期格式 年-月-日	综合表单	季度	
6.4	对每个清算服务的初始保证金模型的类型（例如：模拟投资组合或风险整合）及其关键模型设计	6.4.3	初始保证金模型的名称		文本	综合表单	季度	
6.4	对每个清算服务的初始保证金模型的类型（例如：模拟投资组合或风险整合）及其关键模型设计	6.4.4	初始保证金模型的名称变化生效日期		ISO 8601 日期格式 年-月-日	综合表单	季度	
6.4	对每个清算服务的初始保证金模型的类型（例如：模拟投资组合或风险整合）及其关键模型设计	6.4.5	单尾置信区间		数字，两位 小数，百分比	综合表单	季度	
6.4	对每个清算服务的初始保证金模型的类型（例如：模拟投资组合或风险整合）及其关键模型设计	6.4.6	单尾置信区间变化生效日期		ISO 8601 日期格式 年-月-日	综合表单	季度	

指引表单

原则	条目	对应原则要点	披露描述	描述值（不适用于综合表单）	数字格式	所在表单	报告频率	备注
6.4	对每个清算服务的初始保证金模型的类型（例如：模拟投资组合或风险整合）及其关键模型设计	6.4.7	用于模型校准的样本回溯期		文本	综合表单	季度	
6.4	对每个清算服务的初始保证金模型的类型（例如：模拟投资组合或风险整合）及其关键模型设计	6.4.8	用于模型校准的样本回溯期变化生效日期		ISO 8601 日期格式 年-月-日	综合表单	季度	
6.4	对每个清算服务的初始保证金模型的类型（例如：模拟投资组合或风险整合）及其关键模型设计	6.4.9	对历史数据所做的调整		文本	综合表单	季度	
6.4	对每个清算服务的初始保证金模型的类型（例如：模拟投资组合或风险整合）及其关键模型设计	6.4.10	对历史数据所做的调整生效日期		ISO 8601 日期格式 年-月-日	综合表单	季度	
6.4	对每个清算服务的初始保证金模型的类型（例如：模拟投资组合或风险整合）及其关键模型设计	6.4.11	平仓天数		文本	综合表单	季度	
6.4	对每个清算服务的初始保证金模型的类型（例如：模拟投资组合或风险整合）及其关键模型设计	6.4.12	平仓天数变化生效日期		ISO 8601 日期格式 年-月-日	综合表单	季度	
6.4	对每个清算服务的初始保证金模型的类型（例如：模拟投资组合或风险整合）及其关键模型设计	6.4.13	如果使用风险加总模型，每个合约的保证金率和不同合约间相互抵消的细节		文本	综合表单	季度	
6.4	对每个清算服务的初始保证金模型的类型（例如：模拟投资组合或风险整合）及其关键模型设计	6.4.14	参数审查的频率		文本	综合表单	季度	
6.4	对每个清算服务的初始保证金模型的类型（例如：模拟投资组合或风险整合）及其关键模型设计	6.4.15	参数审查的频率变化生效日期		ISO 8601 日期格式 年-月-日	综合表单	季度	
6.5	初始保证金的回溯测试结果。最少应该包括每一个清算服务和针对每个清算服务的初始保证金模型的测试结果。	6.5.1.1	在过去的12个月，任一个账户持有的保证金覆盖率低于该会员账户市值的次数，基于每日回溯测试结果	不适用	数字，整数	综合表单	季度，跨度12个月	
6.5	初始保证金的回溯测试结果。最少应该包括每一个清算服务和针对每个清算服务的初始保证金模型的测试结果。	6.5.1.2	每日回溯测试的频率	不适用	文本	综合表单	季度，跨度12个月	
6.5	初始保证金的回溯测试结果。最少应该包括每一个清算服务和针对每个清算服务的初始保证金模型的测试结果。	6.5.1.3	如果每天测试一次，回溯测试的具体时间	不适用	文本	综合表单	季度，跨度12个月	

指引表单

原则	条目	对应原则要点	披露描述	描述值（不适用于综合表单）	数字格式	所在表单	报告频率	备注
6.5	初始保证金的回溯测试结果。最少应该包括每一个清算服务和针对每个清算服务的初始保证金模型的测试结果。	6.5.2	观察值的数量	不适用	数字，整数	综合表单	季度，跨度12个月	
6.5	初始保证金的回溯测试结果。最少应该包括每一个清算服务和针对每个清算服务的初始保证金模型的测试结果。	6.5.3	达到的覆盖水平	不适用	数字，两位小数，百分比	综合表单	季度，跨度12个月	
6.5	初始保证金的回溯测试结果。最少应该包括每一个清算服务和针对每个清算服务的初始保证金模型的测试结果。	6.5.4	如有超出初始保证金覆盖范围的情况（如6.5.1.1所定义的）发生，需报告未被覆盖的敞口规模；峰值	不适用	数字，两位小数，货币单位	综合表单	季度，跨度12个月	
6.5	初始保证金的回溯测试结果。最少应该包括每一个清算服务和针对每个清算服务的初始保证金模型的测试结果。	6.5.5	如有超出初始保证金覆盖范围的情况（如6.5.1.1所定义的）发生，需报告未被覆盖的风险规模；平均值	不适用	数字，两位小数，货币单位	综合表单	季度，跨度12个月	
6.6	每一业务的清算参与者付给中央对手方的总变动保证金的均值	6.6.1	每个工作日付给中央对手方的总变动保证金的均值	不适用	数字，两位小数，货币	综合表单	季度	
6.7	一段时期内某天支付给中央对手方的总变动保证金的最大值	6.7.1	一段时期内某天支付给中央对手方的总变动保证金的最大值	不适用	数字，两位小数，货币	综合表单	季度	
6.8	一段时期内某天初始保证金追加的最大值	6.8.1	一段时期内某天初始保证金追加的最大值	不适用	数字，两位小数，货币	综合表单	季度	
7.1	流动性风险	7.1.1	陈述清算服务是否有足够的流动性资源以应对一家还是两家最大的清算会员的倒闭	不适用	文本	综合表单	季度	
7.1	流动性风险	7.1.2	合格流动性资源：（a）存放在发行相关货币的中央银行里的现金存款	合格流动性资源的规模和组成	数字，两位小数，货币	表单 7.1	季度	
7.1	流动性风险	7.1.3	合格流动性资源：（b）存放在其他中央银行的现金存款	合格流动性资源的规模和组成	数字，两位小数，货币	表单 7.1	季度	
7.1	流动性风险	7.1.4	合格流动性资源：（c）存放在商业银行里的担保现金（包括逆回购）	合格流动性资源的规模和组成	数字，两位小数，货币	表单 7.1	季度	
7.1	流动性风险	7.1.5	合格流动性资源：（d）存放在商业银行里的无担保现金	合格流动性资源的规模和组成	数字，两位小数，货币	表单 7.1	季度	
7.1	流动性风险	7.1.6	合格流动性资源：（e）有担保的承诺的信用额度（例如，提取时由中央对手方提供抵押品/证券）包括承诺的外汇掉期和承诺的回购	合格流动性资源的规模和组成	数字，两位小数，货币单位	表单 7.1	季度	
7.1	流动性风险	7.1.7	合格流动性资源：（f）无担保的承诺的信用额度（例如，提取时中央对手方不提供抵押品/证券）	合格流动性资源的规模和组成	数字，两位小数，货币	表单 7.1	季度	
7.1	流动性风险	7.1.8	合格流动性资源：（g）流动性非常好的托管中的抵押品以及经过预先安排并且有高度可靠资金安排、即便在极端但合理的市场条件下也容易变现	合格流动性资源的规模和组成	数字，两位小数，货币单位	表单 7.1	季度	

指引表单

原则	条目	对应原则要点	披露描述	描述值（不适用于综合表单）	数字格式	所在表单	报告频率	备注
7.1	流动性风险	7.1.9	合格流动性资源：（h）其他	合格流动性资源的规模和组成	数字，两位小数，货币	表单 7.1	季度	
7.1	流动性风险	7.1.10	说明中央对手方是否能够例行使用中央银行流动资金或贷款	不适用	文本	综合表单	季度	
7.1	流动性风险	7.1.11	如果在使用合格流动性资源过程中，中央对手方按照要求或者经允许优先考虑满足部分付款义务，请提供：付款计划表或付款分派优先级（如果有）；做出此类决策所适用的规则、政策和管	不适用	文本	综合表单	季度	
7.2	在合格流动性资源基础上补充的流动性风险资源的规模和构成	7.2.1	在合格流动性资源基础上补充的流动性风险资源的规模和构成	不适用	数字，两位小数，货币	综合表单	季度	
7.3	流动性风险	7.3.1	对各项清算业务，在极端但合理的市场条件下单个参与者造成的单日最大付款义务的估计值，包括代理清算；前瞻性的估计值	单日付款总额	数字，两位小数，货币单位	表单 7.3	季度	
7.3	流动性风险	7.3.2	上述金额超过合格流动性资源的工作日数	不适用	数字，整数	综合表单	季度	
7.3	流动性风险	7.3.3	上述金额超过合格流动性资源的超过的金额大小	超出数量	数字，两位小数，货币	表单 7.3a	季度	
7.3	流动性风险	7.3.4	对各项清算业务，过去12个月中，单个清算会员及其客户违约造成的单日最大付款义务的实际值；过去12个月的单日最大值	单日付款总额	数字，两位小数，货币单位	表单 7.3	季度	
7.3	流动性风险	7.3.5	在极端但合理的市场条件下单个清算会员及其客户违约造成的单日最大付款义务的估计值，按币种分；前瞻性的估计值	单日付款	数字，两位小数，货币单位	表单 7.3	季度	
7.3	流动性风险	7.3.6	按币种分，上述金额超过合格流动性资源的工作日数，及超出金额的大小；季度中的天数	天数-美元 天数-欧元 天数-英镑	数字，整数	表单 7.3b	季度	
7.3	流动性风险	7.3.7	按币种分，上述金额超过合格流动性资源的工作日数，及超出金额的大小；超过的金额大小	超出数量	数字，两位小数，货币	表单 7.3a	季度	
12	DvP, DvD or PvP结算方式结算金额的占比	12.1.1	DvP结算方式结算金额的占比	不适用	数字，两位小数，百分	综合表单	季度	
12	DvP, DvD or PvP结算方式结算金额的占比	12.1.2	DvD结算方式结算金额的占比	不适用	数字，两位小数，百分	综合表单	季度	
12	DvP, DvD or PvP结算方式结算金额的占比	12.1.3	PvP结算方式结算金额的占比	不适用	数字，两位小数，百分	综合表单	季度	
12	DvP, DvD or PvP结算方式结算量的占比	12.2.1	DvP结算方式结算量的占比	不适用	数字，两位小数，百分	综合表单	季度	
12	DvP, DvD or PvP结算方式结算量的占比	12.2.2	DvD结算方式结算量的占比	不适用	数字，两位小数，百分	综合表单	季度	

指引表单

原则	条目	对应原则要点	披露描述	描述值（不适用于综合表单）	数字格式	所在表单	报告频率	备注
12	DvP, DvD or PvP结算方式结算量的占比	12.2.3	PvP结算方式结算量的占比	不适用	数字，两位小数，百分	综合表单	季度	
13	与违约相关的量化信息	13.1.1	与违约相关的量化信息：损失金额与初始保证金	不适用	文本	综合表单	更新时	
13	与违约相关的量化信息	13.1.2	与违约相关的量化信息：其它用于覆盖损失的金融资源金额	不适用	文本	综合表单	更新时	
13	与违约相关的量化信息	13.1.3.1	与违约相关的量化信息：客户头寸平仓的比例	不适用	文本	综合表单	更新时	
13	与违约相关的量化信息	13.1.3.2	与违约相关的量化信息：客户头寸移仓的比例	不适用	文本	综合表单	更新时	
13	与违约相关的量化信息	13.1.4	与违约相关的量化信息：其他与违约相关的公开	不适用	文本	综合表单	更新时	
14	作为清算总值或证券交易结算价值的一部分的客户头寸总数	14.1.1	单一账户中持有的客户头寸总数	不适用	数字，两位小数，百分	综合表单	季度	
14	作为清算总值或证券交易结算价值的一部分的客户头寸总数	14.1.2	客户专用综合账户，不包括法律上分离但操作上混合的账户（LSOC），中持有的客户头寸总数	不适用	数字，两位小数，百分比	综合表单	季度	
14	作为清算总值或证券交易结算价值的一部分的客户头寸总数	14.1.3	法律上分离但操作上混合的账户（LSOC）中持有的客户头寸总数	不适用	数字，两位小数，百分	综合表单	季度	
14	作为清算总值或证券交易结算价值的一部分的客户头寸总数	14.1.4	混合的自营和代理账户中持有的客户头寸总数	不适用	数字，两位小数，百分	综合表单	季度	
15	一般业务风险	15.1.1	流动性高的所有者权益	不适用	数字，两位小数，货币	综合表单	年度	
15	一般业务风险	15.1.2	6个月短期运营费用	不适用	数字，两位小数，货币	综合表单	年度	
15	一般业务风险；财务披露	15.2.1	总收入	不适用	数字，两位小数，货币	综合表单	年度	
15	一般业务风险；财务披露	15.2.2	总支出	不适用	数字，两位小数，货币	综合表单	年度	
15	一般业务风险；财务披露	15.2.3	利润	不适用	数字，两位小数，货币	综合表单	年度	
15	一般业务风险；财务披露	15.2.4	资产总额	不适用	数字，两位小数，货币	综合表单	年度	
15	一般业务风险；财务披露	15.2.5	负债总额	不适用	数字，两位小数，货币	综合表单	年度	
15	一般业务风险；财务披露	15.2.6	说明清算会员提交的抵押品是否在资产负债表上	不适用	文本	综合表单	年度	
15	一般业务风险；财务披露	15.2.7	补充事项	不适用	文本	综合表单	年度	
15	一般业务风险；收入明细	15.3.1	清算业务的收入占总收入的百分比	不适用	数字，两位小数，百分	综合表单	年度	
15	一般业务风险；收入明细	15.3.2	抵押品再投资（或再抵押）的收入占总收入的百分比	不适用	数字，两位小数，百分	综合表单	年度	

指引表单

原则	条目	对应原则要点	披露描述	描述值（不适用于综合表单）	数字格式	所在表单	报告频率	备注
16	从参与者处获得的现金（不包括证券）总额，无论是不论是持有还是存款或是投资中的现金。按照其目的是作为初始保证金还是违约基金分类。	16.1.1	从清算参与者处收到的作为初始保证金的现金总额（不包括证券），不论是持有还是存款或是投资中的现金。	不适用	数字，两位小数，货币单位	综合表单	季度	
16	从参与者处获得的现金（不包括证券）总额，无论是不论是持有还是存款或是投资中的现金。按照其目的是作为初始保证金还是违约基金分类。	16.1.2	从清算参与者处收到的作为违约基金的现金总额（不包括证券），不论是持有还是存款或是投资中的现金。	不适用	数字，两位小数，货币单位	综合表单	季度	
16	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	16.2.1	从清算参与者处收到的现金中以现金存款形式（包括反向回购）持有的百分比	不适用	数字，两位小数，百分比	综合表单	季度	
16	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	16.2.2	其中，存放在发行相关货币的中央银行里的现金存款的百分比	不适用	数字，两位小数，百分比	综合表单	季度	
16	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	16.2.3	其中，存放在其他中央银行的现金存款的百分比	不适用	数字，两位小数，百分比	综合表单	季度	
16	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	16.2.4	其中，存放在商业银行的现金存款（有担保，包括通过逆回购）的百分比	不适用	数字，两位小数，百分比	综合表单	季度	
16	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	16.2.5	其中，存放在商业银行的现金存款（无担保）的百分比	不适用	数字，两位小数，百分比	综合表单	季度	
16	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	16.2.6	其中，存放在货币市场基金的百分比	不适用	数字，两位小数，百分比	综合表单	季度	
16	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	16.2.7	其中，其他形式（请说明）的百分比	不适用	数字，两位小数，百分比	综合表单	季度	
16	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	16.2.8	将16.2.1所述现金存款按照币种（包括反向回购）与货币市场基金的百分比-本国货币、美元、欧元、其他货币	百分比-人民币 百分比-美元	数字，两位小数，百分比	表单 16.2	季度	
16	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	16.2.9	16.2.1所述现金存款的加权平均期限	不适用	数字，两位小数	综合表单	季度	
16	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	16.2.10	从清算参与者处收到的现金中投资于证券的比例：本国政府主权债券	不适用	数字，两位小数，百分比	综合表单	季度	

指引表单

原则	条目	对应原则要点	披露描述	描述值（不适用于综合表单）	数字格式	所在表单	报告频率	备注
16	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	16.2.11	从清算参与者处收到的现金中投资于证券的比例：他国政府主权债券	不适用	数字，两位小数，百分比	综合表单	季度	
16	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	16.2.12	从清算参与者处收到的现金中投资于证券的比例：机构债券	不适用	数字，两位小数，百分比	综合表单	季度	
16	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	16.2.13	从清算参与者处收到的现金中投资于证券的比例：州或政府公债	不适用	数字，两位小数，百分比	综合表单	季度	
16	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	16.2.14	从清算参与者处收到的现金中投资于证券的比例：其他工具	不适用	数字，两位小数，百分比	综合表单	季度	
16	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	16.2.15	从清算参与者处收到的现金中投资于证券的比例：按币种分	百分比-人民币 百分比-美元	数字，两位小数，百分比	表单 16.2	季度	
16	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	16.2.16	以上证券的加权平均期限	不适用	数字，两位小数	综合表单	季度	
16	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	16.2.17	对以上投资证券组合的风险的估计值（不包括中央银行和商业银行存款）（99%一日VaR或等价指标）	不适用	文本	综合表单	季度	
16	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	16.2.18	说明中央对手方的投资策略是否对可能分配给单一对手方的投资证券组合比例设定上限，并说明上限的规模	不适用	文本	综合表单	季度	
16	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	16.2.19	说明上一季度这一上限被突破的次数	不适用	数字，整数	综合表单	季度	
16	从清算参与者处收到的现金（16.2）以何种方式持有、存放或投资	16.2.20	从清算参与者处收到的现金中以证券形式持有的百分比	不适用	数字，两位小数，百分比	综合表单	季度	
16	清算参与者资产（非现金）的再抵押	16.3.1	清算参与者资产（非现金）是否允许再抵押，如果是的话，提供初始保证金再抵押的金额	不适用	数字，两位小数，货币	综合表单	季度	
16	清算参与者资产（非现金）的再抵押	16.3.2	清算参与者资产（非现金）是否允许再抵押，如果是的话，提供清算基金再抵押的金额	不适用	数字，两位小数，货币	综合表单	季度	

指引表单

原则	条目	对应原则要点	披露描述	描述值（不适用于综合表单）	数字格式	所在表单	报告频率	备注
16	清算参与者资产（非现金）的再抵押	16.3.3	再抵押的初始保证金的期限分布：隔夜/一天；一天以上到最多一周；一周以上到最多一个月；一个月以上到最多一年；一年以上到最多两年；两年以上	隔夜/一天；一天以上到最多一周；一周以上到最多一个月；一个月以上到最多一年；一年以上到最多两年；两年以上	数字，两位小数，货币单位	表单 16.3	季度	
16	清算参与者资产（非现金）的再抵押	16.3.4	再抵押的清算基金的期限分布：隔夜/一天；一天以上到最多一周；一周以上到最多一个月；一个月以上到最多一年；一年以上到最多两年；两年以上	隔夜/一天；一天以上到最多一周；一周以上到最多一个月；一个月以上到最多一年；一年以上到最多两年；两年以上	数字，两位小数，货币单位	表单 16.3	季度	
17	核心清算系统（无论是否外包）在一段期间的运营可得性目标（例如，12个月99.99%）	17.1.1	核心清算系统（无论是否外包）在一段期间的运营可得性目标（例如，12个月99.99%）	不适用	数字，两位小数，百分比	综合表单	季度，跨度12个月	
17	核心清算系统在过去12个月的实际运营可得性	17.2.1	核心清算系统在过去12个月的实际运营可得性	不适用	数字，两位小数，百分	综合表单	季度，跨度12个月	
17	实际故障次数	17.3.1	核心清算系统在过去12个月发生故障的总次数和持续时间	故障持续时间	UTC 时间格式 时:分:秒	表单 17.3	季度，跨度12个月	
17	系统恢复响应时间目标	17.4.1	系统恢复响应时间目标	不适用	文本	综合表单	季度，跨度12个月	
18	清算会员数量，按清算服务类型分类	18.1.1.1	综合清算会员的数量	不适用	数字，整数	综合表单	季度	
18	清算会员数量，按清算服务类型分类	18.1.1.2	普通清算会员的数量	不适用	数字，整数	综合表单	季度	
18	清算会员数量，按清算服务类型分类	18.1.1.3	其他类别的清算会员数量	不适用	数字，整数	综合表单	季度	
18	清算会员数量，按清算服务类型分类	18.1.2.1	中央银行类清算会员的数量	不适用	数字，整数	综合表单	季度	
18	清算会员数量，按清算服务类型分类	18.1.2.2	中央对手方类清算会员的数量	不适用	数字，整数	综合表单	季度	
18	清算会员数量，按清算服务类型分类	18.1.2.3	银行类清算会员的数量	不适用	数字，整数	综合表单	季度	
18	清算会员数量，按清算服务类型分类	18.1.2.4	其他机构类型清算会员的数量（说明类别）	不适用	数字，整数	综合表单	季度	
18	清算会员数量，按清算服务类型分类	18.1.3.1	境内法人清算会员的数量	不适用	数字，整数	综合表单	季度	
18	清算会员数量，按清算服务类型分类	18.1.3.2	境外法人清算会员的数量	不适用	数字，整数	综合表单	季度	

指引表单

原则	条目	对应原则要点	披露描述	描述值（不适用于综合表单）	数字格式	所在表单	报告频率	备注
18	持仓量的集中度	18.2.1	对清算会员数在10到25之间的清算业务，提供五家最大的清算会员的持仓总量的占比（包括自营	季度均值 季度峰值	数字，两位 小数，百分	表单 18.2	季度	
18	持仓量的集中度	18.2.2	对清算会员数在25或以上的清算业务，提供五家最大的清算会员的持仓总量的占比（包括自营和代理）；季度内平均值和最大值	季度均值 季度峰值	数字，两位 小数，百分比	表单 18.2	季度	
18	持仓量的集中度	18.2.3	对清算会员数在25或以上的清算业务，提供十家最大的清算会员的持仓总量的占比（包括自营和代理）；季度内平均值和最大值	季度均值 季度峰值	数字，两位 小数，百分比	表单 18.2	季度	
18	初始保证金集中度	18.3.1	对清算会员数在10到25之间的清算业务，提供五家最大的清算会员提交的初始保证金总额的占比（包括自营和代理）	季度均值 季度峰值	数字，两位 小数，百分比	表单 18.2	季度	
18	初始保证金集中度	18.3.2	对清算会员数在25或以上的清算业务，提供五家最大的清算会员提交的初始保证金总额的占比（包括自营和代理）；季度内平均值和最大值	季度均值 季度峰值	数字，两位 小数，百分比	表单 18.2	季度	
18	初始保证金集中度	18.3.3	对清算会员数在25或以上的清算业务，提供十家最大的清算会员提交的初始保证金总额的占比（包括自营和代理）；季度内平均值和最大值	季度均值 季度峰值	数字，两位 小数，百分比	表单 18.2	季度	
18	独立核算的清算基金集中度	18.4.1	对每个清算会员数在10到25之间的分类独立核算的清算基金，提供五家最大的清算会员缴纳的清算基金总额的占比	不适用	数字，两位 小数，百分比	综合表单	季度	
18	独立核算的清算基金集中度	18.4.2	对每个清算会员数在25或以上的分类独立核算的清算基金，提供五家最大的清算会员缴纳的清算基金总额的占比	不适用	数字，两位 小数，百分比	综合表单	季度	
18	独立核算的清算基金集中度	18.4.3	对每个清算会员数在25或以上的分类独立核算的清算基金，提供十家最大的清算会员缴纳的清算基金总额的占比	不适用	数字，两位 小数，百分比	综合表单	季度	
19	分层参与安排，对客户清算集中程度的衡量	19.1.1	代理客户数（如果已知）	不适用	数字，整数	综合表单	季度	
19	分层参与安排，对客户清算集中程度的衡量	19.1.2	代理客户清算的综合清算会员的数量	不适用	数字，整数	综合表单	季度	
19	分层参与安排，对客户清算集中程度的衡量	19.1.3.1	代理清算业务金额（以名义本金或清算金额衡量）排名前五的清算会员的代理清算业务金额占所有代理清算业务金额的比例（如果中央对手方的会员数超过10家）-峰值	不适用	数字，两位 小数，百分比	综合表单	季度	
19	分层参与安排，对客户清算集中程度的衡量	19.1.3.2	代理清算业务金额（以名义本金或清算金额衡量）排名前五的清算会员的代理清算业务金额占所有代理清算业务金额的比例（如果中央对手方的会员数超过10家）-均值	不适用	数字，两位 小数，百分比	综合表单	季度	

指引表单

原则	条目	对应原则要点	披露描述	描述值（不适用于综合表单）	数字格式	所在表单	报告频率	备注
19	分层参与安排，对客户清算集中程度的衡量	19.1.4.1	代理清算业务金额（以名义本金或清算金额衡量）排名前十的清算会员的代理清算业务金额占所有代理清算业务金额的比例（如果中央对手方的会员数超过25家）-峰值	不适用	数字，两位小数，百分比	综合表单	季度	
19	分层参与安排，对客户清算集中程度的衡量	19.1.4.2	代理清算业务金额（以名义本金或清算金额衡量）排名前十的清算会员的代理清算业务金额占所有代理清算业务金额的比例（如果中央对手方的会员数超过25家）-均值	不适用	数字，两位小数，百分比	综合表单	季度	
20	基础设施的连接，交易总金额	20.1.1	通过每个连接的中央对手方清算的交易额占总清算金额的比例	不适用	数字，两位小数，百分	表单 20a	季度	
20	基础设施的连接，初始保证金或等价金融资源	20.2.1	由中央对手方提交给每个相连接的中央对手方的初始保证金或等价金融资源，用以覆盖连接的中央对手方的风险敞口	不适用	数字，两位小数，货币单位	表单 20a	季度	
20	基础设施的连接，初始保证金或等价金融资源	20.3.1	从每个相连接的中央对手方处收取的初始保证金或等价金融资源，用以覆盖对连接的中央对手方的风险敞口	不适用	数字，两位小数，货币单位	表单 20b	季度	
20	基础设施的连接，回溯测试的结果	20.4.1.1	基于每日回溯的结果，过去十二个月中对每个连接的中央对手方持有的保证金及等价金融资源的价值低于敞口市场价格的次数	不适用	数字，整数	表单 20a	季度，跨度12个月	
20	基础设施的连接，回溯测试的结果	20.4.1.2	回溯测试的频率，日间、连续还是一日一次	不适用	文本	表单 20a	季度，跨度12个月	
20	基础设施的连接，回溯测试的结果	20.4.1.3	如果20.4.1.2的回答是“一日一次”，那么请说明测试的具体时间，否则为空	不适用	文本	表单 20a	季度，跨度12个月	
20	基础设施的连接，回溯测试的结果	20.4.2	观察值的数量	不适用	数字，整数	表单 20a	季度，跨度12个月	
20	基础设施的连接，回溯测试的结果	20.4.3	达到的覆盖水平	不适用	数字，两位小数，百分	表单 20a	季度，跨度12个月	
21	基础设施的连接，额外预留的金融资源去向	20.5.1.1	向每个相连接的中央对手方提供的初始保证金及等价金融资源以外的预留资金（如果有的话）	不适用	数字，两位小数，货币	表单 20a	季度	
21	基础设施的连接，额外预留的金融资源去向	20.5.1.2	这部分资金是标准清算基金的一部分还是单独存放	不适用	文本	表单 20a	季度	
21	基础设施的连接，额外预留的金融资源来源	20.6.1.1	从每个相连接的中央对手方处收取的初始保证金及等价金融资源以外的预留资金（如果有的话）	不适用	数字，两位小数，货币	表单 20a	季度	
21	基础设施的连接，额外预留的金融资源来源	20.6.1.2	这部分资金是标准清算基金的一部分还是单独存放	不适用	文本	表单 20a	季度	
21	基础设施的连接，交叉保证金	20.7.1	适用跨市场保证金的交易的金额，占总清算金额的比例	不适用	数字，两位小数，百分	表单 20a	季度	
21	基础设施的连接，交叉保证金	20.7.2	由于跨市场保证金导致的中央对手方持有的初始保证金的减少额，占总初始保证金的比例	不适用	数字，两位小数，百分	表单 20a	季度	

指引表单

原则	条目	对应原则要点	披露描述	描述值（不适用于综合表单）	数字格式	所在表单	报告频率	备注
23	相关规则、重要流程和市场数据的披露；日均数值	23.1.1	日均清算手数，按工具、资产类型、币种、场外或交易所区分	场外	数字，整数	表单 23	季度	
23	相关规则、重要流程和市场数据的披露；日均数值	23.1.2	日均名义本金，按工具、资产类型、币种、场外或交易所区分	场外	数字，两位小数，货币单位	表单 23	季度	
23	相关规则、重要流程和市场数据的披露；尚未结算的	23.2.1	已进行合约替代但尚未结算的证券交易结算金额，按工具、资产类型、币种、场外或交易所区分	场外	数字，两位小数，货币单位	表单 23	季度	
23	相关规则、重要流程和市场数据的披露；尚未结算的	23.2.2	说明23.1.1, 23.1.2和23.2.1的资产类型	资产类型： 利率互换 信用违约互换	文本	表单 23	季度	
23	相关规则、重要流程和市场数据的披露；尚未结算的	23.2.3	说明23.1.1, 23.1.2和23.2.1的产品种类	产品类型： 指数 单一名称 外汇	文本	表单 23	季度	
23	相关规则、重要流程和市场数据的披露；尚未结算的	23.2.4	说明23.1.1, 23.1.2和23.2.2的产品代码	产品代码：	文本	表单 23	季度	
23	相关规则、重要流程和市场数据的披露；执行机构	23.3.1	由各交易平台提交的日均合约数量	执行场所	数字，两位小数	表单 23.3	季度	
23	相关规则、重要流程和市场数据的披露；执行机构	23.3.2	由各交易平台提交的日均名义金额	执行场所	数字，两位小数，货币	表单 23.3	季度	

表单修改

披露日期	修改日期	条目	前次数据	新数据	备注
无	无	无	无	无	无

披露日期	对应原则要点	披露条目	披露描述	数字格式	报告等级1	报告等级标识1	货币1	CCP链接1	描述1	值1	说明1	报告等级标识2	货币2	CCP链接2	描述2	值2	说明2
2024-09-30	4.1.1	违约资源总额（除去初始和留存的变动保证金），如果违约基金分业务，则按各业务区分	预先缴纳的违约资源 - 清算所自有资本 - 在使用会员缴纳额之前使用的金额 《季末数据》	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用		200000000.00	不适用						
2024-09-30	4.1.2	违约资源总额（除去初始和留存的变动保证金），如果违约基金分业务，则按各业务区分	预先缴纳的违约资源 - 清算所自有资本 - 在使用会员缴纳额同时使用的金额 《季末数据》	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用		0.00	不适用						
2024-09-30	4.1.3	违约资源总额（除去初始和留存的变动保证金），如果违约基金分业务，则按各业务区分	预先缴纳的违约资源 - 清算所自有资本 - 在使用会员缴纳额之后使用的金额 《季末数据》	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用		1800000000.00	不适用						
2024-09-30	4.1.4	违约资源总额（除去初始和留存的变动保证金），如果违约基金分业务，则按各业务区分	预先缴纳的违约资源 - 清算参与者缴纳总额 - 要求缴纳的金额 《季末数据》	数字，两位小数，货币单位	违约基金	债券	人民币	不适用		58990000.00	不适用	大宗商品	人民币	不适用		6300000.00	不适用
2024-09-30	4.1.5	违约资源总额（除去初始和留存的变动保证金），如果违约基金分业务，则按各业务区分	预先缴纳的违约资源 - 清算参与者缴纳总额 - 扣除折扣率后的金额 《季末数据》	数字，两位小数，货币单位	违约基金	债券	人民币	不适用		58990000.00	不适用	大宗商品	人民币	不适用		6300000.00	不适用
2024-09-30	4.1.6	违约资源总额（除去初始和留存的变动保证金），如果违约基金分业务，则按各业务区分	预先缴纳的违约资源 - 其他 《季末数据》	数字，两位小数，货币单位	违约基金	债券	人民币	不适用		0.00	不适用	大宗商品	人民币	不适用		0.00	不适用
2024-09-30	4.1.7	违约资源总额（除去初始和留存的变动保证金），如果违约基金分业务，则按各业务区分	补充违约资源 - 中央对手方承诺用于应对单个或多个参与者的自有或母公司资金总额 《季末数据》	数字，两位小数，货币单位	违约基金	债券	人民币	不适用		0.00	不适用	大宗商品	人民币	不适用		0.00	不适用
2024-09-30	4.1.8	违约资源总额（除去初始和留存的变动保证金），如果违约基金分业务，则按各业务区分	补充违约资源 - 清算参与者承诺用于应对单个或多个参与者首次违约的资金总额 《季末数据》	数字，两位小数，货币单位	违约基金	债券	人民币	不适用		58990000.00	不适用	大宗商品	人民币	不适用		6300000.00	不适用
2024-09-30	4.1.9	违约资源总额（除去初始和留存的变动保证金），如果违约基金分业务，则按各业务区分	补充违约资源 - 单个或多个清算参与者首次违约问题解决后，清算参与者承诺重新补充清算基金以解决后续违约事件的资金总额 《季末数据》	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所		不适用		上海清算所在处理清算会员违约处理期间，将不对非违约清算会员的清算基金应缴总额（包括其应缴纳的清算基金份额以及其应缴纳的补充清算基金份额）以及清算基金交纳比例进行调整。非违约清算会员的清算基金应缴总额以及应支付的清算基金交纳比例依照首个违约会员发生违约时的前一个工作日的标准确定。在任意90个自然日内（含），某业务补充清算基金份额的补充上限为清算会员依据上述标准确定的该业务应缴纳的清算基金份额。							
2024-09-30	4.1.10	违约资源总额（除去初始和留存的变动保证金），如果违约基金分业务，则按各业务区分	补充违约资源 - 其他 《季末数据》	数字，两位小数，货币单位	违约基金	债券	人民币	不适用		0.00	不适用	大宗商品	人民币	不适用		0.00	不适用
2024-09-30	4.2.1	Kccp	Kccp: 只有作为或根据相关法律申请成为“合格中央对手方”的中央对手方需要披露该指标	数字，两位小数	违约基金	债券	人民币	不适用		0.00	不适用	大宗商品	人民币	不适用		0.00	不适用

披露日期	对应 原则 要点	报告等级标识 3	货币3	CCP链接3	描述3	值3	说明3	报告等级标识 4	货币 4	CCP链接 4	描述4	值4	说明 4	报告等级标识 5	货币5	CCP链接5	描述5	值5	说明5	报告等 级标识 6	货币6	CCP链接 6	描述6	值6	说明6	报告等级 标识7	货币7	CCP链接7	描述7	值7	说明7
2024-09-30	4.1.1																														
2024-09-30	4.1.2																														
2024-09-30	4.1.3																														
2024-09-30	4.1.4	利率互换	人民币	不适用		3478500000.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用		27280000.00	不适用	人民币外汇	人民币	不适用		27758070000.00	不适用	外币对	人民币	不适用		4895010000.00	不适用						
2024-09-30	4.1.5	利率互换	人民币	不适用		3478500000.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用		27280000.00	不适用	人民币外汇	人民币	不适用		27758070000.00	不适用	外币对	人民币	不适用		4895010000.00	不适用						
2024-09-30	4.1.6	利率互换	人民币	不适用		0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用		0.00	不适用	人民币外汇	人民币	不适用		0.00	不适用	外币对	人民币	不适用		0.00	不适用						
2024-09-30	4.1.7	利率互换	人民币	不适用		0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用		0.00	不适用	人民币外汇	人民币	不适用		0.00	不适用	外币对	人民币	不适用		0.00	不适用						
2024-09-30	4.1.8	利率互换	人民币	不适用		3478500000.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用		27280000.00	不适用	人民币外汇	人民币	不适用		27758070000.00	不适用	外币对	人民币	不适用		4895010000.00	不适用						
2024-09-30	4.1.9																														
2024-09-30	4.1.10	利率互换	人民币	不适用		0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用		0.00	不适用	人民币外汇	人民币	不适用		0.00	不适用	外币对	人民币	不适用		0.00	不适用						
2024-09-30	4.2.1	利率互换	人民币	不适用		12274518.46	不适用	标准债券远期	人民币	不适用		3147.10	不适用	人民币外汇	人民币	不适用		247676875.71	不适用	外币对	人民币	不适用		2153173.41	不适用						

披露日期	对应原则要点	报告等级标识8	货币8	CCP链接8	描述8	值8	说明8
2024-09-30	4.1.1						
2024-09-30	4.1.2						
2024-09-30	4.1.3						
2024-09-30	4.1.4						
2024-09-30	4.1.5						
2024-09-30	4.1.6						
2024-09-30	4.1.7						
2024-09-30	4.1.8						
2024-09-30	4.1.9						
2024-09-30	4.1.10						
2024-09-30	4.2.1						

披露日期	对应原则要点	披露条目	披露描述	数字格式	报告等级1	报告等级标识1	货币1	CCP链接1	描述1	值1	说明1	报告等级标识2	货币2	CCP链接2	描述2	值2	说明2
2024-09-30	4.3.1	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	预先缴纳的违约资源总额：存放在发行相关货币的中央银行里的现金存款；扣除折扣率前及后	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	扣除折扣率前	0.00	不适用						
2024-09-30	4.3.1	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	预先缴纳的违约资源总额：存放在发行相关货币的中央银行里的现金存款；扣除折扣率前及后	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	扣除折扣率后	0.00	不适用						
2024-09-30	4.3.2	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	预先缴纳的违约资源总额：存放在其他中央银行的现金存款；扣除折扣率前及后	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	扣除折扣率前	0.00	不适用						
2024-09-30	4.3.2	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	预先缴纳的违约资源总额：存放在其他中央银行的现金存款；扣除折扣率前及后	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	扣除折扣率后	0.00	不适用						
2024-09-30	4.3.3	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	预先缴纳的违约资源总额：存放在商业银行里的有担保的现金（包括逆回购）；扣除折扣率前及后	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	扣除折扣率前	0.00	不适用						
2024-09-30	4.3.3	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	预先缴纳的违约资源总额：存放在商业银行里的有担保的现金（包括逆回购）；扣除折扣率前及后	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	扣除折扣率后	0.00	不适用						
2024-09-30	4.3.4	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	预先缴纳的违约资源总额：存放在商业银行里的无担保现金；扣除折扣率前及后	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	扣除折扣率前	38224150000.00	不适用						
2024-09-30	4.3.4	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	预先缴纳的违约资源总额：存放在商业银行里的无担保现金；扣除折扣率前及后	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	扣除折扣率后	38224150000.00	不适用						
2024-09-30	4.3.5	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	预先缴纳的违约资源总额：非现金主权政府债券 - 本国；扣除折扣率前及后	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	扣除折扣率前	0.00	不适用						
2024-09-30	4.3.5	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	预先缴纳的违约资源总额：非现金主权政府债券 - 本国；扣除折扣率前及后	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	扣除折扣率后	0.00	不适用						
2024-09-30	4.3.6	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	预先缴纳的违约资源总额：非现金主权政府债券 - 其他；扣除折扣率前及后	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	扣除折扣率前	0.00	不适用						
2024-09-30	4.3.6	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	预先缴纳的违约资源总额：非现金主权政府债券 - 其他；扣除折扣率前及后	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	扣除折扣率后	0.00	不适用						
2024-09-30	4.3.7	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	预先缴纳的违约资源总额：非现金机构债券；扣除折扣率前及后	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	扣除折扣率前	0.00	不适用						
2024-09-30	4.3.7	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	预先缴纳的违约资源总额：非现金机构债券；扣除折扣率前及后	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	扣除折扣率后	0.00	不适用						
2024-09-30	4.3.8	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	预先缴纳的违约资源总额：非现金州或市政公债；扣除折扣率前及后	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	扣除折扣率前	0.00	不适用						

披露日期	对应 原则 要点	报告等级标识 3	货币3	CCP链接3	描述3	值3	说明3	报告等级标识 4	货币 4	CCP链接 4	描述4	值4	说明 4	报告等级标识 5	货币5	CCP链接5	描述5	值5	说明5	报告等 级标识 6	货币6	CCP链接 6	描述6	值6	说明6	报告等级 标识7	货币7	CCP链接7	描述7	值7	说明7
2024-09-30	4.3.1																														
2024-09-30	4.3.1																														
2024-09-30	4.3.2																														
2024-09-30	4.3.2																														
2024-09-30	4.3.3																														
2024-09-30	4.3.3																														
2024-09-30	4.3.4																														
2024-09-30	4.3.4																														
2024-09-30	4.3.5																														
2024-09-30	4.3.5																														
2024-09-30	4.3.6																														
2024-09-30	4.3.6																														
2024-09-30	4.3.7																														
2024-09-30	4.3.7																														
2024-09-30	4.3.8																														

披露日期	对应原则要点	报告等级标识8	货币8	CCP链接8	描述8	值8	说明8
2024-09-30	4.3.1						
2024-09-30	4.3.1						
2024-09-30	4.3.2						
2024-09-30	4.3.2						
2024-09-30	4.3.3						
2024-09-30	4.3.3						
2024-09-30	4.3.4						
2024-09-30	4.3.4						
2024-09-30	4.3.5						
2024-09-30	4.3.5						
2024-09-30	4.3.6						
2024-09-30	4.3.6						
2024-09-30	4.3.7						
2024-09-30	4.3.7						
2024-09-30	4.3.8						

披露日期	对应原则要点	披露条目	披露描述	数字格式	报告等级1	报告等级标识1	货币1	CCP链接1	描述1	值1	说明1	报告等级标识2	货币2	CCP链接2	描述2	值2	说明2
2024-09-30	4.3.8	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	预先缴纳的违约资源总额：非现金州或市政公债；扣除折扣率前及后	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	扣除折扣率后	0.00	不适用						
2024-09-30	4.3.9	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	预先缴纳的违约资源总额：非现金公司债券；扣除折扣率前及后	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	扣除折扣率前	0.00	不适用						
2024-09-30	4.3.9	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	预先缴纳的违约资源总额：非现金公司债券；扣除折扣率前及后	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	扣除折扣率后	0.00	不适用						
2024-09-30	4.3.10	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	预先缴纳的违约资源总额：非现金股权；扣除折扣率前及后	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	扣除折扣率前	0.00	不适用						
2024-09-30	4.3.10	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	预先缴纳的违约资源总额：非现金股权；扣除折扣率前及后	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	扣除折扣率后	0.00	不适用						
2024-09-30	4.3.11	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	预先缴纳的违约资源总额：非现金大宗商品 - 黄金；扣除折扣率前及后	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	扣除折扣率前	0.00	不适用						
2024-09-30	4.3.11	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	预先缴纳的违约资源总额：非现金大宗商品 - 黄金；扣除折扣率前及后	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	扣除折扣率后	0.00	不适用						
2024-09-30	4.3.12	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	预先缴纳的违约资源总额：非现金大宗商品 - 其他；扣除折扣率前及后	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	扣除折扣率前	0.00	不适用						
2024-09-30	4.3.12	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	预先缴纳的违约资源总额：非现金大宗商品 - 其他；扣除折扣率前及后	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	扣除折扣率后	0.00	不适用						
2024-09-30	4.3.13	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	预先缴纳的违约资源总额：非现金共同基金或UCITs；扣除折扣率前及后	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	扣除折扣率前	0.00	不适用						
2024-09-30	4.3.13	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	预先缴纳的违约资源总额：非现金共同基金或UCITs；扣除折扣率前及后	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	扣除折扣率后	0.00	不适用						
2024-09-30	4.3.14	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	预先缴纳的违约资源总额：非现金 - 其他；扣除折扣率前及后	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	扣除折扣率前	0.00	不适用						
2024-09-30	4.3.14	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	预先缴纳的违约资源总额：非现金 - 其他；扣除折扣率前及后	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	扣除折扣率后	0.00	不适用						
2024-09-30	4.3.15	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	总额 季末披露；扣除折扣率前及后	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	扣除折扣率前	38224150000.00	不适用						
2024-09-30	4.3.15	为每一项清算服务预先缴纳的违约资源总额(除去初始和留存的变动保证金)，扣除折扣率前及后	总额 季末披露；扣除折扣率前及后	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	扣除折扣率后	38224150000.00	不适用						

披露日期	对应 原则 要点	报告等级标识 3	货币3	CCP链接3	描述3	值3	说明3	报告等级标识 4	货币 4	CCP链接 4	描述4	值4	说明 4	报告等级标识 5	货币5	CCP链接5	描述5	值5	说明5	报告等 级标识 6	货币6	CCP链接 6	描述6	值6	说明6	报告等级 标识7	货币7	CCP链接7	描述7	值7	说明7
2024-09-30	4.3.8																														
2024-09-30	4.3.9																														
2024-09-30	4.3.9																														
2024-09-30	4.3.10																														
2024-09-30	4.3.10																														
2024-09-30	4.3.11																														
2024-09-30	4.3.11																														
2024-09-30	4.3.12																														
2024-09-30	4.3.12																														
2024-09-30	4.3.13																														
2024-09-30	4.3.13																														
2024-09-30	4.3.14																														
2024-09-30	4.3.14																														
2024-09-30	4.3.15																														
2024-09-30	4.3.15																														

披露日期	对应原则要点	报告等级标识8	货币8	CCP链接8	描述8	值8	说明8
2024-09-30	4.3.8						
2024-09-30	4.3.9						
2024-09-30	4.3.9						
2024-09-30	4.3.10						
2024-09-30	4.3.10						
2024-09-30	4.3.11						
2024-09-30	4.3.11						
2024-09-30	4.3.12						
2024-09-30	4.3.12						
2024-09-30	4.3.13						
2024-09-30	4.3.13						
2024-09-30	4.3.14						
2024-09-30	4.3.14						
2024-09-30	4.3.15						
2024-09-30	4.3.15						

披露日期	对应原则要点	披露条目	披露描述	数字格式	报告等级1	报告等级标识1	货币1	CCP链接1	描述1	值1	说明1	报告等级标识2	货币2	CCP链接2	描述2	值2	说明2
2024-09-30	4.4.1	信用风险披露	说明中央对手方预先缴纳的违约资源总额是符合“Cover 1”还是“Cover 2”最低要求	文本	违约基金	债券		不适用		Cover 2	不适用	大宗商品		不适用		Cover 2	不适用
2024-09-30	4.4.2	信用风险披露	说明中央对手方在计算清算基金覆盖的信用风险敞口时假设的违约平均天数	数字，整数	违约基金	债券		不适用			3 不适用	大宗商品		不适用			2 不适用
2024-09-30	4.4.3	信用风险披露	对各项清算业务，在极端但合理的市场条件下单个参与者及其附属机构（包括其为间接参与者清算的交易）造成的最大合计压力损失（超过初始保证金的部分）的估计值；最大值和	数字，两位小数	违约基金	债券	人民币	不适用	过去12个月内平均值	5035433.45	不适用	大宗商品	人民币	不适用	过去12个月内平均值	7259.57	不适用
2024-09-30	4.4.3	信用风险披露	对各项清算业务，在极端但合理的市场条件下单个参与者及其附属机构（包括其为间接参与者清算的交易）造成的最大合计压力损失（超过初始保证金的部分）的估计值；最大值和	数字，两位小数	违约基金	债券	人民币	不适用	过去12个月内最大值	44945039.24	不适用	大宗商品	人民币	不适用	过去12个月内最大值	846873.26	不适用
2024-09-30	4.4.4	信用风险披露	以上数字超过预先准备违约资源值的工作日天数	数字，整数	违约基金	债券		不适用			0 不适用	大宗商品		不适用		0	不适用
2024-09-30	4.4.5	信用风险披露	以上数字（4.4.3）超过预先缴纳的违约资源总额（超过初始保证金的部分）的金额大小	数字，两位小数，货币单位	违约基金	债券	人民币	不适用	超出数量	0.00	不适用	大宗商品	人民币	不适用	超出数量	0.00	不适用
2024-09-30	4.4.6	信用风险披露	敞口（超过最低保证金及超限保证金总额的）的实际值，包括代理清算	数字，两位小数，货币单位	违约基金	债券	人民币	不适用	过去12个月内平均值	0.00	不适用	大宗商品	人民币	不适用	过去12个月内平均值	0.00	不适用
2024-09-30	4.4.6	信用风险披露	敞口（超过最低保证金及超限保证金总额的）的实际值，包括代理清算	数字，两位小数，货币单位	违约基金	债券	人民币	不适用	过去12个月内最大值	0.00	不适用	大宗商品	人民币	不适用	过去12个月内最大值	0.00	不适用
2024-09-30	4.4.7	信用风险披露	对各项清算业务，在极端但合理的市场条件下两个参与者造成的最大合计压力损失（超过最低保证金及超限保证金总额的部分）的估计值，包括代	数字，两位小数，货币单位	违约基金	债券	人民币	不适用	过去12个月内平均值	5922225.13	不适用	大宗商品	人民币	不适用	过去12个月内平均值	10759.04	不适用
2024-09-30	4.4.7	信用风险披露	对各项清算业务，在极端但合理的市场条件下两个参与者造成的最大合计压力损失（超过最低保证金及超限保证金总额的部分）的估计值，包括代	数字，两位小数，货币单位	违约基金	债券	人民币	不适用	过去12个月内最大值	61212770.71	不适用	大宗商品	人民币	不适用	过去12个月内最大值	1693746.52	不适用
2024-09-30	4.4.8	信用风险披露	以上数字（4.4.6）超过预先缴纳的违约资源总额（超过初始保证金的部分）的工作日天数	数字，整数	违约基金	债券		不适用			0 不适用	大宗商品		不适用		0	不适用
2024-09-30	4.4.9	信用风险披露	以上数字（4.4.6）超过预先缴纳的违约资源总额（超过初始保证金的部分）的金额大小	数字，两位小数，货币单位	违约基金	债券	人民币	不适用	超出数量	0.00	不适用	大宗商品	人民币	不适用	超出数量	0.00	不适用
2024-09-30	4.4.10	信用风险披露	两个参与者造成的最大合计信用风险敞口（超过该会员最低保证金及超限保证金总额的部分）的实际值，包括代理清算；过去12个月的最大值和平均	数字，两位小数，货币单位	违约基金	债券	人民币	不适用	过去12个月内平均值	0.00	不适用	大宗商品	人民币	不适用	过去12个月内平均值	0.00	不适用
2024-09-30	4.4.10	信用风险披露	两个参与者造成的最大合计信用风险敞口（超过该会员最低保证金及超限保证金总额的部分）的实际值，包括代理清算；过去12个月的最大值和平均	数字，两位小数，货币单位	违约基金	债券	人民币	不适用	过去12个月内最大值	0.00	不适用	大宗商品	人民币	不适用	过去12个月内最大值	0.00	不适用
2024-09-30	5.1.1	可作为初始保证金的资产类型，以及对适用的折扣率	可作为初始保证金的资产类型，以及对适用的折扣率	文本	中央对手方	上海清算所		不适用		https://www.shclearing.com.cn/	不适用						
2024-09-30	5.2.1	可作为由清算参与者预先缴纳的违约资源的资产类型，以及对适用的折扣率（如果与5.1不同的话）	可作为由清算参与者预先缴纳的违约资源的资产类型，以及对适用的折扣率（如果与5.1不同的话）	文本	中央对手方	上海清算所		不适用		现金	不适用						
2024-09-30	5.3.1	折扣率测试结果	计算折扣率时的目标置信区间	数字，两位小数，百分比	中央对手方	上海清算所		不适用		99.50%	不适用						
2024-09-30	5.3.2	折扣率测试结果	可作为抵押品的资产的假设的持有/平仓期限	文本	中央对手方	上海清算所		不适用		10天	不适用						
2024-09-30	5.3.3	折扣率测试结果	测试折扣率所用的回溯期限	文本	中央对手方	上海清算所		不适用	天数	500	不适用						
2024-09-30	5.3.4	折扣率测试结果	在回溯期限内，资产价值在假设的持有/平仓期限内减记幅度超过折扣率的天数	数字，整数	中央对手方	上海清算所		不适用			0 不适用						
2024-09-30	6.1.1	对于每一项清算服务的初始保证金总额，分自营和代理（如果自营和代理业务的初始保证金没有分类独立核算，就列出自营和代理的总额）	要求缴纳的初始保证金总额，分自营、代理全额、代理净额或自营和代理的总额（如果自营和代理业务的初始保证金没有分类独立核算）	数字，两位小数，货币单位	违约基金	债券	人民币	不适用	代理全值	5288000.00	不适用	大宗商品	人民币	不适用	代理全值	0.00	不适用
2024-09-30	6.1.1	对于每一项清算服务的初始保证金总额，分自营和代理（如果自营和代理业务的初始保证金没有分类独立核算，就列出自营和代理的总额）	要求缴纳的初始保证金总额，分自营、代理全额、代理净额或自营和代理的总额（如果自营和代理业务的初始保证金没有分类独立核算）	数字，两位小数，货币单位	违约基金	债券	人民币	不适用	代理净值	0.00	不适用	大宗商品	人民币	不适用	代理净值	0.00	不适用
2024-09-30	6.1.1	对于每一项清算服务的初始保证金总额，分自营和代理（如果自营和代理业务的初始保证金没有分类独立核算，就列出自营和代理的总额）	要求缴纳的初始保证金总额，分自营、代理全额、代理净额或自营和代理的总额（如果自营和代理业务的初始保证金没有分类独立核算）	数字，两位小数，货币单位	违约基金	债券	人民币	不适用	自营净值	872060200.00	不适用	大宗商品	人民币	不适用	自营净值	0.00	不适用
2024-09-30	6.1.1	对于每一项清算服务的初始保证金总额，分自营和代理（如果自营和代理业务的初始保证金没有分类独立核算，就列出自营和代理的总额）	要求缴纳的初始保证金总额，分自营、代理全额、代理净额或自营和代理的总额（如果自营和代理业务的初始保证金没有分类独立核算）	数字，两位小数，货币单位	违约基金	债券	人民币	不适用	总额	877348200.00	不适用	大宗商品	人民币	不适用	总额	0.00	不适用
2024-09-30	6.2.1	对于每一项清算服务的初始保证金总额，分自营和代理	实际持有的初始保证金总额；存放于发行相关货币的中央银行里的现金存款，分自营和代理，或自营和代理的总额（如果自营和代理业务的初始保证金没有分类独立核算）；扣除折扣率前后	数字，两位小数，货币单位	违约基金	债券	人民币	不适用	代理-扣除折扣率后	0.00	不适用	大宗商品	人民币	不适用	代理-扣除折扣率后	0.00	不适用
2024-09-30	6.2.1	对于每一项清算服务的初始保证金总额，分自营和代理	实际持有的初始保证金总额；存放于发行相关货币的中央银行里的现金存款，分自营和代理，或自营和代理的总额（如果自营和代理业务的初始保证金没有分类独立核算）；扣除折扣率前后	数字，两位小数，货币单位	违约基金	债券	人民币	不适用	代理-扣除折扣率前	0.00	不适用	大宗商品	人民币	不适用	代理-扣除折扣率前	0.00	不适用
2024-09-30	6.2.1	对于每一项清算服务的初始保证金总额，分自营和代理	实际持有的初始保证金总额；存放于发行相关货币的中央银行里的现金存款，分自营和代理，或自营和代理的总额（如果自营和代理业务的初始保证金没有分类独立核算）；扣除折扣率前后	数字，两位小数，货币单位	违约基金	债券	人民币	不适用	自营-扣除折扣率后	0.00	不适用	大宗商品	人民币	不适用	自营-扣除折扣率后	0.00	不适用

披露日期	对应 原则 要点	报告等级标识 3	货币3	CCP链接3	描述3	值3	说明3	报告等级标识 4	货币 4	CCP链接4	描述4	值4	说明 4	报告等级标识 5	货币5	CCP链接5	描述5	值5	说明5	报告等 级标识 6	货币6	CCP链接 6	描述6	值6	说明6	报告等级 标识7	货币7	CCP链接7	描述7	值7	说明7
2024-09-30	4.4.1	利率互换		不适用		Cover 2	不适用	标准债券远期		不适用		Cover 2	不适用	人民币外汇		不适用		Cover 2	不适用	外币对		不适用		Cover 2	不适用						
2024-09-30	4.4.2	利率互换		不适用		10	不适用	标准债券远期		不适用		2	不适用	人民币外汇		不适用		5	不适用	外币对		不适用		5	不适用						
2024-09-30	4.4.3	利率互换	人民币	不适用	过去12个月 内平均值	2495937226.04	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	过去12个月 内平均值	2106105.23	不适用	人民币外汇	美元	不适用	过去12个月 内平均值	1715951333.10	不适用	外币对	美元	不适用	过去12个月 内平均值	279327075.04	不适用						
2024-09-30	4.4.3	利率互换	人民币	不适用	过去12个月 内最大值	3427348837.45	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	过去12个月 内最大值	15976600.11	不适用	人民币外汇	美元	不适用	过去12个月 内最大值	3660531757.86	不适用	外币对	美元	不适用	过去12个月 内最大值	480263442.19	不适用						
2024-09-30	4.4.4	利率互换		不适用		0	不适用	标准债券远期		不适用		0	不适用	人民币外汇		不适用		0	不适用	外币对		不适用		0	不适用						
2024-09-30	4.4.5	利率互换	人民币	不适用	超出数量	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	超出数量	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	超出数量	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	超出数量	0.00	不适用						
2024-09-30	4.4.6	利率互换	人民币	不适用	过去12个月 内平均值	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	过去12个月 内平均值	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	过去12个月 内平均值	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	过去12个月 内平均值	0.00	不适用						
2024-09-30	4.4.6	利率互换	人民币	不适用	过去12个月 内最大值	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	过去12个月 内最大值	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	过去12个月 内最大值	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	过去12个月 内最大值	0.00	不适用						
2024-09-30	4.4.7	利率互换	人民币	不适用	过去12个月 内平均值	2999440164.91	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	过去12个月 内平均值	2533868.94	不适用	人民币外汇	美元	不适用	过去12个月 内平均值	1928744153.22	不适用	外币对	美元	不适用	过去12个月 内平均值	355644697.09	不适用						
2024-09-30	4.4.7	利率互换	人民币	不适用	过去12个月 内最大值	3687764766.49	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	过去12个月 内最大值	24683791.22	不适用	人民币外汇	美元	不适用	过去12个月 内最大值	3913177806.66	不适用	外币对	美元	不适用	过去12个月 内最大值	576816088.94	不适用						
2024-09-30	4.4.8	利率互换		不适用		0	不适用	标准债券远期		不适用		0	不适用	人民币外汇		不适用		0	不适用	外币对		不适用		0	不适用						
2024-09-30	4.4.9	利率互换	人民币	不适用	超出数量	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	超出数量	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	超出数量	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	超出数量	0.00	不适用						
2024-09-30	4.4.10	利率互换	人民币	不适用	过去12个月 内平均值	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	过去12个月 内平均值	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	过去12个月 内平均值	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	过去12个月 内平均值	0.00	不适用						
2024-09-30	4.4.10	利率互换	人民币	不适用	过去12个月 内最大值	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	过去12个月 内最大值	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	过去12个月 内最大值	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	过去12个月 内最大值	0.00	不适用						
2024-09-30	5.1.1																														
2024-09-30	5.2.1																														
2024-09-30	5.3.1																														
2024-09-30	5.3.2																														
2024-09-30	5.3.3																														
2024-09-30	5.3.4																														
2024-09-30	6.1.1	利率互换	人民币	不适用	代理全值	8353013821.35	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	代理全值	80995000.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	代理全值	305208173.00	不适用	外币对	美元	不适用	代理全值	30825093.00	不适用						
2024-09-30	6.1.1	利率互换	人民币	不适用	代理净值	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	代理净值	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	代理净值	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	代理净值	0.00	不适用						
2024-09-30	6.1.1	利率互换	人民币	不适用	自营净值	18445393318.53	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	自营净值	234479491.56	不适用	人民币外汇	美元	不适用	自营净值	18552790682.00	不适用	外币对	美元	不适用	自营净值	960430315.00	不适用						
2024-09-30	6.1.1	利率互换	人民币	不适用	总额	26798407139.88	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	总额	315474491.56	不适用	人民币外汇	美元	不适用	总额	18857998855.00	不适用	外币对	美元	不适用	总额	991255408.00	不适用						
2024-09-30	6.2.1	利率互换	人民币	不适用	代理-扣除折 扣率后	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	代理-扣除折 扣率后	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	代理-扣除折 扣率后	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	代理-扣除折 扣率后	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.1	利率互换	人民币	不适用	代理-扣除折 扣率前	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	代理-扣除折 扣率前	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	代理-扣除折 扣率前	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	代理-扣除折 扣率前	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.1	利率互换	人民币	不适用	自营-扣除折 扣率后	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	自营-扣除折 扣率后	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	自营-扣除折 扣率后	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	自营-扣除折 扣率后	0.00	不适用						

披露日期	对应原则要点	报告等级标识8	货币8	CCP链接8	描述8	值8	说明8
2024-09-30	4.4.1						
2024-09-30	4.4.2						
2024-09-30	4.4.3						
2024-09-30	4.4.3						
2024-09-30	4.4.4						
2024-09-30	4.4.5						
2024-09-30	4.4.6						
2024-09-30	4.4.6						
2024-09-30	4.4.7						
2024-09-30	4.4.7						
2024-09-30	4.4.8						
2024-09-30	4.4.9						
2024-09-30	4.4.10						
2024-09-30	4.4.10						
2024-09-30	5.1.1						
2024-09-30	5.2.1						
2024-09-30	5.3.1						
2024-09-30	5.3.2						
2024-09-30	5.3.3						
2024-09-30	5.3.4						
2024-09-30	6.1.1						
2024-09-30	6.1.1						
2024-09-30	6.1.1						
2024-09-30	6.1.1						
2024-09-30	6.2.1						
2024-09-30	6.2.1						
2024-09-30	6.2.1						

披露日期	对应原则要点	报告等级标识8	货币8	CCP链接8	描述8	值8	说明8
2024-09-30	6.2.1						
2024-09-30	6.2.1						
2024-09-30	6.2.1						
2024-09-30	6.2.2						
2024-09-30	6.2.2						
2024-09-30	6.2.2						
2024-09-30	6.2.2						
2024-09-30	6.2.2						
2024-09-30	6.2.2						
2024-09-30	6.2.2						
2024-09-30	6.2.3						
2024-09-30	6.2.3						
2024-09-30	6.2.3						
2024-09-30	6.2.3						
2024-09-30	6.2.3						

披露日期	对应 原则 要点	报告等级标识 3	货币3	CCP链接3	描述3	值3	说明3	报告等级标识 4	货币 4	CCP链接4	描述4	值4	说明 4	报告等级标识 5	货币5	CCP链接5	描述5	值5	说明5	报告等 级标识 6	货币6	CCP链接 6	描述6	值6	说明6	报告等级 标识7	货币7	CCP链接7	描述7	值7	说明7
2024-09-30	6.2.4	利率互换	人民币	不适用	代理-扣除折 扣率后	8616605747.75	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	代理-扣除 折扣率后	94794764.62	不适用	人民币外汇	美元	不适用	代理-扣除折 扣率后	20000041.67	不适用	人民币外 汇	人民币	不适用	代理-扣除折 扣率后	3055464350.49	不适用	外币对	美元	不适用	代理-扣除折 扣率后	50000.00	不适用
2024-09-30	6.2.4	利率互换	人民币	不适用	代理-扣除折 扣率前	8616605747.75	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	代理-扣除 折扣率前	94794764.62	不适用	人民币外汇	美元	不适用	代理-扣除折 扣率前	20000041.67	不适用	人民币外 汇	人民币	不适用	代理-扣除折 扣率前	3206153568.20	不适用	外币对	美元	不适用	代理-扣除折 扣率前	50000.00	不适用
2024-09-30	6.2.4	利率互换	人民币	不适用	自营-扣除折 扣率后	20999960024.75	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	自营-扣除 折扣率后	696923307.17	不适用	人民币外汇	美元	不适用	自营-扣除折 扣率后	3181169923.61	不适用	人民币外 汇	人民币	不适用	自营-扣除折 扣率后	117408254651.89	不适用	外币对	美元	不适用	自营-扣除折 扣率后	1000000.00	不适用
2024-09-30	6.2.4	利率互换	人民币	不适用	自营-扣除折 扣率前	20999960024.75	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	自营-扣除 折扣率前	696923307.17	不适用	人民币外汇	美元	不适用	自营-扣除折 扣率前	3181169923.61	不适用	人民币外 汇	人民币	不适用	自营-扣除折 扣率前	123198588302.09	不适用	外币对	美元	不适用	自营-扣除折 扣率前	1000000.00	不适用
2024-09-30	6.2.4	利率互换	人民币	不适用	总额-扣除折 扣率后	29616565772.50	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	总额-扣除 折扣率后	791718071.79	不适用	人民币外汇	美元	不适用	总额-扣除折 扣率后	3201169965.28	不适用	人民币外 汇	人民币	不适用	总额-扣除折 扣率后	120463719002.39	不适用	外币对	美元	不适用	总额-扣除折 扣率后	1050000.00	不适用
2024-09-30	6.2.4	利率互换	人民币	不适用	总额-扣除折 扣率前	29616565772.50	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	总额-扣除 折扣率前	791718071.79	不适用	人民币外汇	美元	不适用	总额-扣除折 扣率前	3201169965.28	不适用	人民币外 汇	人民币	不适用	总额-扣除折 扣率前	126404741870.29	不适用	外币对	美元	不适用	总额-扣除折 扣率前	1050000.00	不适用
2024-09-30	6.2.5	利率互换	人民币	不适用	代理-扣除折 扣率后	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	代理-扣除 折扣率后	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	代理-扣除折 扣率后	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	代理-扣除折 扣率后	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.5	利率互换	人民币	不适用	代理-扣除折 扣率前	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	代理-扣除 折扣率前	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	代理-扣除折 扣率前	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	代理-扣除折 扣率前	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.5	利率互换	人民币	不适用	自营-扣除折 扣率后	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	自营-扣除 折扣率后	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	自营-扣除折 扣率后	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	自营-扣除折 扣率后	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.5	利率互换	人民币	不适用	自营-扣除折 扣率前	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	自营-扣除 折扣率前	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	自营-扣除折 扣率前	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	自营-扣除折 扣率前	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.5	利率互换	人民币	不适用	总额-扣除折 扣率后	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	总额-扣除 折扣率后	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	总额-扣除折 扣率后	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	总额-扣除折 扣率后	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.5	利率互换	人民币	不适用	总额-扣除折 扣率前	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	总额-扣除 折扣率前	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	总额-扣除折 扣率前	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	总额-扣除折 扣率前	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.6	利率互换	人民币	不适用	代理-扣除折 扣率后	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	代理-扣除 折扣率后	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	代理-扣除折 扣率后	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	代理-扣除折 扣率后	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.6	利率互换	人民币	不适用	代理-扣除折 扣率前	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	代理-扣除 折扣率前	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	代理-扣除折 扣率前	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	代理-扣除折 扣率前	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.6	利率互换	人民币	不适用	自营-扣除折 扣率后	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	自营-扣除 折扣率后	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	自营-扣除折 扣率后	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	自营-扣除折 扣率后	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.6	利率互换	人民币	不适用	自营-扣除折 扣率前	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	自营-扣除 折扣率前	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	自营-扣除折 扣率前	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	自营-扣除折 扣率前	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.6	利率互换	人民币	不适用	总额-扣除折 扣率后	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	总额-扣除 折扣率后	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	总额-扣除折 扣率后	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	总额-扣除折 扣率后	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.6	利率互换	人民币	不适用	总额-扣除折 扣率前	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	总额-扣除 折扣率前	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	总额-扣除折 扣率前	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	总额-扣除折 扣率前	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.7	利率互换	人民币	不适用	代理-扣除折 扣率后	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	代理-扣除 折扣率后	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	代理-扣除折 扣率后	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	代理-扣除折 扣率后	0.00	不适用						

披露日期	对应原则要点	报告等级标识	货币	CCP链接	描述	值	说明
2024-09-30	6.2.4	外币对	人民币	不适用	代理-扣除折扣率后	77132688.4	不适用
2024-09-30	6.2.4	外币对	人民币	不适用	代理-扣除折扣率前	80936714	不适用
2024-09-30	6.2.4	外币对	人民币	不适用	自营-扣除折扣率后	6964651344	不适用
2024-09-30	6.2.4	外币对	人民币	不适用	自营-扣除折扣率前	7308133624	不适用
2024-09-30	6.2.4	外币对	人民币	不适用	总额-扣除折扣率后	7041784032	不适用
2024-09-30	6.2.4	外币对	人民币	不适用	总额-扣除折扣率前	7389070338	不适用
2024-09-30	6.2.5						
2024-09-30	6.2.5						
2024-09-30	6.2.5						
2024-09-30	6.2.5						
2024-09-30	6.2.5						
2024-09-30	6.2.5						
2024-09-30	6.2.5						
2024-09-30	6.2.6						
2024-09-30	6.2.6						
2024-09-30	6.2.6						
2024-09-30	6.2.6						
2024-09-30	6.2.6						
2024-09-30	6.2.7						

披露日期	对应原则要点	报告等级标识8	货币8	CCP链接8	描述8	值8	说明8
2024-09-30	6.2.7						
2024-09-30	6.2.7						
2024-09-30	6.2.7						
2024-09-30	6.2.7						
2024-09-30	6.2.7						
2024-09-30	6.2.8						
2024-09-30	6.2.8						
2024-09-30	6.2.8						
2024-09-30	6.2.8						
2024-09-30	6.2.8						
2024-09-30	6.2.8						
2024-09-30	6.2.8						
2024-09-30	6.2.8						
2024-09-30	6.2.9						
2024-09-30	6.2.9						
2024-09-30	6.2.9						
2024-09-30	6.2.9						
2024-09-30	6.2.9						
2024-09-30	6.2.10						
2024-09-30	6.2.10						

披露日期	对应 原则 要点	报告等级标识 3	货币3	CCP链接3	描述3	值3	说明3	报告等级标识 4	货币 4	CCP链接4	描述4	值4	说明 4	报告等级标识 5	货币5	CCP链接5	描述5	值5	说明5	报告等 级标识 6	货币6	CCP链接 6	描述6	值6	说明6	报告等级 标识7	货币7	CCP链接7	描述7	值7	说明7
2024-09-30	6.2.10	利率互换	人民币	不适用	自营-扣除折 扣率后	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	自营-扣除 折扣率后	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	自营-扣除折 扣率后	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	自营-扣除折 扣率后	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.10	利率互换	人民币	不适用	自营-扣除折 扣率前	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	自营-扣除 折扣率前	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	自营-扣除折 扣率前	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	自营-扣除折 扣率前	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.10	利率互换	人民币	不适用	总额-扣除折 扣率后	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	总额-扣除 折扣率后	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	总额-扣除折 扣率后	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	总额-扣除折 扣率后	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.10	利率互换	人民币	不适用	总额-扣除折 扣率前	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	总额-扣除 折扣率前	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	总额-扣除折 扣率前	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	总额-扣除折 扣率前	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.11	利率互换	人民币	不适用	代理-扣除折 扣率后	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	代理-扣除 折扣率后	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	代理-扣除折 扣率后	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	代理-扣除折 扣率后	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.11	利率互换	人民币	不适用	代理-扣除折 扣率前	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	代理-扣除 折扣率前	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	代理-扣除折 扣率前	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	代理-扣除折 扣率前	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.11	利率互换	人民币	不适用	自营-扣除折 扣率后	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	自营-扣除 折扣率后	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	自营-扣除折 扣率后	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	自营-扣除折 扣率后	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.11	利率互换	人民币	不适用	自营-扣除折 扣率前	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	自营-扣除 折扣率前	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	自营-扣除折 扣率前	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	自营-扣除折 扣率前	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.11	利率互换	人民币	不适用	总额-扣除折 扣率后	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	总额-扣除 折扣率后	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	总额-扣除折 扣率后	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	总额-扣除折 扣率后	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.11	利率互换	人民币	不适用	总额-扣除折 扣率前	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	总额-扣除 折扣率前	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	总额-扣除折 扣率前	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	总额-扣除折 扣率前	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.12	利率互换	人民币	不适用	代理-扣除折 扣率后	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	代理-扣除 折扣率后	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	代理-扣除折 扣率后	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	代理-扣除折 扣率后	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.12	利率互换	人民币	不适用	代理-扣除折 扣率前	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	代理-扣除 折扣率前	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	代理-扣除折 扣率前	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	代理-扣除折 扣率前	0.00	不适用						

披露日期	对应原则要点	报告等级标识8	货币8	CCP链接8	描述8	值8	说明8
2024-09-30	6.2.10						
2024-09-30	6.2.10						
2024-09-30	6.2.10						
2024-09-30	6.2.10						
2024-09-30	6.2.11						
2024-09-30	6.2.11						
2024-09-30	6.2.11						
2024-09-30	6.2.11						
2024-09-30	6.2.11						
2024-09-30	6.2.11						
2024-09-30	6.2.12						
2024-09-30	6.2.12						

披露日期	对应 原则 要点	报告等级标识 3	货币3	CCP链接3	描述3	值3	说明3	报告等级标识 4	货币 4	CCP链接4	描述4	值4	说明 4	报告等级标识 5	货币5	CCP链接5	描述5	值5	说明5	报告等 级标识 6	货币6	CCP链接 6	描述6	值6	说明6	报告等级 标识7	货币7	CCP链接7	描述7	值7	说明7
2024-09-30	6.2.12	利率互换	人民币	不适用	自营-扣除折 扣率后	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	自营-扣除折 扣率后	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	自营-扣除折 扣率后	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	自营-扣除折 扣率后	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.12	利率互换	人民币	不适用	自营-扣除折 扣率前	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	自营-扣除折 扣率前	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	自营-扣除折 扣率前	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	自营-扣除折 扣率前	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.12	利率互换	人民币	不适用	总额-扣除折 扣率后	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	总额-扣除折 扣率后	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	总额-扣除折 扣率后	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	总额-扣除折 扣率后	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.12	利率互换	人民币	不适用	总额-扣除折 扣率前	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	总额-扣除折 扣率前	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	总额-扣除折 扣率前	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	总额-扣除折 扣率前	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.13	利率互换	人民币	不适用	代理-扣除折 扣率后	9379905.19	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	代理-扣除折 扣率后	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	代理-扣除折 扣率后	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	代理-扣除折 扣率后	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.13	利率互换	人民币	不适用	代理-扣除折 扣率前	9379905.19	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	代理-扣除折 扣率前	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	代理-扣除折 扣率前	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	代理-扣除折 扣率前	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.13	利率互换	人民币	不适用	自营-扣除折 扣率后	325883368.73	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	自营-扣除折 扣率后	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	自营-扣除折 扣率后	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	自营-扣除折 扣率后	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.13	利率互换	人民币	不适用	自营-扣除折 扣率前	471750993.69	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	自营-扣除折 扣率前	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	自营-扣除折 扣率前	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	自营-扣除折 扣率前	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.13	利率互换	人民币	不适用	总额-扣除折 扣率后	335263273.92	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	总额-扣除折 扣率后	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	总额-扣除折 扣率后	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	总额-扣除折 扣率后	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.13	利率互换	人民币	不适用	总额-扣除折 扣率前	481130898.88	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	总额-扣除折 扣率前	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	总额-扣除折 扣率前	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	总额-扣除折 扣率前	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.14	利率互换	人民币	不适用	代理-扣除折 扣率后	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	代理-扣除折 扣率后	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	代理-扣除折 扣率后	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	代理-扣除折 扣率后	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.14	利率互换	人民币	不适用	代理-扣除折 扣率前	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	代理-扣除折 扣率前	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	代理-扣除折 扣率前	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	代理-扣除折 扣率前	0.00	不适用						

披露日期	对应原则要点	报告等级标识8	货币8	CCP链接8	描述8	值8	说明8
2024-09-30	6.2.12						
2024-09-30	6.2.12						
2024-09-30	6.2.12						
2024-09-30	6.2.12						
2024-09-30	6.2.13						
2024-09-30	6.2.13						
2024-09-30	6.2.13						
2024-09-30	6.2.13						
2024-09-30	6.2.13						
2024-09-30	6.2.13						
2024-09-30	6.2.14						
2024-09-30	6.2.14						

披露日期	对应原则要点	披露条目	披露描述	数字格式	报告等级1	报告等级标识1	货币1	CCP链接1	描述1	值1	说明1	报告等级标识2	货币2	CCP链接2	描述2	值2	说明2
2024-09-30	6.2.14	对于每一项清算服务的初始保证金总额，分自营和代理	实际持有的初始保证金总额:非现金其他，分自营和代理，或自营和代理的总额（如果自营和代理业务的初始保证金没有分类独立核算）：扣除折扣率前及后	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	债券	人民币	不适用	自营-扣除折扣率后	0.00	不适用	大宗商品	人民币	不适用	自营-扣除折扣率后	0.00	不适用
2024-09-30	6.2.14	对于每一项清算服务的初始保证金总额，分自营和代理	实际持有的初始保证金总额:非现金其他，分自营和代理，或自营和代理的总额（如果自营和代理业务的初始保证金没有分类独立核算）：扣除折扣率前及后	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	债券	人民币	不适用	自营-扣除折扣率前	0.00	不适用	大宗商品	人民币	不适用	自营-扣除折扣率前	0.00	不适用
2024-09-30	6.2.14	对于每一项清算服务的初始保证金总额，分自营和代理	实际持有的初始保证金总额:非现金其他，分自营和代理，或自营和代理的总额（如果自营和代理业务的初始保证金没有分类独立核算）：扣除折扣率前及后	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	债券	人民币	不适用	总额-扣除折扣率后	0.00	不适用	大宗商品	人民币	不适用	总额-扣除折扣率后	0.00	不适用
2024-09-30	6.2.14	对于每一项清算服务的初始保证金总额，分自营和代理	实际持有的初始保证金总额:非现金其他，分自营和代理，或自营和代理的总额（如果自营和代理业务的初始保证金没有分类独立核算）：扣除折扣率前及后	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	债券	人民币	不适用	总额-扣除折扣率前	0.00	不适用	大宗商品	人民币	不适用	总额-扣除折扣率前	0.00	不适用
2024-09-30	6.2.15	对于每一项清算服务的初始保证金总额，分自营和代理	实际持有的初始保证金总额:持有的初始保证金总额，分自营和代理，或自营和代理的总额（如果自营和代理业务的初始保证金没有分类独立核算）	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	债券	人民币	不适用	代理-扣除折扣率后	5628263.06	不适用	大宗商品	人民币	不适用	代理-扣除折扣率后	48864571.46	不适用
2024-09-30	6.2.15	对于每一项清算服务的初始保证金总额，分自营和代理	实际持有的初始保证金总额:持有的初始保证金总额，分自营和代理，或自营和代理的总额（如果自营和代理业务的初始保证金没有分类独立核算）	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	债券	人民币	不适用	代理-扣除折扣率前	5628263.06	不适用	大宗商品	人民币	不适用	代理-扣除折扣率前	48864571.46	不适用
2024-09-30	6.2.15	对于每一项清算服务的初始保证金总额，分自营和代理	实际持有的初始保证金总额:持有的初始保证金总额，分自营和代理，或自营和代理的总额（如果自营和代理业务的初始保证金没有分类独立核算）	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	债券	人民币	不适用	自营-扣除折扣率后	1264400497.60	不适用	大宗商品	人民币	不适用	自营-扣除折扣率后	13738804.95	不适用
2024-09-30	6.2.15	对于每一项清算服务的初始保证金总额，分自营和代理	实际持有的初始保证金总额:持有的初始保证金总额，分自营和代理，或自营和代理的总额（如果自营和代理业务的初始保证金没有分类独立核算）	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	债券	人民币	不适用	自营-扣除折扣率前	1264400497.60	不适用	大宗商品	人民币	不适用	自营-扣除折扣率前	13738804.95	不适用
2024-09-30	6.2.15	对于每一项清算服务的初始保证金总额，分自营和代理	实际持有的初始保证金总额:持有的初始保证金总额，分自营和代理，或自营和代理的总额（如果自营和代理业务的初始保证金没有分类独立核算）	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	债券	人民币	不适用	总额-扣除折扣率后	1270028760.66	不适用	大宗商品	人民币	不适用	总额-扣除折扣率后	62603376.41	不适用
2024-09-30	6.2.15	对于每一项清算服务的初始保证金总额，分自营和代理	实际持有的初始保证金总额:持有的初始保证金总额，分自营和代理，或自营和代理的总额（如果自营和代理业务的初始保证金没有分类独立核算）	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	债券	人民币	不适用	总额-扣除折扣率前	1270028760.66	不适用	大宗商品	人民币	不适用	总额-扣除折扣率前	62603376.41	不适用

披露日期	对应 原则 要点	报告等级标识 3	货币3	CCP链接3	描述3	值3	说明3	报告等级标识 4	货币 4	CCP链接4	描述4	值4	说明 4	报告等级标识 5	货币5	CCP链接5	描述5	值5	说明5	报告等 级标识 6	货币6	CCP链接 6	描述6	值6	说明6	报告等级 标识7	货币7	CCP链接7	描述7	值7	说明7
2024-09-30	6.2.14	利率互换	人民币	不适用	自营-扣除折扣率后	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	自营-扣除折扣率后	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	自营-扣除折扣率后	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	自营-扣除折扣率后	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.14	利率互换	人民币	不适用	自营-扣除折扣率前	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	自营-扣除折扣率前	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	自营-扣除折扣率前	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	自营-扣除折扣率前	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.14	利率互换	人民币	不适用	总额-扣除折扣率后	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	总额-扣除折扣率后	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	总额-扣除折扣率后	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	总额-扣除折扣率后	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.14	利率互换	人民币	不适用	总额-扣除折扣率前	0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	总额-扣除折扣率前	0.00	不适用	人民币外汇	美元	不适用	总额-扣除折扣率前	0.00	不适用	外币对	美元	不适用	总额-扣除折扣率前	0.00	不适用						
2024-09-30	6.2.15	利率互换	人民币	不适用	代理-扣除折扣率后	8734215652.94	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	代理-扣除折扣率后	94794764.62	不适用	人民币外汇	美元	不适用	代理-扣除折扣率后	20000041.67	不适用	人民币外汇	人民币	不适用	代理-扣除折扣率后	3055464350.49	不适用	外币对	美元	不适用	代理-扣除折扣率后	50000.00	不适用
2024-09-30	6.2.15	利率互换	人民币	不适用	代理-扣除折扣率前	8734935652.94	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	代理-扣除折扣率前	94794764.62	不适用	人民币外汇	美元	不适用	代理-扣除折扣率前	20000041.67	不适用	人民币外汇	人民币	不适用	代理-扣除折扣率前	3206153568.20	不适用	外币对	美元	不适用	代理-扣除折扣率前	50000.00	不适用
2024-09-30	6.2.15	利率互换	人民币	不适用	自营-扣除折扣率后	28723533793.48	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	自营-扣除折扣率后	696923307.17	不适用	人民币外汇	美元	不适用	自营-扣除折扣率后	3181169923.61	不适用	人民币外汇	人民币	不适用	自营-扣除折扣率后	117408254651.89	不适用	外币对	美元	不适用	自营-扣除折扣率后	1000000.00	不适用
2024-09-30	6.2.15	利率互换	人民币	不适用	自营-扣除折扣率前	28988515418.44	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	自营-扣除折扣率前	696923307.17	不适用	人民币外汇	美元	不适用	自营-扣除折扣率前	3181169923.61	不适用	人民币外汇	人民币	不适用	自营-扣除折扣率前	123198588302.09	不适用	外币对	美元	不适用	自营-扣除折扣率前	1000000.00	不适用
2024-09-30	6.2.15	利率互换	人民币	不适用	总额-扣除折扣率后	37457749446.42	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	总额-扣除折扣率后	791718071.79	不适用	人民币外汇	美元	不适用	总额-扣除折扣率后	3201169965.28	不适用	人民币外汇	人民币	不适用	总额-扣除折扣率后	120463719002.39	不适用	外币对	美元	不适用	总额-扣除折扣率后	1050000.00	不适用
2024-09-30	6.2.15	利率互换	人民币	不适用	总额-扣除折扣率前	37723451071.38	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	总额-扣除折扣率前	791718071.79	不适用	人民币外汇	美元	不适用	总额-扣除折扣率前	3201169965.28	不适用	人民币外汇	人民币	不适用	总额-扣除折扣率前	126404741870.29	不适用	外币对	美元	不适用	总额-扣除折扣率前	1050000.00	不适用

披露日期	对应原则要点	报告等级标识8	货币8	CCP链接8	描述8	值8	说明8
2024-09-30	6. 2. 14						
2024-09-30	6. 2. 14						
2024-09-30	6. 2. 14						
2024-09-30	6. 2. 14						
2024-09-30	6. 2. 15	外币对	人民币	不适用	代理-扣除折扣率后	77132688.4	不适用
2024-09-30	6. 2. 15	外币对	人民币	不适用	代理-扣除折扣率前	80936714	不适用
2024-09-30	6. 2. 15	外币对	人民币	不适用	自营-扣除折扣率后	6964651344	不适用
2024-09-30	6. 2. 15	外币对	人民币	不适用	自营-扣除折扣率前	7308133624	不适用
2024-09-30	6. 2. 15	外币对	人民币	不适用	总额-扣除折扣率后	7041784032	不适用
2024-09-30	6. 2. 15	外币对	人民币	不适用	总额-扣除折扣率前	7389070338	不适用

披露日期	对应原则要点	披露条目	披露描述	数字格式	报告等级1	报告等级标识1	货币1	CCP链接1	描述1	值1	说明1	报告等级标识2	货币2	CCP链接2	描述2	值2	说明2	
2024-09-30	6.3.1	中央对手方设置的单个合约的初始保证金率	中央对手方设置的单个合约的初始保证金率	文本	清算服务	债券			不适用	不适用	不适用	大宗商品		不适用		不适用	不适用	
2024-09-30	6.4.1	对每个清算服务的初始保证金模型的类型（例如：模拟投资组合或风险整合）及其关键模型设计参数	初始保证金模型的类型	文本	清算服务	债券				VAR/HS	不适用	大宗商品		不适用		ES/HS	不适用	
2024-09-30	6.4.2	对每个清算服务的初始保证金模型的类型（例如：模拟投资组合或风险整合）及其关键模型设计参数	初始保证金模型的类型变化生效日期	ISO 8601 日期格式 年-月-日	清算服务	债券				2021-10-08	不适用	大宗商品		不适用		2020-07-13	不适用	
2024-09-30	6.4.3	对每个清算服务的初始保证金模型的类型（例如：模拟投资组合或风险整合）及其关键模型设计参数	初始保证金模型的名称	文本	清算服务	债券					VAR/HS	不适用	大宗商品		不适用	ES/HS	不适用	
2024-09-30	6.4.4	对每个清算服务的初始保证金模型的类型（例如：模拟投资组合或风险整合）及其关键模型设计参数	初始保证金模型的名称变化生效日期	ISO 8601 日期格式 年-月-日	清算服务	债券				2021/10/8	不适用	大宗商品		不适用		2020/7/13	不适用	
2024-09-30	6.4.5	对每个清算服务的初始保证金模型的类型（例如：模拟投资组合或风险整合）及其关键模型设计参数	单尾置信区间	数字，两位小数，百分比	清算服务	债券					99.50%	不适用	大宗商品		不适用		99.00%	不适用
2024-09-30	6.4.6	对每个清算服务的初始保证金模型的类型（例如：模拟投资组合或风险整合）及其关键模型设计参数	单尾置信区间变化生效日期	ISO 8601 日期格式 年-月-日	清算服务	债券					不适用	大宗商品		不适用		不适用	不适用	
2024-09-30	6.4.7	对每个清算服务的初始保证金模型的类型（例如：模拟投资组合或风险整合）及其关键模型设计参数	用于模型校准的样本回溯期	文本	清算服务	债券				500天	不适用	大宗商品		不适用		250天/全历史期限	不适用	
2024-09-30	6.4.8	对每个清算服务的初始保证金模型的类型（例如：模拟投资组合或风险整合）及其关键模型设计参数	用于模型校准的样本回溯期变化生效日期	ISO 8601 日期格式 年-月-日	清算服务	债券				2021-10-08	不适用	大宗商品		不适用		2020-07-13	不适用	
2024-09-30	6.4.9	对每个清算服务的初始保证金模型的类型（例如：模拟投资组合或风险整合）及其关键模型设计参数	对历史数据所做的调整	文本	清算服务	债券				不适用	不适用	大宗商品		不适用		不适用	不适用	
2024-09-30	6.4.10	对每个清算服务的初始保证金模型的类型（例如：模拟投资组合或风险整合）及其关键模型设计参数	对历史数据所做的调整生效日期	ISO 8601 日期格式 年-月-日	清算服务	债券				不适用	不适用	大宗商品		不适用		不适用	不适用	
2024-09-30	6.4.11	对每个清算服务的初始保证金模型的类型（例如：模拟投资组合或风险整合）及其关键模型设计参数	平仓天数	文本	清算服务	债券				3天	不适用	大宗商品		不适用		2天	不适用	
2024-09-30	6.4.12	对每个清算服务的初始保证金模型的类型（例如：模拟投资组合或风险整合）及其关键模型设计参数	平仓天数变化生效日期	ISO 8601 日期格式 年-月-日	清算服务	债券				不适用	不适用	大宗商品		不适用		不适用	不适用	
2024-09-30	6.4.13	对每个清算服务的初始保证金模型的类型（例如：模拟投资组合或风险整合）及其关键模型设计参数	如果使用风险加总模型，每个合约的保证金率和不同合约间相互抵消的细节	文本	清算服务	债券				不适用	不适用	大宗商品		不适用		组合保证金计算逻辑详见： https://www.shclearing.com.cn/ffa/scgg/202007/t20200710_709841.html	不适用	
2024-09-30	6.4.14	对每个清算服务的初始保证金模型的类型（例如：模拟投资组合或风险整合）及其关键模型设计参数	参数审查的频率	文本	清算服务	债券				每年	不适用	大宗商品		不适用		一周2次	不适用	
2024-09-30	6.4.15	对每个清算服务的初始保证金模型的类型（例如：模拟投资组合或风险整合）及其关键模型设计参数	参数审查的频率变化生效日期	ISO 8601 日期格式 年-月-日	清算服务	债券				2024-08-08	会员资信因子	大宗商品		https://www.shclearing.com.cn/cis/bzjyq/		保证金		
2024-09-30	6.5.1.1	初始保证金的回溯测试结果。最少应该包括每一个清算服务和针对每个清算服务的初始保证金模型的测试结果。	在过去的12个月，任一账户持有的保证金覆盖率低于该会员账户市值的次数，基于每日回溯测试结果	数字，整数	清算服务	债券				不适用	0	不适用	大宗商品		不适用	0	不适用	
2024-09-30	6.5.1.2	初始保证金的回溯测试结果。最少应该包括每一个清算服务和针对每个清算服务的初始保证金模型的测试结果。	每日回溯测试的频率	文本	清算服务	债券				1次	不适用	大宗商品		不适用		1次	不适用	
2024-09-30	6.5.1.3	初始保证金的回溯测试结果。最少应该包括每一个清算服务和针对每个清算服务的初始保证金模型的测试结果。	如果每天测试一次，回溯测试的具体时间	文本	清算服务	债券				日终	不适用	大宗商品		不适用		日终	不适用	
2024-09-30	6.5.2	初始保证金的回溯测试结果。最少应该包括每一个清算服务和针对每个清算服务的初始保证金模型的测试结果。	观察值的数量	数字，整数	清算服务	债券					22250	不适用	大宗商品		不适用	299	不适用	
2024-09-30	6.5.3	初始保证金的回溯测试结果。最少应该包括每一个清算服务和针对每个清算服务的初始保证金模型的测试结果。	达到的覆盖水平	数字，两位小数，百分比	清算服务	债券					100.00%	不适用	大宗商品		不适用	100.00%	不适用	
2024-09-30	6.5.4	初始保证金的回溯测试结果。最少应该包括每一个清算服务和针对每个清算服务的初始保证金模型的测试结果。	如有超出初始保证金覆盖范围的情况（如6.5.1.1所定义的）发生，需报告未被覆盖的敞口规模：峰值	数字，两位小数，货币单位	清算服务	债券	人民币		不适用		0.00	不适用	大宗商品	人民币	不适用		0.00	不适用
2024-09-30	6.5.5	初始保证金的回溯测试结果。最少应该包括每一个清算服务和针对每个清算服务的初始保证金模型的测试结果。	如有超出初始保证金覆盖范围的情况（如6.5.1.1所定义的）发生，需报告未被覆盖的风险规模：平均值	数字，两位小数，货币单位	清算服务	债券	人民币		不适用		0.00	不适用	大宗商品	人民币	不适用		0.00	不适用
2024-09-30	6.6.1	每一业务的清算参与者付给中央对手方的总变动保证金的均值	每个工作日付给中央对手方的总变动保证金的均值	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币		不适用	4660983891.60	不适用							
2024-09-30	6.7.1	一段时期内某天支付给中央对手方的总变动保证金的最大值	一段时期内某天支付给中央对手方的总变动保证金的最大值	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币		不适用	27162787655.47	不适用							
2024-09-30	6.8.1	一段时期内某天初始保证金追加的最大值	一段时期内某天初始保证金追加的最大值	数字，两位小数，货币单位	违约基金	债券	人民币		不适用	5850000.00	不适用	大宗商品	人民币	不适用		18000.00	不适用	

披露日期	对应原则要点	报告等级标识3	货币3	CCP链接3	描述3	值3	说明3	报告等级标识4	货币4	CCP链接4	描述4	值4	说明4	报告等级标识5	货币5	CCP链接5	描述5	值5	说明5	报告等级标识6	货币6	CCP链接6	描述6	值6	说明6	报告等级标识7	货币7	CCP链接7	描述7	值7	说明7	
2024-09-30	6.3.1	利率互换		不适用		不适用	不适用	标准债券远期		不适用		不适用	不适用	人民币外汇		不适用		不适用	不适用	外币对		不适用		不适用	不适用							
2024-09-30	6.4.1	利率互换		不适用		VAR/HS	不适用	标准债券远期		不适用		VAR/HS	不适用	人民币外汇		不适用		ES/HS	不适用	外币对		不适用		ES/FHS	不适用							
2024-09-30	6.4.2	利率互换		不适用		不适用	不适用	标准债券远期		不适用		不适用	不适用	人民币外汇		不适用		不适用	不适用	外币对		不适用		不适用	不适用							
2024-09-30	6.4.3	利率互换		不适用		VAR/HS	不适用	标准债券远期		不适用		VAR/HS	不适用	人民币外汇		不适用		ES/HS	不适用	外币对		不适用		ES/FHS	不适用							
2024-09-30	6.4.4	利率互换		不适用		不适用	不适用	标准债券远期		不适用		不适用	不适用	人民币外汇		不适用		不适用	不适用	外币对		不适用		不适用	不适用							
2024-09-30	6.4.5	利率互换		不适用		99.50%	不适用	标准债券远期		不适用		99.50%	不适用	人民币外汇		不适用		99.00%	不适用	外币对		不适用		99.50%	不适用							
2024-09-30	6.4.6	利率互换		不适用		不适用	不适用	标准债券远期		不适用		不适用	不适用	人民币外汇		不适用		不适用	不适用	外币对		不适用		不适用	不适用							
2024-09-30	6.4.7	利率互换		不适用		250天	不适用	标准债券远期		不适用		250天	不适用	人民币外汇		不适用		500天	不适用	外币对		不适用		2500天	不适用							
2024-09-30	6.4.8	利率互换		不适用		不适用	不适用	标准债券远期		不适用		不适用	不适用	人民币外汇		不适用		不适用	不适用	外币对		不适用		不适用	不适用							
2024-09-30	6.4.9	利率互换		不适用		不适用	不适用	标准债券远期		不适用		不适用	不适用	人民币外汇		不适用		不适用	不适用	外币对		不适用		不适用	不适用							
2024-09-30	6.4.10	利率互换		不适用		不适用	不适用	标准债券远期		不适用		不适用	不适用	人民币外汇		不适用		不适用	不适用	外币对		不适用		不适用	不适用							
2024-09-30	6.4.11	利率互换		不适用		10天	不适用	标准债券远期		不适用		2天	不适用	人民币外汇		不适用		5天	不适用	外币对		不适用		5天	不适用							
2024-09-30	6.4.12	利率互换		不适用		不适用	不适用	标准债券远期		不适用		不适用	不适用	人民币外汇		不适用		不适用	不适用	外币对		不适用		不适用	不适用							
2024-09-30	6.4.13	利率互换		不适用		不适用	不适用	标准债券远期		不适用		不适用	不适用	人民币外汇		不适用		不适用	不适用	外币对		不适用		不适用	不适用							
2024-09-30	6.4.14	利率互换		不适用		每年	不适用	标准债券远期		不适用		每季度	不适用	人民币外汇		不适用		每年	不适用	外币对		不适用		每年	不适用							
2024-09-30	6.4.15	利率互换		不适用		2024-08-08	会员资信因子	标准债券远期		https://www.shclearing.com.cn/cpyw/fxgl/			保证金	人民币外汇		不适用		2024-08-08	会员资信因子	外币对		不适用		2024-08-08	会员资信因子							
2024-09-30	6.5.1.1	利率互换		不适用		0	不适用	标准债券远期		不适用		2	不适用	人民币外汇		不适用		0	不适用	外币对		不适用		0	不适用							
2024-09-30	6.5.1.2	利率互换		不适用		1次	不适用	标准债券远期		不适用		1次	不适用	人民币外汇		不适用		1次	不适用	外币对		不适用		1次	不适用							
2024-09-30	6.5.1.3	利率互换		不适用		日终	不适用	标准债券远期		不适用		日终	不适用	人民币外汇		不适用		日终	不适用	外币对		不适用		日终	不适用							
2024-09-30	6.5.2	利率互换		不适用		59000	不适用	标准债券远期		不适用		4632	不适用	人民币外汇		不适用		22250	不适用	外币对		不适用		9000	不适用							
2024-09-30	6.5.3	利率互换		不适用		100.00%	不适用	标准债券远期		不适用		99.96%	不适用	人民币外汇		不适用		100.00%	不适用	外币对		不适用		100.00%	不适用							
2024-09-30	6.5.4	利率互换	人民币	不适用		0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用		5831359.65	不适用	人民币外汇	美元	不适用		0.00	不适用	外币对	美元	不适用		0.00	不适用							
2024-09-30	6.5.5	利率互换	人民币	不适用		0.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用		2957328.33	不适用	人民币外汇	美元	不适用		0.00	不适用	外币对	美元	不适用		0.00	不适用							
2024-09-30	6.6.1																															
2024-09-30	6.7.1																															
2024-09-30	6.8.1	利率互换	人民币	不适用		411994803.44	不适用	标准债券远期	人民币	不适用		99450029.42	不适用	人民币外汇	美元	不适用		675600492.00	不适用	外币对	美元	不适用		218189388.00	不适用							

披露日期	对应原则要点	报告等级标识8	货币8	CCP链接8	描述8	值8	说明8
2024-09-30	6.3.1						
2024-09-30	6.4.1						
2024-09-30	6.4.2						
2024-09-30	6.4.3						
2024-09-30	6.4.4						
2024-09-30	6.4.5						
2024-09-30	6.4.6						
2024-09-30	6.4.7						
2024-09-30	6.4.8						
2024-09-30	6.4.9						
2024-09-30	6.4.10						
2024-09-30	6.4.11						
2024-09-30	6.4.12						
2024-09-30	6.4.13						
2024-09-30	6.4.14						
2024-09-30	6.4.15						
2024-09-30	6.5.1.1						
2024-09-30	6.5.1.2						
2024-09-30	6.5.1.3						
2024-09-30	6.5.2						
2024-09-30	6.5.3						
2024-09-30	6.5.4						
2024-09-30	6.5.5						
2024-09-30	6.6.1						
2024-09-30	6.7.1						
2024-09-30	6.8.1						

披露日期	对应原则要点	披露条目	披露描述	数字格式	报告等级1	报告等级标识1	货币1	CCP链接1	描述1	值1	说明1	报告等级标识2	货币2	CCP链接2	描述2	值2	说明2
2024-09-30	7.1.1	流动性风险	陈述清算服务是否有足够的流动性资源以应对一家还是两家最大的清算会员的倒闭	文本	中央对手方	上海清算所		不适用		cover1	不适用						
2024-09-30	7.1.2	流动性风险	合格流动性资源：（a）存放在发行相关货币的中央银行里的现金存款	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	合格流动性资源的规模和组	0.00	不适用						
2024-09-30	7.1.2	流动性风险	合格流动性资源：（a）存放在发行相关货币的中央银行里的现金存款	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	美元	不适用	合格流动性资源的规模和组	0.00	不适用						
2024-09-30	7.1.3	流动性风险	合格流动性资源：（b）存放在其他中央银行的现金存款	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	合格流动性资源的规模和组	0.00	不适用						
2024-09-30	7.1.3	流动性风险	合格流动性资源：（b）存放在其他中央银行的现金存款	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	美元	不适用	合格流动性资源的规模和组	0.00	不适用						
2024-09-30	7.1.4	流动性风险	合格流动性资源：（c）存放在商业银行里的担保资金（包括逆回购）	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	合格流动性资源的规模和组	0.00	不适用						
2024-09-30	7.1.4	流动性风险	合格流动性资源：（c）存放在商业银行里的担保资金（包括逆回购）	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	美元	不适用	合格流动性资源的规模和组	0.00	不适用						
2024-09-30	7.1.5	流动性风险	合格流动性资源：（d）存放在商业银行里的无担保资金	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	合格流动性资源的规模和组	0.00	不适用						
2024-09-30	7.1.5	流动性风险	合格流动性资源：（d）存放在商业银行里的无担保资金	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	美元	不适用	合格流动性资源的规模和组	0.00	不适用						
2024-09-30	7.1.6	流动性风险	合格流动性资源：（e）有担保的承诺的信用额度（例如，提取时由中央对手方提供抵押品/证券）包括承诺的人民币外汇掉期和承诺的回购	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	合格流动性资源的规模和组成	0.00	不适用						
2024-09-30	7.1.6	流动性风险	合格流动性资源：（e）有担保的承诺的信用额度（例如，提取时由中央对手方提供抵押品/证券）包括承诺的人民币外汇掉期和承诺的回购	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	美元	不适用	合格流动性资源的规模和组成	0.00	不适用						
2024-09-30	7.1.7	流动性风险	合格流动性资源：（f）无担保的承诺的信用额度（例如，提取时中央对手方不提供抵押品/证券）	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	合格流动性资源的规模和组成	79500000000.00	不适用						
2024-09-30	7.1.7	流动性风险	合格流动性资源：（f）无担保的承诺的信用额度（例如，提取时中央对手方不提供抵押品/证券）	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	美元	不适用	合格流动性资源的规模和组成	3500000000.00	不适用						
2024-09-30	7.1.8	流动性风险	合格流动性资源：（g）流动性非常好的托管中的抵押品以及经过预先安排并且有高度可靠资金安排、即便在极端但合理的市场条件下也容易变现	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	合格流动性资源的规模和组成	0.00	不适用						
2024-09-30	7.1.8	流动性风险	合格流动性资源：（g）流动性非常好的托管中的抵押品以及经过预先安排并且有高度可靠资金安排、即便在极端但合理的市场条件下也容易变现	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	美元	不适用	合格流动性资源的规模和组成	0.00	不适用						
2024-09-30	7.1.9	流动性风险	合格流动性资源：（h）其他	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	合格流动性资源的规模和组	0.00	不适用						
2024-09-30	7.1.9	流动性风险	合格流动性资源：（h）其他	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	美元	不适用	合格流动性资源的规模和组	0.00	不适用						
2024-09-30	7.1.10	流动性风险	说明中央对手方是否能够例行使用中央银行流动性资金或贷款	文本	中央对手方	上海清算所		不适用		上海清算所正在研究探讨从央行获取流动性的可行性。	不适用						
2024-09-30	7.1.11	流动性风险	如果在使用合格流动性资源过程中，中央对手方按照要求或者经允许优先考虑满足部分付款义务，请提供：付款计划表或付款分派优先级（如果有）；做出此类决策所适用的规则、政策和管理安排等	文本	中央对手方	上海清算所		不适用		受影响机构数最小的原则制定优先支付规则，一般按照未违约会员应收金额从大到小排列被延迟交付优先级。	不适用						
2024-09-30	7.2.1	在合格流动性资源基础上补充的流动性风险资源的规模和构成	在合格流动性资源基础上补充的流动性风险资源的规模和构成	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用		0.00	不适用						
2024-09-30	7.3.1	流动性风险	对各项清算业务，在极端但合理的市场条件下单个参与者造成的单日最大付款义务的估计值，包括代理清算；前瞻性的估计值	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	单日付款总额	133978988004.57	不适用						

披露日期	对应 原则 要点	报告等级标识 3	货币3	CCP链接3	描述3	值3	说明3	报告等级标识 4	货币 4	CCP链 接4	描述4	值4	说明 4	报告等级标识 5	货币5	CCP链接5	描述5	值5	说明5	报告等 级标识 6	货币6	CCP链接 6	描述6	值6	说明6	报告等级 标识7	货币7	CCP链接7	描述7	值7	说明7
2024-09-30	7.1.1																														
2024-09-30	7.1.2																														
2024-09-30	7.1.2																														
2024-09-30	7.1.3																														
2024-09-30	7.1.3																														
2024-09-30	7.1.4																														
2024-09-30	7.1.4																														
2024-09-30	7.1.5																														
2024-09-30	7.1.5																														
2024-09-30	7.1.6																														
2024-09-30	7.1.6																														
2024-09-30	7.1.7																														
2024-09-30	7.1.7																														
2024-09-30	7.1.8																														
2024-09-30	7.1.8																														
2024-09-30	7.1.9																														
2024-09-30	7.1.9																														
2024-09-30	7.1.10																														
2024-09-30	7.1.11																														
2024-09-30	7.2.1																														
2024-09-30	7.3.1																														

披露日期	对应原则要点	报告等级标识8	货币8	CCP链接8	描述8	值8	说明8
2024-09-30	7.1.1						
2024-09-30	7.1.2						
2024-09-30	7.1.2						
2024-09-30	7.1.3						
2024-09-30	7.1.3						
2024-09-30	7.1.4						
2024-09-30	7.1.4						
2024-09-30	7.1.5						
2024-09-30	7.1.5						
2024-09-30	7.1.6						
2024-09-30	7.1.6						
2024-09-30	7.1.7						
2024-09-30	7.1.7						
2024-09-30	7.1.8						
2024-09-30	7.1.8						
2024-09-30	7.1.9						
2024-09-30	7.1.9						
2024-09-30	7.1.10						
2024-09-30	7.1.11						
2024-09-30	7.2.1						
2024-09-30	7.3.1						

披露日期	对应原则要点	披露条目	披露描述	数字格式	报告等级1	报告等级标识1	货币1	CCP链接1	描述1	值1	说明1	报告等级标识2	货币2	CCP链接2	描述2	值2	说明2
2024-09-30	7.3.1	流动性风险	对各项清算业务，在极端但合理的市场条件下单个参与者造成的单日最大付款义务的估计值，包括代理清算；前瞻性的估计值	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	多日付款	175276603006.71	不适用						
2024-09-30	7.3.2	流动性风险	上述金额超过合格流动性资源的工作日数	数字，整数	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用		0	不适用						
2024-09-30	7.3.3	流动性风险	上述金额超过合格流动性资源的超过的金额大小	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	超出数量	不适用	不适用						
2024-09-30	7.3.4	流动性风险	对各项清算业务，过去12个月中，单个清算会员及其客户违约造成的单日最大付款义务的实际值；过去12个月的单日最大值	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	单日付款总额	63671185444.95	不适用						
2024-09-30	7.3.4	流动性风险	对各项清算业务，过去12个月中，单个清算会员及其客户违约造成的单日最大付款义务的实际值；过去12个月的单日最大值	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	多日付款	98157502458.37	不适用						
2024-09-30	7.3.5	流动性风险	在极端但合理的市场条件下单个清算会员及其客户违约造成的单日最大付款义务的估计值，按币种分：前瞻性的估计值	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	单日付款	133115251698.53	不适用						
2024-09-30	7.3.5	流动性风险	在极端但合理的市场条件下单个清算会员及其客户违约造成的单日最大付款义务的估计值，按币种分：前瞻性的估计值	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	美元	不适用	单日付款	5818996752.26	不适用						
2024-09-30	7.3.5	流动性风险	在极端但合理的市场条件下单个清算会员及其客户违约造成的单日最大付款义务的估计值，按币种分：前瞻性的估计值	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	英镑	不适用	单日付款	243800000.00	不适用						
2024-09-30	7.3.5	流动性风险	在极端但合理的市场条件下单个清算会员及其客户违约造成的单日最大付款义务的估计值，按币种分：前瞻性的估计值	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	日元	不适用	单日付款	115697231950.00	不适用						
2024-09-30	7.3.5	流动性风险	在极端但合理的市场条件下单个清算会员及其客户违约造成的单日最大付款义务的估计值，按币种分：前瞻性的估计值	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	欧元	不适用	单日付款	753700000.00	不适用						
2024-09-30	7.3.5	流动性风险	在极端但合理的市场条件下单个清算会员及其客户违约造成的单日最大付款义务的估计值，按币种分：前瞻性的估计值	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	澳元	不适用	单日付款	150000000.00	不适用						
2024-09-30	7.3.5	流动性风险	在极端但合理的市场条件下单个清算会员及其客户违约造成的单日最大付款义务的估计值，按币种分：前瞻性的估计值	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	港币	不适用	单日付款	3831975870.00	不适用						
2024-09-30	7.3.6	流动性风险	按币种分。上述金额超过合格流动性资源的工作日数，及超出金额的大小；季度中的天数	数字，整数	中央对手方	上海清算所		不适用	天数	不适用	不适用						
2024-09-30	7.3.7	流动性风险	按币种分，上述金额超过合格流动性资源的工作日数，及超出金额的大小；超过的金额大小	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	超出数量	不适用	不适用						

披露日期	对应原则要点	报告等级标识3	货币3	CCP链接3	描述3	值3	说明3	报告等级标识4	货币4	CCP链接4	描述4	值4	说明4	报告等级标识5	货币5	CCP链接5	描述5	值5	说明5	报告等级标识6	货币6	CCP链接6	描述6	值6	说明6	报告等级标识7	货币7	CCP链接7	描述7	值7	说明7
2024-09-30	7.3.1																														
2024-09-30	7.3.2																														
2024-09-30	7.3.3																														
2024-09-30	7.3.4																														
2024-09-30	7.3.4																														
2024-09-30	7.3.5																														
2024-09-30	7.3.5																														
2024-09-30	7.3.5																														
2024-09-30	7.3.5																														
2024-09-30	7.3.5																														
2024-09-30	7.3.5																														
2024-09-30	7.3.5																														
2024-09-30	7.3.5																														
2024-09-30	7.3.6																														
2024-09-30	7.3.7																														

披露日期	对应原则要点	报告等级标识8	货币8	CCP链接8	描述8	值8	说明8
2024-09-30	7.3.1						
2024-09-30	7.3.2						
2024-09-30	7.3.3						
2024-09-30	7.3.4						
2024-09-30	7.3.4						
2024-09-30	7.3.5						
2024-09-30	7.3.5						
2024-09-30	7.3.5						
2024-09-30	7.3.5						
2024-09-30	7.3.5						
2024-09-30	7.3.5						
2024-09-30	7.3.5						
2024-09-30	7.3.6						
2024-09-30	7.3.7						

披露日期	对应 原则 要点	披露条目	披露描述	数字格式	报告等级1	报告等级标识1	货币1	CCP链接1	描述1	值1	说明1	报告等级标识2	货币2	CCP链接2	描述2	值2	说明2
2024-09-30	12.1.1	DvP, DvD or PvP结算方式结算金额的占比	DvP结算方式结算金额的占比	数字，两位小数，百分比	违约基金	债券		不适用		6.11%	不适用	大宗商品		不适用		0.00%	不适用
2024-09-30	12.1.2	DvP, DvD or PvP结算方式结算金额的占比	DvD结算方式结算金额的占比	数字，两位小数，百分比	违约基金	债券		不适用		0.00%	不适用	大宗商品		不适用		0.00%	不适用
2024-09-30	12.1.3	DvP, DvD or PvP结算方式结算金额的占比	PvP结算方式结算金额的占比	数字，两位小数，百分比	违约基金	债券		不适用		0.00%	不适用	大宗商品		不适用		0.01%	不适用
2024-09-30	12.2.1	DvP, DvD or PvP结算方式结算量的占比	DvP结算方式结算量的占比	数字，两位小数，百分比	违约基金	债券		不适用		0.45%	不适用	大宗商品		不适用		0.00%	不适用
2024-09-30	12.2.2	DvP, DvD or PvP结算方式结算量的占比	DvD结算方式结算量的占比	数字，两位小数，百分比	违约基金	债券		不适用		0.00%	不适用	大宗商品		不适用		0.00%	不适用
2024-09-30	12.2.3	DvP, DvD or PvP结算方式结算量的占比	PvP结算方式结算量的占比	数字，两位小数，百分比	违约基金	债券		不适用		0.00%	不适用	大宗商品		不适用		0.01%	不适用
2024-09-30	13.1.1	与违约相关的量化信息	与违约相关的量化信息：损失金额与初始保证金	文本	违约基金	债券		不适用		不适用	不适用	大宗商品		不适用		不适用	不适用
2024-09-30	13.1.2	与违约相关的量化信息	与违约相关的量化信息：其它用于覆盖损失的资金资源金额	文本	违约基金	债券		不适用		不适用	不适用	大宗商品		不适用		不适用	不适用
2024-09-30	13.1.3.1	与违约相关的量化信息	与违约相关的量化信息：客户头寸平仓的比例	文本	违约基金	债券		不适用		不适用	不适用	大宗商品		不适用		不适用	不适用
2024-09-30	13.1.3.2	与违约相关的量化信息	与违约相关的量化信息：客户头寸移仓的比例	文本	违约基金	债券		不适用		不适用	不适用	大宗商品		不适用		不适用	不适用
2024-09-30	13.1.4	与违约相关的量化信息	与违约相关的量化信息：其他与违约相关的公开材料	文本	违约基金	债券		不适用		不适用	不适用	大宗商品		不适用		不适用	不适用
2024-09-30	14.1.1	作为清算总值或证券交易结算价值的一部分的客户头寸总数	单一账户中持有的客户头寸总数	数字，两位小数，百分比	违约基金	债券		不适用		100.00%	不适用	大宗商品		不适用		100.00%	不适用
2024-09-30	14.1.2	作为清算总值或证券交易结算价值的一部分的客户头寸总数	客户专用综合账户，不包括法律上分离但操作上混合的账户（LSOC），中持有的客户头寸总数	数字，两位小数，百分比	违约基金	债券		不适用		0.00%	不适用	大宗商品		不适用		0.00%	不适用
2024-09-30	14.1.3	作为清算总值或证券交易结算价值的一部分的客户头寸总数	法律上分离但操作上混合的账户（LSOC）中持有的客户头寸总数	数字，两位小数，百分比	违约基金	债券		不适用		0.00%	不适用	大宗商品		不适用		0.00%	不适用
2024-09-30	14.1.4	作为清算总值或证券交易结算价值的一部分的客户头寸总数	混合的自营和代理账户中持有的客户头寸总数	数字，两位小数，百分比	违约基金	债券		不适用		0.00%	不适用	大宗商品		不适用		0.00%	不适用
2024-09-30	15.1.1	一般业务风险	流动性高的所有者权益	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用		19251273535.44	不适用						
2024-09-30	15.1.2	一般业务风险	6个月短期运营费用	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用		951493974.26	不适用						
2024-09-30	15.2.1	一般业务风险：财务披露	总收入	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用		5374216922.46	不适用						
2024-09-30	15.2.2	一般业务风险：财务披露	总支出	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用		1905355312.60	不适用						
2024-09-30	15.2.3	一般业务风险：财务披露	利润	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用		2397089393.94	不适用						
2024-09-30	15.2.4	一般业务风险：财务披露	资产总额	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用		169160875495.45	不适用						
2024-09-30	15.2.5	一般业务风险：财务披露	负债总额	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用		149909601960.01	不适用						
2024-09-30	15.2.6	一般业务风险：财务披露	说明清算会员提交的抵押品是否在资产负债表上	文本	中央对手方	上海清算所		不适用		现金抵押品在财务报表内，非现金抵押品在财务报表外	不适用						
2024-09-30	15.2.7	一般业务风险：财务披露	补充事项	文本	中央对手方	上海清算所		不适用		不适用	不适用						
2024-09-30	15.3.1	一般业务风险：收入明细	清算业务的收入占总收入的百分比	数字，两位小数，百分比	中央对手方	上海清算所		不适用		不适用	不适用						
2024-09-30	15.3.2	一般业务风险：收入明细	抵押品再投资（或再抵押）的收入占总收入的百分比	数字，两位小数，百分比	中央对手方	上海清算所		不适用		不适用	不适用						
2024-09-30	16.1.1	从参与者处获得的现金（不包括证券）总额，无论是不论是持有还是存款或是投资中的现金。按照其目的是作为初始保证金还是违约基金分类。	从清算参与者处收到的作为初始保证金的现金总额（不包括证券），不论是持有还是存款或是投资中的现金。	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用		165534728189.54	不适用						
2024-09-30	16.1.2	从参与者处获得的现金（不包括证券）总额，无论是不论是持有还是存款或是投资中的现金。按照其目的是作为初始保证金还是违约基金分类。	从清算参与者处收到的作为违约基金的现金总额（不包括证券），不论是持有还是存款或是投资中的现金。	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用		36224150000.00	不适用						
2024-09-30	16.2.1	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	从清算参与者处收到的现金中以现金存款形式（包括反向回购）持有的百分比	数字，两位小数，百分比	中央对手方	上海清算所		不适用		100.00%	不适用						
2024-09-30	16.2.2	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	其中，存放在发行相关货币的中央银行里的现金存款的百分比	数字，两位小数，百分比	中央对手方	上海清算所		不适用		0.00%	不适用						
2024-09-30	16.2.3	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	其中，存放在其他中央银行的现金存款的百分比	数字，两位小数，百分比	中央对手方	上海清算所		不适用		0.00%	不适用						
2024-09-30	16.2.4	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	其中，存放在商业银行的现金存款（有担保，包括通过逆回购）的百分比	数字，两位小数，百分比	中央对手方	上海清算所		不适用		0.00%	不适用						
2024-09-30	16.2.5	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	其中，存放在商业银行的现金存款（无担保）的百分比	数字，两位小数，百分比	中央对手方	上海清算所		不适用		100.00%	不适用						
2024-09-30	16.2.6	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	其中，存放在货币市场基金的百分比	数字，两位小数，百分比	中央对手方	上海清算所		不适用		0.00%	不适用						
2024-09-30	16.2.7	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	其中，其他形式（请说明）的百分比	数字，两位小数，百分比	中央对手方	上海清算所		不适用		0.00%	不适用						
2024-09-30	16.2.8	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	将16.2.1所述现金存款按照币种（包括反向回购）与货币市场基金的百分比分-本国货币、美元、欧元。	数字，两位小数，百分比	中央对手方	上海清算所		不适用	百分比-人民币	76.64%	不适用						

披露日期	对应原则要点	报告等级标识8	货币8	CCP链接8	描述8	值8	说明8
2024-09-30	12. 1. 1						
2024-09-30	12. 1. 2						
2024-09-30	12. 1. 3						
2024-09-30	12. 2. 1						
2024-09-30	12. 2. 2						
2024-09-30	12. 2. 3						
2024-09-30	13. 1. 1						
2024-09-30	13. 1. 2						
2024-09-30	13. 1. 3.						
2024-09-30	13. 1. 3.						
2024-09-30	13. 1. 4						
2024-09-30	14. 1. 1						
2024-09-30	14. 1. 2						
2024-09-30	14. 1. 3						
2024-09-30	14. 1. 4						
2024-09-30	15. 1. 1						
2024-09-30	15. 1. 2						
2024-09-30	15. 2. 1						
2024-09-30	15. 2. 2						
2024-09-30	15. 2. 3						
2024-09-30	15. 2. 4						
2024-09-30	15. 2. 5						
2024-09-30	15. 2. 6						
2024-09-30	15. 2. 7						
2024-09-30	15. 3. 1						
2024-09-30	15. 3. 2						
2024-09-30	16. 1. 1						
2024-09-30	16. 1. 2						
2024-09-30	16. 2. 1						
2024-09-30	16. 2. 2						
2024-09-30	16. 2. 3						
2024-09-30	16. 2. 4						
2024-09-30	16. 2. 5						
2024-09-30	16. 2. 6						
2024-09-30	16. 2. 7						
2024-09-30	16. 2. 8						

披露日期	对应原则要点	披露条目	披露描述	数字格式	报告等级1	报告等级标识1	货币1	CCP链接1	描述1	值1	说明1	报告等级标识2	货币2	CCP链接2	描述2	值2	说明2
2024-09-30	16.2.8	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	将16.2.1所述现金存款按照币种（包括反向回购）与货币市场基金的百分比分-本国货币、美元、欧元。	数字，两位小数，百分比	中央对手方	上海清算所		不适用	百分比-美元	23.36%	不适用						
2024-09-30	16.2.9	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	16.2.1所述现金存款的加权平均期限	数字，两位小数	中央对手方	上海清算所		不适用		263.42	不适用						
2024-09-30	16.2.10	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	从清算参与者处收到的现金中投资于证券的比例：本国政府主权债券	数字，两位小数，百分比	中央对手方	上海清算所		不适用		0.00%	不适用						
2024-09-30	16.2.11	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	从清算参与者处收到的现金中投资于证券的比例：他国政府主权债券	数字，两位小数，百分比	中央对手方	上海清算所		不适用		0.00%	不适用						
2024-09-30	16.2.12	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	从清算参与者处收到的现金中投资于证券的比例：机构债券	数字，两位小数，百分比	中央对手方	上海清算所		不适用		0.00%	不适用						
2024-09-30	16.2.13	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	从清算参与者处收到的现金中投资于证券的比例：州或政府公债	数字，两位小数，百分比	中央对手方	上海清算所		不适用		0.00%	不适用						
2024-09-30	16.2.14	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	从清算参与者处收到的现金中投资于证券的比例：其他工具	数字，两位小数，百分比	中央对手方	上海清算所		不适用		0.00%	不适用						
2024-09-30	16.2.15	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	从清算参与者处收到的现金中投资于证券的比例：按币种分	数字，两位小数，百分比	中央对手方	上海清算所		不适用	百分比-人民币	0.00%	不适用						
2024-09-30	16.2.15	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	从清算参与者处收到的现金中投资于证券的比例：按币种分	数字，两位小数，百分比	中央对手方	上海清算所		不适用	百分比-美元	0.00%	不适用						
2024-09-30	16.2.16	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	以上证券的加权平均期限	数字，两位小数	中央对手方	上海清算所		不适用		不适用	不适用						
2024-09-30	16.2.17	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	对以上投资证券组合的风险的估计值（不包括中央银行和商业银行存款）（99%一日VaR或等价指标）	文本	中央对手方	上海清算所		不适用		不适用	不适用						
2024-09-30	16.2.18	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	说明中央对手方的投资策略是否对可能分配给单一对手方的投资证券组合比例设定上限，并说明上限的规模	文本	中央对手方	上海清算所		不适用		不适用	不适用						
2024-09-30	16.2.19	从清算参与者处收到的现金（16.1）以何种方式持有、存放或投资	说明上一季度这一上限被突破的次数	数字，整数	中央对手方	上海清算所		不适用		不适用	不适用						
2024-09-30	16.2.20	从清算参与者处收到的现金（16.2）以何种方式持有、存放或投资	从清算参与者处收到的现金中以证券形式持有的百分比	数字，两位小数，百分比	中央对手方	上海清算所		不适用		0.00%	不适用						
2024-09-30	16.3.1	清算参与者资产（非现金）的再抵押	清算参与者资产（非现金）是否允许再抵押，如果是的话，提供初始保证金再抵押的金额	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用		不适用	不适用						
2024-09-30	16.3.2	清算参与者资产（非现金）的再抵押	清算参与者资产（非现金）是否允许再抵押，如果是的话，提供清算基金再抵押的金额	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用		不适用	不适用						
2024-09-30	16.3.3	清算参与者资产（非现金）的再抵押	再抵押的初始保证金的期限分布：隔夜/一天；一天以上到最多一周；一周以上到最多一个月；一个月以上到最多一年；一年以上到最多两年；两	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	一天以上到最多一周；	不适用	不适用						
2024-09-30	16.3.3	清算参与者资产（非现金）的再抵押	再抵押的初始保证金的期限分布：隔夜/一天；一天以上到最多一周；一周以上到最多一个月；一个月以上到最多一年；一年以上到最多两年；两	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	一个月以上到最多一年；	不适用	不适用						
2024-09-30	16.3.3	清算参与者资产（非现金）的再抵押	再抵押的初始保证金的期限分布：隔夜/一天；一天以上到最多一周；一周以上到最多一个月；一个月以上到最多一年；一年以上到最多两年；两	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	一周以上到最多一个月；	不适用	不适用						

披露日期	对应原则要点	报告等级标识3	货币3	CCP链接3	描述3	值3	说明3	报告等级标识4	货币4	CCP链接4	描述4	值4	说明4	报告等级标识5	货币5	CCP链接5	描述5	值5	说明5	报告等级标识6	货币6	CCP链接6	描述6	值6	说明6	报告等级标识7	货币7	CCP链接7	描述7	值7	说明7
2024-09-30	16.2.8																														
2024-09-30	16.2.9																														
2024-09-30	16.2.10																														
2024-09-30	16.2.11																														
2024-09-30	16.2.12																														
2024-09-30	16.2.13																														
2024-09-30	16.2.14																														
2024-09-30	16.2.15																														
2024-09-30	16.2.15																														
2024-09-30	16.2.16																														
2024-09-30	16.2.17																														
2024-09-30	16.2.18																														
2024-09-30	16.2.19																														
2024-09-30	16.2.20																														
2024-09-30	16.3.1																														
2024-09-30	16.3.2																														
2024-09-30	16.3.3																														
2024-09-30	16.3.3																														
2024-09-30	16.3.3																														

披露日期	对应原则要点	报告等级标识8	货币8	CCP链接8	描述8	值8	说明8
2024-09-30	16.2.8						
2024-09-30	16.2.9						
2024-09-30	16.2.10						
2024-09-30	16.2.11						
2024-09-30	16.2.12						
2024-09-30	16.2.13						
2024-09-30	16.2.14						
2024-09-30	16.2.15						
2024-09-30	16.2.15						
2024-09-30	16.2.16						
2024-09-30	16.2.17						
2024-09-30	16.2.18						
2024-09-30	16.2.19						
2024-09-30	16.2.20						
2024-09-30	16.3.1						
2024-09-30	16.3.2						
2024-09-30	16.3.3						
2024-09-30	16.3.3						
2024-09-30	16.3.3						

披露日期	对应原则要点	披露条目	披露描述	数字格式	报告等级1	报告等级标识1	货币1	CCP链接1	描述1	值1	说明1	报告等级标识2	货币2	CCP链接2	描述2	值2	说明2
2024-09-30	16.3.3	清算参与者资产（非现金）的再抵押	再抵押的初始保证金的期限分布：隔夜/一天：一天以上到最多一周：一周以上到最多一个月：一个月以上到最多一年：一年以上到最多两年：两年	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	一年以上到最多两年：	不适用	不适用						
2024-09-30	16.3.3	清算参与者资产（非现金）的再抵押	再抵押的初始保证金的期限分布：隔夜/一天：一天以上到最多一周：一周以上到最多一个月：一个月以上到最多一年：一年以上到最多两年：两年	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	两年以上	不适用	不适用						
2024-09-30	16.3.3	清算参与者资产（非现金）的再抵押	再抵押的初始保证金的期限分布：隔夜/一天：一天以上到最多一周：一周以上到最多一个月：一个月以上到最多一年：一年以上到最多两年：两年	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	隔夜/一天：	不适用	不适用						
2024-09-30	16.3.4	清算参与者资产（非现金）的再抵押	再抵押的清算基金的期限分布：隔夜/一天：一天以上到最多一周：一周以上到最多一个月：一个月以上到最多一年：一年以上到最多两年：两年	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	一天以上到最多一周：	不适用	不适用						
2024-09-30	16.3.4	清算参与者资产（非现金）的再抵押	再抵押的清算基金的期限分布：隔夜/一天：一天以上到最多一周：一周以上到最多一个月：一个月以上到最多一年：一年以上到最多两年：两年	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	一个月以上到最多一年：	不适用	不适用						
2024-09-30	16.3.4	清算参与者资产（非现金）的再抵押	再抵押的清算基金的期限分布：隔夜/一天：一天以上到最多一周：一周以上到最多一个月：一个月以上到最多一年：一年以上到最多两年：两年	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	一周以上到最多一个月：	不适用	不适用						
2024-09-30	16.3.4	清算参与者资产（非现金）的再抵押	再抵押的清算基金的期限分布：隔夜/一天：一天以上到最多一周：一周以上到最多一个月：一个月以上到最多一年：一年以上到最多两年：两年	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	一年以上到最多两年：	不适用	不适用						
2024-09-30	16.3.4	清算参与者资产（非现金）的再抵押	再抵押的清算基金的期限分布：隔夜/一天：一天以上到最多一周：一周以上到最多一个月：一个月以上到最多一年：一年以上到最多两年：两年	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	两年以上	不适用	不适用						
2024-09-30	16.3.4	清算参与者资产（非现金）的再抵押	再抵押的清算基金的期限分布：隔夜/一天：一天以上到最多一周：一周以上到最多一个月：一个月以上到最多一年：一年以上到最多两年：两年	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	隔夜/一天：	不适用	不适用						
2024-09-30	17.1.1	核心清算系统（无论是否外包）在一段期间的运营可得性目标（例如，12个月99.99%）	核心清算系统（无论是否外包）在一段期间的运营可得性目标（例如，12个月99.99%）	数字，两位小数，百分比	中央对手方	上海清算所		不适用		12个月99.9%	不适用						
2024-09-30	17.2.1	核心清算系统在过去12个月的实际运营可得性	核心清算系统在过去12个月的实际运营可得性	数字，两位小数，百分比	中央对手方	上海清算所		不适用		100.00%	不适用						
2024-09-30	17.3.1	实际故障次数	核心清算系统在过去12个月发生故障的总次数和持续时间	UTC 时间格式 时:分:秒	中央对手方	上海清算所		不适用	故障持续时间	00:00:00	不适用						
2024-09-30	17.4.1	系统恢复响应时间目标	系统恢复响应时间目标	文本	中央对手方	上海清算所		不适用		2小时	不适用						
2024-09-30	18.1.1.1	清算会员数量，按清算服务类型分类	综合清算会员的数量	数字，整数	中央对手方	上海清算所		不适用		13	不适用						
2024-09-30	18.1.1.2	清算会员数量，按清算服务类型分类	普通清算会员的数量	数字，整数	中央对手方	上海清算所		不适用		85	不适用						
2024-09-30	18.1.1.3	清算会员数量，按清算服务类型分类	其他类别的清算会员数量	数字，整数	中央对手方	上海清算所		不适用		0	不适用						
2024-09-30	18.1.2.1	清算会员数量，按清算服务类型分类	中央银行类清算会员的数量	数字，整数	中央对手方	上海清算所		不适用		0	不适用						
2024-09-30	18.1.2.2	清算会员数量，按清算服务类型分类	中央对手方类清算会员的数量	数字，整数	中央对手方	上海清算所		不适用		0	不适用						
2024-09-30	18.1.2.3	清算会员数量，按清算服务类型分类	银行类清算会员的数量	数字，整数	中央对手方	上海清算所		不适用		71	不适用						
2024-09-30	18.1.2.4	清算会员数量，按清算服务类型分类	其他机构类型清算会员的数量（说明类别）	数字，整数	中央对手方	上海清算所		不适用		27	证券公司：25家 财务公司：2家						
2024-09-30	18.1.3.1	清算会员数量，按清算服务类型分类	境内法人清算会员的数量	数字，整数	中央对手方	上海清算所		不适用		96	不适用						
2024-09-30	18.1.3.2	清算会员数量，按清算服务类型分类	境外法人清算会员的数量	数字，整数	中央对手方	上海清算所		不适用		2	不适用						

披露日期	对应原则要点	报告等级标识3	货币3	CCP链接3	描述3	值3	说明3	报告等级标识4	货币4	CCP链接4	描述4	值4	说明4	报告等级标识5	货币5	CCP链接5	描述5	值5	说明5	报告等级标识6	货币6	CCP链接6	描述6	值6	说明6	报告等级标识7	货币7	CCP链接7	描述7	值7	说明7
2024-09-30	16.3.3																														
2024-09-30	16.3.3																														
2024-09-30	16.3.3																														
2024-09-30	16.3.4																														
2024-09-30	16.3.4																														
2024-09-30	16.3.4																														
2024-09-30	16.3.4																														
2024-09-30	16.3.4																														
2024-09-30	16.3.4																														
2024-09-30	16.3.4																														
2024-09-30	16.3.4																														
2024-09-30	17.1.1																														
2024-09-30	17.2.1																														
2024-09-30	17.3.1																														
2024-09-30	17.4.1																														
2024-09-30	18.1.1.1																														
2024-09-30	18.1.1.2																														
2024-09-30	18.1.1.3																														
2024-09-30	18.1.2.1																														
2024-09-30	18.1.2.2																														
2024-09-30	18.1.2.3																														
2024-09-30	18.1.2.4																														
2024-09-30	18.1.3.1																														
2024-09-30	18.1.3.2																														

披露日期	对应原则要点	报告等级标识8	货币8	CCP链接8	描述8	值8	说明8
2024-09-30	16. 3. 3						
2024-09-30	16. 3. 3						
2024-09-30	16. 3. 3						
2024-09-30	16. 3. 4						
2024-09-30	16. 3. 4						
2024-09-30	16. 3. 4						
2024-09-30	16. 3. 4						
2024-09-30	16. 3. 4						
2024-09-30	16. 3. 4						
2024-09-30	16. 3. 4						
2024-09-30	17. 1. 1						
2024-09-30	17. 2. 1						
2024-09-30	17. 3. 1						
2024-09-30	17. 4. 1						
2024-09-30	18. 1. 1. 1						
2024-09-30	18. 1. 1. 2						
2024-09-30	18. 1. 1. 3						
2024-09-30	18. 1. 1. 4						
2024-09-30	18. 1. 2. 1						
2024-09-30	18. 1. 2. 2						
2024-09-30	18. 1. 2. 3						
2024-09-30	18. 1. 2. 4						
2024-09-30	18. 1. 3. 1						
2024-09-30	18. 1. 3. 2						

披露日期	对应原则要点	披露条目	披露描述	数字格式	报告等级1	报告等级标识1	货币1	CCP链接1	描述1	值1	说明1	报告等级标识2	货币2	CCP链接2	描述2	值2	说明2
2024-09-30	18.2.1	持仓量的集中度	对清算会员数在10到25之间的清算业务，提供五家最大的清算会员的持仓总量的占比（包括自营和代理）；	数字，两位小数，百分比	违约基金	债券		不适用	季度均值	不适用	不适用	大宗商品		不适用	季度均值	100.00%	不适用
2024-09-30	18.2.1	持仓量的集中度	对清算会员数在10到25之间的清算业务，提供五家最大的清算会员的持仓总量的占比（包括自营和代理）；	数字，两位小数，百分比	违约基金	债券		不适用	季度峰值	不适用	不适用	大宗商品		不适用	季度峰值	100.00%	不适用
2024-09-30	18.2.2	持仓量的集中度	对清算会员数在25或以上的清算业务，提供五家最大的清算会员的持仓总量的占比（包括自营和代理）；季度内平均值和最大值	数字，两位小数，百分比	违约基金	债券		不适用	季度均值	46.47%	不适用	大宗商品		不适用	季度均值	不适用	不适用
2024-09-30	18.2.2	持仓量的集中度	对清算会员数在25或以上的清算业务，提供五家最大的清算会员的持仓总量的占比（包括自营和代理）；季度内平均值和最大值	数字，两位小数，百分比	违约基金	债券		不适用	季度峰值	55.43%	不适用	大宗商品		不适用	季度峰值	不适用	不适用
2024-09-30	18.2.3	持仓量的集中度	对清算会员数在25或以上的清算业务，提供十家最大的清算会员的持仓总量的占比（包括自营和代理）；季度内平均值和最大值	数字，两位小数，百分比	违约基金	债券		不适用	季度均值	67.05%	不适用	大宗商品		不适用	季度均值	不适用	不适用
2024-09-30	18.2.3	持仓量的集中度	对清算会员数在25或以上的清算业务，提供十家最大的清算会员的持仓总量的占比（包括自营和代理）；季度内平均值和最大值	数字，两位小数，百分比	违约基金	债券		不适用	季度峰值	77.55%	不适用	大宗商品		不适用	季度峰值	不适用	不适用
2024-09-30	18.3.1	初始保证金集中度	对清算会员数在10到25之间的清算业务，提供五家最大的清算会员提交的初始保证金总额的占比（包括自营和代理）；	数字，两位小数，百分比	违约基金	债券		不适用	季度均值	不适用	不适用	大宗商品		不适用	季度均值	100.00%	不适用
2024-09-30	18.3.1	初始保证金集中度	对清算会员数在10到25之间的清算业务，提供五家最大的清算会员提交的初始保证金总额的占比（包括自营和代理）；	数字，两位小数，百分比	违约基金	债券		不适用	季度峰值	不适用	不适用	大宗商品		不适用	季度峰值	100.00%	不适用
2024-09-30	18.3.2	初始保证金集中度	对清算会员数在25或以上的清算业务，提供五家最大的清算会员提交的初始保证金总额的占比（包括自营和代理）；季度内平均值和最大值	数字，两位小数，百分比	违约基金	债券		不适用	季度均值	37.96%	不适用	大宗商品		不适用	季度均值	不适用	不适用
2024-09-30	18.3.2	初始保证金集中度	对清算会员数在25或以上的清算业务，提供五家最大的清算会员提交的初始保证金总额的占比（包括自营和代理）；季度内平均值和最大值	数字，两位小数，百分比	违约基金	债券		不适用	季度峰值	41.88%	不适用	大宗商品		不适用	季度峰值	不适用	不适用
2024-09-30	18.3.3	初始保证金集中度	对清算会员数在25或以上的清算业务，提供十家最大的清算会员提交的初始保证金总额的占比（包括自营和代理）；季度内平均值和最大值	数字，两位小数，百分比	违约基金	债券		不适用	季度均值	51.15%	不适用	大宗商品		不适用	季度均值	不适用	不适用
2024-09-30	18.3.3	初始保证金集中度	对清算会员数在25或以上的清算业务，提供十家最大的清算会员提交的初始保证金总额的占比（包括自营和代理）；季度内平均值和最大值	数字，两位小数，百分比	违约基金	债券		不适用	季度峰值	54.19%	不适用	大宗商品		不适用	季度峰值	不适用	不适用
2024-09-30	18.4.1	独立核算的清算基金集中度	对每个清算会员数在10到25之间的分类独立核算的清算基金，提供五家最大的清算会员缴纳的清算基金总额	数字，两位小数，百分比	违约基金	债券		不适用		不适用	不适用	大宗商品		不适用		47.62%	不适用
2024-09-30	18.4.2	独立核算的清算基金集中度	对每个清算会员数在25或以上的分类独立核算的清算基金，提供五家最大的清算会员缴纳的清算基金总额的占	数字，两位小数，百分比	违约基金	债券		不适用		29.68%	不适用	大宗商品		不适用		不适用	不适用
2024-09-30	18.4.3	独立核算的清算基金集中度	对每个清算会员数在25或以上的分类独立核算的清算基金，提供十家最大的清算会员缴纳的清算基金总额的占	数字，两位小数，百分比	违约基金	债券		不适用		45.55%	不适用	大宗商品		不适用		不适用	不适用
2024-09-30	19.1.1	分层参与安排，对客户清算集中程度的衡量	代理客户数（如果已知）	数字，整数	中央对手方	上海清算所		不适用		963	不适用						
2024-09-30	19.1.2	分层参与安排，对客户清算集中程度的衡量	代理客户清算的综合清算会员的数量	数字，整数	中央对手方	上海清算所		不适用		13	不适用						
2024-09-30	19.1.3.1	分层参与安排，对客户清算集中程度的衡量	代理清算业务金额（以名义本金或清算金额衡量）排名前五的清算会员的代理清算业务金额占所有代理清算业务金额的比例（如果中央对手方的会员数超过10家）-峰值	数字，两位小数，百分比	违约基金	债券		不适用		100.00%	不适用	大宗商品		不适用		100.00%	不适用
2024-09-30	19.1.3.2	分层参与安排，对客户清算集中程度的衡量	代理清算业务金额（以名义本金或清算金额衡量）排名前五的清算会员的代理清算业务金额占所有代理清算业务金额的比例（如果中央对手方的会员数超过11家）-均值	数字，两位小数，百分比	违约基金	债券		不适用		100.00%	不适用	大宗商品		不适用		100.00%	不适用
2024-09-30	19.1.4.1	分层参与安排，对客户清算集中程度的衡量	代理清算业务金额（以名义本金或清算金额衡量）排名前十的清算会员的代理清算业务金额占所有代理清算业务金额的比例（如果中央对手方的会员数超过25家）-峰值	数字，两位小数，百分比	违约基金	债券		不适用		100.00%	不适用	大宗商品		不适用		不适用	不适用
2024-09-30	19.1.4.2	分层参与安排，对客户清算集中程度的衡量	代理清算业务金额（以名义本金或清算金额衡量）排名前十的清算会员的代理清算业务金额占所有代理清算业务金额的比例（如果中央对手方的会员数超过25家）-均值	数字，两位小数，百分比	违约基金	债券		不适用		100.00%	不适用	大宗商品		不适用		不适用	不适用

披露日期	对应 原则 要点	报告等级标识 3	货币3	CCP链接3	描述3	值3	说明3	报告等级标识 4	货币 4	CCP链接4	描述4	值4	说明 4	报告等级标识 5	货币5	CCP链接5	描述5	值5	说明5	报告等 级标识 6	货币6	CCP链接 6	描述6	值6	说明6	报告等级 标识7	货币7	CCP链接7	描述7	值7	说明7					
2024-09-30	18.2.1	利率互换		不适用	季度均值	不适用	不适用	标准债券远期		不适用	季度均值	不适用	不适用	人民币外汇		不适用	季度均值	不适用	不适用	外币对		不适用	季度均值	90.58%	不适用											
2024-09-30	18.2.1	利率互换		不适用	季度峰值	不适用	不适用	标准债券远期		不适用	季度峰值	不适用	不适用	人民币外汇		不适用	季度峰值	不适用	不适用	外币对		不适用	季度峰值	92.09%	不适用											
2024-09-30	18.2.2	利率互换		不适用	季度均值	44.09%	不适用	标准债券远期		不适用	季度均值	73.07%	不适用	人民币外汇		不适用	季度均值	42.19%	不适用	外币对		不适用	季度均值	不适用	不适用											
2024-09-30	18.2.2	利率互换		不适用	季度峰值	44.52%	不适用	标准债券远期		不适用	季度峰值	88.99%	不适用	人民币外汇		不适用	季度峰值	43.14%	不适用	外币对		不适用	季度峰值	不适用	不适用											
2024-09-30	18.2.3	利率互换		不适用	季度均值	61.72%	不适用	标准债券远期		不适用	季度均值	95.56%	不适用	人民币外汇		不适用	季度均值	64.61%	不适用	外币对		不适用	季度均值	不适用	不适用											
2024-09-30	18.2.3	利率互换		不适用	季度峰值	62.05%	不适用	标准债券远期		不适用	季度峰值	100.00%	不适用	人民币外汇		不适用	季度峰值	65.59%	不适用	外币对		不适用	季度峰值	不适用	不适用											
2024-09-30	18.3.1	利率互换		不适用	季度均值	不适用	不适用	标准债券远期		不适用	季度均值	不适用	不适用	人民币外汇		不适用	季度均值	不适用	不适用	外币对		不适用	季度均值	75.86%	不适用											
2024-09-30	18.3.1	利率互换		不适用	季度峰值	不适用	不适用	标准债券远期		不适用	季度峰值	不适用	不适用	人民币外汇		不适用	季度峰值	不适用	不适用	外币对		不适用	季度峰值	80.08%	不适用											
2024-09-30	18.3.2	利率互换		不适用	季度均值	63.24%	不适用	标准债券远期		不适用	季度均值	51.03%	不适用	人民币外汇		不适用	季度均值	63.89%	不适用	外币对		不适用	季度均值	不适用	不适用											
2024-09-30	18.3.2	利率互换		不适用	季度峰值	64.01%	不适用	标准债券远期		不适用	季度峰值	55.95%	不适用	人民币外汇		不适用	季度峰值	65.64%	不适用	外币对		不适用	季度峰值	不适用	不适用											
2024-09-30	18.3.3	利率互换		不适用	季度均值	76.51%	不适用	标准债券远期		不适用	季度均值	69.10%	不适用	人民币外汇		不适用	季度均值	77.04%	不适用	外币对		不适用	季度均值	不适用	不适用											
2024-09-30	18.3.3	利率互换		不适用	季度峰值	76.83%	不适用	标准债券远期		不适用	季度峰值	73.45%	不适用	人民币外汇		不适用	季度峰值	79.70%	不适用	外币对		不适用	季度峰值	不适用	不适用											
2024-09-30	18.4.1	利率互换		不适用		不适用	不适用	标准债券远期		不适用		不适用	不适用	人民币外汇		不适用		不适用	不适用	外币对		不适用		88.84%	不适用											
2024-09-30	18.4.2	利率互换		不适用		71.92%	不适用	标准债券远期		不适用		54.51%	不适用	人民币外汇		不适用		65.98%	不适用	外币对		不适用		不适用	不适用											
2024-09-30	18.4.3	利率互换		不适用		84.28%	不适用	标准债券远期		不适用		80.17%	不适用	人民币外汇		不适用		81.57%	不适用	外币对		不适用		不适用	不适用											
2024-09-30	19.1.1																																			
2024-09-30	19.1.2																																			
2024-09-30	19.1.3.1	利率互换		不适用		100.00%	不适用	标准债券远期		不适用		100.00%	不适用	人民币外汇		不适用		100.00%	不适用	外币对		不适用		100.00%	不适用											
2024-09-30	19.1.3.2	利率互换		不适用		94.32%	不适用	标准债券远期		不适用		100.00%	不适用	人民币外汇		不适用		100.00%	不适用	外币对		不适用		100.00%	不适用											
2024-09-30	19.1.4.1	利率互换		不适用		100.00%	不适用	标准债券远期		不适用		100.00%	不适用	人民币外汇		不适用		100.00%	不适用	外币对		不适用		不适用	不适用											
2024-09-30	19.1.4.2	利率互换		不适用		100.00%	不适用	标准债券远期		不适用		100.00%	不适用	人民币外汇		不适用		100.00%	不适用	外币对		不适用		不适用	不适用											

披露日期	对应原则要点	报告等级标识8	货币8	CCP链接8	描述8	值8	说明8
2024-09-30	18.2.1						
2024-09-30	18.2.1						
2024-09-30	18.2.2						
2024-09-30	18.2.2						
2024-09-30	18.2.3						
2024-09-30	18.2.3						
2024-09-30	18.3.1						
2024-09-30	18.3.1						
2024-09-30	18.3.2						
2024-09-30	18.3.2						
2024-09-30	18.3.3						
2024-09-30	18.3.3						
2024-09-30	18.4.1						
2024-09-30	18.4.2						
2024-09-30	18.4.3						
2024-09-30	19.1.1						
2024-09-30	19.1.2						
2024-09-30	19.1.3. 1						
2024-09-30	19.1.3. 2						
2024-09-30	19.1.4. 1						
2024-09-30	19.1.4. 2						

披露日期	对应原则要点	披露条目	披露描述	数字格式	报告等级1	报告等级标识1	货币1	CCP链接1	描述1	值1	说明1	报告等级标识2	货币2	CCP链接2	描述2	值2	说明2
2024-09-30	20.1.1	基础设施的连接，交易总金额	通过每个连接的中央对手方清算的交易额占总清算金额的比例	数字，两位小数，百分比	中央对手方	上海清算所		不适用		--	不适用						
2024-09-30	20.2.1	基础设施的连接，初始保证金或等价金融资源	由中央对手方提交给每个相连接的中央对手方的初始保证金或等价金融资源，用以覆盖连接的中央对手方的风险	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所		不适用		--	不适用						
2024-09-30	20.3.1	基础设施的连接，初始保证金或等价金融资源	从每个相连接的中央对手方处收取的初始保证金或等价金融资源，用以覆盖对连接的中央对手方的风险敞口	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所		不适用		--	不适用						
2024-09-30	20.4.1.1	基础设施的连接，回溯测试的结果	基于每日回溯的结果，过去十二个月中对每个连接的中央对手方持有的保证金及等价金融资源的价值低于敞口市场价格次数	数字，整数	中央对手方	上海清算所		不适用		--	不适用						
2024-09-30	20.4.1.2	基础设施的连接，回溯测试的结果	回溯测试的频率，日间、连续还是一日一次	文本	中央对手方	上海清算所		不适用		--	不适用						
2024-09-30	20.4.1.3	基础设施的连接，回溯测试的结果	如果20.4.1.2的回答是“一日一次”，那么请说明测试的具体时间，否则为空	文本	中央对手方	上海清算所		不适用		--	不适用						
2024-09-30	20.4.2	基础设施的连接，回溯测试的结果	观察值的数量	数字，整数	中央对手方	上海清算所		不适用		--	不适用						
2024-09-30	20.4.3	基础设施的连接，回溯测试的结果	达到的覆盖水平	数字，两位小数，百分比	中央对手方	上海清算所		不适用		--	不适用						
2024-09-30	20.5.1.1	基础设施的连接，额外预留的金融资源去向	向每个相连接的中央对手方提供的初始保证金及等价金融资源以外的预留资金（如果有的话）	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所		不适用		--	不适用						
2024-09-30	20.5.1.2	基础设施的连接，额外预留的金融资源去向	这部分资金是标准清算基金的一部分还是单独存放	文本	中央对手方	上海清算所		不适用		--	不适用						
2024-09-30	20.6.1.1	基础设施的连接，额外预留的金融资源来源	从每个相连接的中央对手方处收取的初始保证金及等价金融资源以外的预留资金（如果有的话）	数字，两位小数，货币单位	中央对手方	上海清算所		不适用		--	不适用						
2024-09-30	20.6.1.2	基础设施的连接，额外预留的金融资源来源	这部分资金是标准清算基金的一部分还是单独存放	文本	中央对手方	上海清算所		不适用		--	不适用						
2024-09-30	20.7.1	基础设施的连接，交叉保证金	适用跨市场保证金的交易金额，占总清算金额的比例	数字，两位小数，百分比	中央对手方	上海清算所		不适用		--	不适用						
2024-09-30	20.7.2	基础设施的连接，交叉保证金	由于跨市场保证金导致的中央对手方持有的初始保证金的减少额，占总初始保证金的比例	数字，两位小数，百分比	中央对手方	上海清算所		不适用		--	不适用						
2024-09-30	23.1.1	相关规则、重要流程和市场数据的披露：日均数值	日均清算手数，按工具、资产类型、币种、场外或交易所区分	数字，整数	清算服务	债券		不适用	场外	73	不适用	大宗商品		不适用	场外	2	不适用
2024-09-30	23.1.2	相关规则、重要流程和市场数据的披露：日均数值	日均名义本金，按工具、资产类型、币种、场外或交易所区分	数字，两位小数，货币单位	清算服务	债券	人民币	不适用	场外	51661851899.60	不适用	大宗商品	人民币	不适用	场外	53339141.82	不适用
2024-09-30	23.2.1	相关规则、重要流程和市场数据的披露：尚未结算的	已进行合约替代但尚未结算的证券交易结算金额，按工具、资产类型、币种、场外或交易所区分	数字，两位小数，货币单位	清算服务	债券	人民币	不适用	场外	54490500000.00	不适用	大宗商品	人民币	不适用	场外	0.00	不适用
2024-09-30	23.2.2	相关规则、重要流程和市场数据的披露：尚未结算的	说明23.1.1, 23.1.2和23.2.1的资产类型	文本	清算服务	债券		不适用	场外	债券	不适用	大宗商品		不适用	场外	大宗商品	不适用
2024-09-30	23.2.3	相关规则、重要流程和市场数据的披露：尚未结算的	说明23.1.1, 23.1.2和23.2.1的产品种类	文本	清算服务	债券		不适用	场外	债券	不适用	大宗商品		不适用	场外	大宗商品	不适用
2024-09-30	23.2.4	相关规则、重要流程和市场数据的披露：尚未结算的	说明23.1.1, 23.1.2和23.2.1的产品代码	文本	清算服务	债券		不适用	场外	不适用	不适用	大宗商品		不适用	场外	不适用	不适用
2024-09-30	23.3.1	相关规则、重要流程和市场数据的披露：执行机构	由各交易平台提交的日均合约数量	数字，两位小数	清算服务	债券		不适用	执行场所	73	不适用	大宗商品		不适用	执行场所	2	不适用
2024-09-30	23.3.2	相关规则、重要流程和市场数据的披露：执行机构	由各交易平台提交的日均名义金额	数字，两位小数，货币单位	清算服务	债券	人民币	不适用	执行场所	51661851899.60	不适用	大宗商品	人民币	不适用	执行场所	53339141.82	不适用

披露日期	对应 原则 要点	报告等级标识 3	货币3	CCP链接3	描述3	值3	说明3	报告等级标识 4	货币 4	CCP链接 4	描述4	值4	说明 4	报告等级标识 5	货币5	CCP链接5	描述5	值5	说明5	报告等 级标识 6	货币6	CCP链接 6	描述6	值6	说明6	报告等级 标识7	货币7	CCP链接7	描述7	值7	说明7
2024-09-30	20.1.1																														
2024-09-30	20.2.1																														
2024-09-30	20.3.1																														
2024-09-30	20.4.1.1																														
2024-09-30	20.4.1.2																														
2024-09-30	20.4.1.3																														
2024-09-30	20.4.2																														
2024-09-30	20.4.3																														
2024-09-30	20.5.1.1																														
2024-09-30	20.5.1.2																														
2024-09-30	20.6.1.1																														
2024-09-30	20.6.1.2																														
2024-09-30	20.7.1																														
2024-09-30	20.7.2																														
2024-09-30	23.1.1	利率互换		不适用	场外	1293	不适用	标准债券远期		不适用	场外	39	不适用	人民币外汇		不适用	场外	14318	不适用	外币对		不适用	场外	490	不适用						
2024-09-30	23.1.2	利率互换	人民币	不适用	场外	118977056060.61	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	场外	4372272727.27	不适用	人民币外汇	人民币	不适用	场外	667866436504.14	不适用	外币对	美元	不适用	场外	1918125307.68	不适用						
2024-09-30	23.2.1	利率互换	人民币	不适用	场外	33336049500000.00	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	场外	2910000000.00	不适用	人民币外汇	人民币	不适用	场外	20285762025975.90	不适用	外币对	美元	不适用	场外	41634346429.87	不适用						
2024-09-30	23.2.2	利率互换		不适用	场外	利率互换	不适用	标准债券远期		不适用	场外	标准债券远期	不适用	人民币外汇		不适用	场外	人民币外汇	不适用	外币对		不适用	场外	外币对	不适用						
2024-09-30	23.2.3	利率互换		不适用	场外	利率互换	不适用	标准债券远期		不适用	场外	标准债券远期	不适用	人民币外汇		不适用	场外	人民币外汇	不适用	外币对		不适用	场外	外币对	不适用						
2024-09-30	23.2.4	利率互换		不适用	场外	不适用	不适用	标准债券远期		不适用	场外	不适用	不适用	人民币外汇		不适用	场外	不适用	不适用	外币对		不适用	场外	不适用	不适用						
2024-09-30	23.3.1	利率互换		不适用	执行场所	1293	不适用	标准债券远期		不适用	执行场所	39	不适用	人民币外汇		不适用	执行场所	14318	不适用	外币对		不适用	执行场所	490	不适用						
2024-09-30	23.3.2	利率互换	人民币	不适用	执行场所	118977056060.61	不适用	标准债券远期	人民币	不适用	执行场所	4372272727.27	不适用	人民币外汇	人民币	不适用	执行场所	667866436504.14	不适用	外币对	美元	不适用	执行场所	1918125307.68	不适用						

披露日期	对应原则要点	报告等级标识	货币	CCP链接	描述	值	说明
2024-09-30	20. 1. 1						
2024-09-30	20. 2. 1						
2024-09-30	20. 3. 1						
2024-09-30	20. 4. 1. 1						
2024-09-30	20. 4. 1. 2						
2024-09-30	20. 4. 1. 3						
2024-09-30	20. 4. 2						
2024-09-30	20. 4. 3						
2024-09-30	20. 5. 1. 1						
2024-09-30	20. 5. 1. 2						
2024-09-30	20. 6. 1. 1						
2024-09-30	20. 6. 1. 2						
2024-09-30	20. 7. 1						
2024-09-30	20. 7. 2						
2024-09-30	23. 1. 1						
2024-09-30	23. 1. 2						
2024-09-30	23. 2. 1						
2024-09-30	23. 2. 2						
2024-09-30	23. 2. 3						
2024-09-30	23. 2. 4						
2024-09-30	23. 3. 1						
2024-09-30	23. 3. 2						

披露日期	披露等级	披露等级说明	货币单位	4.1.1	4.1.2	4.1.3	4.1.4	4.1.5	4.1.6	4.1.7	4.1.8
2024-09-30	清算服务	债券	人民币								
2024-09-30	清算服务	大宗商品	人民币								
2024-09-30	清算服务	利率互换	人民币								
2024-09-30	清算服务	标准债券远期	人民币								
2024-09-30	清算服务	人民币外汇	美元								
2024-09-30	清算服务	外币对	美元								
2024-09-30	违约基金	债券	人民币				58,990,000.00	58,990,000.00	0.00	0.00	58,990,000.00
2024-09-30	违约基金	大宗商品	人民币				6,300,000.00	6,300,000.00	0.00	0.00	6,300,000.00
2024-09-30	违约基金	利率互换	人民币				3,478,500,000.00	3,478,500,000.00	0.00	0.00	3,478,500,000.00
2024-09-30	违约基金	标准债券远期	人民币				27,280,000.00	27,280,000.00	0.00	0.00	27,280,000.00
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	人民币				27,758,070,000.00	27,758,070,000.00	0.00	0.00	27,758,070,000.00
2024-09-30	违约基金	外币对	人民币				4,895,010,000.00	4,895,010,000.00	0.00	0.00	4,895,010,000.00
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	美元								
2024-09-30	违约基金	外币对	美元								
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	人民币	200,000,000.00	0.00	1,800,000,000.00					
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	美元								

披露日期	披露等级	披露等级说明	货币单位	4.1.9	4.1.10	4.2.1	4.4.1	4.4.2	4.4.4	4.4.8	5.1.1	5.2.1	5.3.1	5.3.2	5.3.3	5.3.4	6.3.1	6.4.1
2024-09-30	清算服务	债券	人民币														不适用	VAR/HS
2024-09-30	清算服务	大宗商品	人民币														不适用	ES/HS
2024-09-30	清算服务	利率互换	人民币														不适用	VAR/HS
2024-09-30	清算服务	标准债券远期	人民币														不适用	VAR/HS
2024-09-30	清算服务	人民币外汇	美元														不适用	ES/HS
2024-09-30	清算服务	外币对	美元														不适用	ES/HS
2024-09-30	违约基金	债券	人民币		0.00	0.00	Cover 2	3	0	0								
2024-09-30	违约基金	大宗商品	人民币		0.00	0.00	Cover 2	2	0	0								
2024-09-30	违约基金	利率互换	人民币		0.00	12274518.46	Cover 2	10	0	0								
2024-09-30	违约基金	标准债券远期	人民币		0.00	3147.10	Cover 2	2	0	0								
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	人民币		0.00	247676875.71	Cover 2	5	0	0								
2024-09-30	违约基金	外币对	人民币		0.00	2153173.41	Cover 2	5	0	0								
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	美元															
2024-09-30	违约基金	外币对	美元															
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	人民币	上海清算所在处理清算会员违约处理期间，将不对非违约清算会员的清算基金应缴总额（包括其应缴纳的清算基金份额以及其应缴纳的补充清算基金份额）以及清算基金交纳比例进行调整。非违约清算会员的清算基金应缴总额以及应支付的清算基金交纳比例依照首个违约会员发生违约时的前一个工作日的标准确定。在任意90个自然日内（含），某业务补充清算基金份额的补充上限为清算会员依							https://www.shclearing.com.cn/	现金	99.50%	10天	500	0		
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	美元															

披露日期	披露等级	披露等级说明	货币单位	6.4.2	6.4.3	6.4.4	6.4.5	6.4.6	6.4.7	6.4.8	6.4.9	6.4.10	6.4.11	6.4.12	6.4.13	6.4.14	6.4.15	6.5.1.1	6.5.1.2	6.5.1.3	6.5.2
2024-09-30	清算服务	债券	人民币	2021-10-08	VAR/HIS	2021/10/8	99.50%	不适	500天	2021/10/8	不适	不适用	3天	不适用	不适用	每年	2024/8/8	0	1次	日终	22250
2024-09-30	清算服务	大宗商品	人民币	2020-07-13	ES/HIS	2020/7/13	99.00%	不适	250天/全历史期限	2020/7/13	不适	不适用	2天	不适用	组合保证金计算逻辑详见： https://www.shclearing.com.cn/ffa/scgg/202007/	一周2次	https://www.shclearing.com.cn/cis/bzjyq/	0	1次	日终	299
2024-09-30	清算服务	利率互换	人民币	不适用	VAR/HIS	不适用	99.50%	不适	250天	不适用	不适	不适用	10天	不适用	不适用	每年	2024/8/8	0	1次	日终	59000
2024-09-30	清算服务	标准债券远期	人民币	不适用	VAR/HIS	不适用	99.50%	不适	250天	不适用	不适	不适用	2天	不适用	不适用	每季度	https://www.shclearing.com.cn/cpyy/fuel/	2	1次	日终	4632
2024-09-30	清算服务	人民币外汇	美元	不适用	ES/HIS	不适用	99.00%	不适	500天	不适用	不适	不适用	5天	不适用	不适用	每年	2024/8/8	0	1次	日终	22250
2024-09-30	清算服务	外币对	美元	不适用	ES/FHS	不适用	99.50%	不适	2500天	不适用	不适	不适用	5天	不适用	不适用	每年	2024/8/8	0	1次	日终	9000
2024-09-30	违约基金	债券	人民币																		
2024-09-30	违约基金	大宗商品	人民币																		
2024-09-30	违约基金	利率互换	人民币																		
2024-09-30	违约基金	标准债券远期	人民币																		
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	人民币																		
2024-09-30	违约基金	外币对	人民币																		
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	美元																		
2024-09-30	违约基金	外币对	美元																		
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	人民币																		
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	美元																		

披露日期	披露等级	披露等级说明	货币单位	6.5.3	6.5.4	6.5.5	6.6.1	6.7.1	6.8.1	7.1.1	7.1.10	7.1.11	7.2.1	7.3.2	12.1.1	12.1.2	12.1.3	12.2.1
2024-09-30	清算服务	债券	人民币	100.00%	0.00	0.00												
2024-09-30	清算服务	大宗商品	人民币	100.00%	0.00	0.00												
2024-09-30	清算服务	利率互换	人民币	100.00%	0.00	0.00												
2024-09-30	清算服务	标准债券远期	人民币	99.96%	5,831,359.65	2,957,328.33												
2024-09-30	清算服务	人民币外汇	美元	100.00%	0.00	0.00												
2024-09-30	清算服务	外币对	美元	100.00%	0.00	0.00												
2024-09-30	违约基金	债券	人民币						5,850,000.00						6.11%	0.00%	0.00%	0.45%
2024-09-30	违约基金	大宗商品	人民币						18,000.00						0.00%	0.00%	0.01%	0.00%
2024-09-30	违约基金	利率互换	人民币						411,994,803.44						0.00%	0.00%	14.08%	0.00%
2024-09-30	违约基金	标准债券远期	人民币						99,450,029.42						0.00%	0.00%	0.52%	0.00%
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	人民币												0.00%	0.00%	79.05%	0.00%
2024-09-30	违约基金	外币对	人民币												0.00%	0.00%	0.23%	0.00%
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	美元						675,600,492.00									
2024-09-30	违约基金	外币对	美元						218,189,388.00									
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	人民币				4,660,983,891.60	27,162,787,655.47		cover1	上海清算所正在研究探讨从央行获取流动性的可行性。	受影响机构数最小的原则制定优先支付规则，一般按照未违约会员应收金额从大到小排列被延迟交付优先级。	0.00	0.00				
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	美元															

披露日期	披露等级	披露等级说明	货币单位	12.2.2	12.2.3	13.1.1	13.1.2	13.1.3.1	13.1.3.2	13.1.4	14.1.1	14.1.2	14.1.3	14.1.4	15.1.1	15.1.2	15.2.1	15.2.2	15.2.3	15.2.4	15.2.5
2024-09-30	清算服务	债券	人民币																		
2024-09-30	清算服务	大宗商品	人民币																		
2024-09-30	清算服务	利率互换	人民币																		
2024-09-30	清算服务	标准债券远期	人民币																		
2024-09-30	清算服务	人民币外汇	美元																		
2024-09-30	清算服务	外币对	美元																		
2024-09-30	违约基金	债券	人民币	0.00%	0.00%	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	100.00%	0.00%	0.00%	0.00%							
2024-09-30	违约基金	大宗商品	人民币	0.00%	0.01%	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	100.00%	0.00%	0.00%	0.00%							
2024-09-30	违约基金	利率互换	人民币	0.00%	7.97%	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	100.00%	0.00%	0.00%	0.00%							
2024-09-30	违约基金	标准债券远期	人民币	0.00%	0.24%	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	100.00%	0.00%	0.00%	0.00%							
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	人民币	0.00%	88.30%	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	100.00%	0.00%	0.00%	0.00%							
2024-09-30	违约基金	外币对	人民币	0.00%	3.02%	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	100.00%	0.00%	0.00%	0.00%							
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	美元																		
2024-09-30	违约基金	外币对	美元																		
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	人民币												19251273535.44	951493974.26	5374216922.46	1905355312.60	2397089393.94	169160875495.45	149909601960.01
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	美元																		

披露日期	披露等级	披露等级说明	货币单位	15.2.6	15.2.7	15.3.1	15.3.2	16.1.1	16.1.2	16.2.1	16.2.2	16.2.3	16.2.4	16.2.5	16.2.6	16.2.7	16.2.9	16.2.10	16.2.11	16.2.12	16.2.13	16.2.14	16.2.16
2024-09-30	清算服务	债券	人民币																				
2024-09-30	清算服务	大宗商品	人民币																				
2024-09-30	清算服务	利率互换	人民币																				
2024-09-30	清算服务	标准债券远期	人民币																				
2024-09-30	清算服务	人民币外汇	美元																				
2024-09-30	清算服务	外币对	美元																				
2024-09-30	违约基金	债券	人民币																				
2024-09-30	违约基金	大宗商品	人民币																				
2024-09-30	违约基金	利率互换	人民币																				
2024-09-30	违约基金	标准债券远期	人民币																				
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	人民币																				
2024-09-30	违约基金	外币对	人民币																				
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	美元																				
2024-09-30	违约基金	外币对	美元																				
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	人民币	现金抵押品在财务报表内，非现金抵押品在财务报表外	不适用	不适用	不适用	165,534,728,189.54	36,224,150,000.00	100.00%	0.00%	0.00%	0.00%	100.00%	0.00%	0.00%	263.42	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	不适用
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	美元					3,202,219,965.28															

披露日期	披露等级	披露等级说明	货币单位	16.2.17	16.2.18	16.2.19	16.2.20	16.3.1
2024-09-30	清算服务	债券	人民币					
2024-09-30	清算服务	大宗商品	人民币					
2024-09-30	清算服务	利率互换	人民币					
2024-09-30	清算服务	标准债券远期	人民币					
2024-09-30	清算服务	人民币外汇	美元					
2024-09-30	清算服务	外币对	美元					
2024-09-30	违约基金	债券	人民币					
2024-09-30	违约基金	大宗商品	人民币					
2024-09-30	违约基金	利率互换	人民币					
2024-09-30	违约基金	标准债券远期	人民币					
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	人民币					
2024-09-30	违约基金	外币对	人民币					
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	美元					
2024-09-30	违约基金	外币对	美元					
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	不适用	不适用	0.00%	不适用
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	美元					

披露日期	披露等级	披露等级说明	货币单位	16.3.2	17.1.1	17.2.1	17.4.1	18.1.1.1	18.1.1.2	18.1.1.3	18.1.2.1	18.1.2.2	18.1.2.3	18.1.2.4	18.1.3.1	18.1.3.2	18.4.1	18.4.2	18.4.3	19.1.1	19.1.2	19.1.3.1	19.1.3.2	19.1.4.1	19.1.4.2
2024-09-30	清算服务	债券	人民币																						
2024-09-30	清算服务	大宗商品	人民币																						
2024-09-30	清算服务	利率互换	人民币																						
2024-09-30	清算服务	标准债券远期	人民币																						
2024-09-30	清算服务	人民币外汇	美元																						
2024-09-30	清算服务	外币对	美元																						
2024-09-30	违约基金	债券	人民币														不适用	29.68%	45.55%			100.00%	100.00%	100.00%	100.00%
2024-09-30	违约基金	大宗商品	人民币														47.62%	不适用	不适用			100.00%	100.00%	不适用	不适用
2024-09-30	违约基金	利率互换	人民币														不适用	71.92%	84.28%			100.00%	94.32%	100.00%	100.00%
2024-09-30	违约基金	标准债券远期	人民币														不适用	54.51%	80.17%			100.00%	100.00%	100.00%	100.00%
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	人民币														不适用	65.98%	81.57%			100.00%	100.00%	100.00%	100.00%
2024-09-30	违约基金	外币对	人民币														88.84%	不适用	不适用			100.00%	100.00%	不适用	不适用
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	美元																						
2024-09-30	违约基金	外币对	美元																						
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	人民币	不适用	12个月 99.9%	100.00%	2小时	13	85	0	0	0	71	27	96	2				963	13				
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	美元																						

披露日期	披露等级	披露等级说明	描述	货币单位	4.3.1	4.3.2	4.3.3	4.3.4	4.3.5	4.3.6	4.3.7	4.3.8	4.3.9	4.3.10	4.3.11	4.3.12	4.3.13	4.3.14	4.3.15
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	扣除折扣率	人民币	0.00	0.00	0.00	38,224,150,000.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	38224150000.00
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	扣除折扣率后	人民币	0.00	0.00	0.00	38,224,150,000.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	38224150000.00

披露日期	披露等级	披露等级说明	描述	货币单位	4. 4. 3	4. 4. 6	4. 4. 7	4. 4. 10
2024-09-30	违约基金	债券	过去12个月内最大值	人民币	44, 945, 039. 24	0. 00	61, 212, 770. 71	0. 00
2024-09-30	违约基金	大宗商品	过去12个月内最大值	人民币	846, 873. 26	0. 00	1, 693, 746. 52	0. 00
2024-09-30	违约基金	利率互换	过去12个月内最大值	人民币	3, 427, 348, 837. 45	0. 00	3, 687, 764, 766. 49	0. 00
2024-09-30	违约基金	标准债券远期	过去12个月内最大值	人民币	15, 976, 600. 11	0. 00	24, 683, 791. 22	0. 00
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	过去12个月内最大值	美元	3, 660, 531, 757. 86	0. 00	3, 913, 177, 806. 66	0. 00
2024-09-30	违约基金	外币对	过去12个月内最大值	美元	480, 263, 442. 19	0. 00	576, 816, 088. 94	0. 00
2024-09-30	违约基金	债券	过去12个月内平均值	人民币	5, 035, 433. 45	0. 00	5, 922, 225. 13	0. 00
2024-09-30	违约基金	大宗商品	过去12个月内平均值	人民币	7, 259. 57	0. 00	10, 759. 04	0. 00
2024-09-30	违约基金	利率互换	过去12个月内平均值	人民币	2, 495, 937, 226. 04	0. 00	2, 999, 440, 164. 91	0. 00
2024-09-30	违约基金	标准债券远期	过去12个月内平均值	人民币	2, 106, 105. 23	0. 00	2, 533, 868. 94	0. 00
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	过去12个月内平均值	美元	1, 715, 951, 333. 10	0. 00	1, 928, 744, 153. 22	0. 00
2024-09-30	违约基金	外币对	过去12个月内平均值	美元	279, 327, 075. 04	0. 00	355, 644, 697. 09	0. 00

披露日期	披露等级	披露等级说明	描述	货币单位	4. 4. 5	4. 4. 9
2024-09-30	违约基金	债券	超出数量	人民币	0. 00	0. 00
2024-09-30	违约基金	大宗商品	超出数量	人民币	0. 00	0. 00
2024-09-30	违约基金	利率互换	超出数量	人民币	0. 00	0. 00
2024-09-30	违约基金	标准债券远期	超出数量	人民币	0. 00	0. 00
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	超出数量	美元	0. 00	0. 00
2024-09-30	违约基金	外币对	超出数量	美元	0. 00	0. 00

披露日期	披露等级	披露等级说明	描述	货币单位	6.1.1
2024-09-30	违约基金	债券	代理全值	人民币	5,288,000.00
2024-09-30	违约基金	债券	代理净值	人民币	0.00
2024-09-30	违约基金	债券	自营净值	人民币	872,060,200.00
2024-09-30	违约基金	债券	总额	人民币	877,348,200.00
2024-09-30	违约基金	大宗商品	代理全值	人民币	0.00
2024-09-30	违约基金	大宗商品	代理净值	人民币	0.00
2024-09-30	违约基金	大宗商品	自营净值	人民币	0.00
2024-09-30	违约基金	大宗商品	总额	人民币	0.00
2024-09-30	违约基金	利率互换	代理全值	人民币	8,353,013,821.35
2024-09-30	违约基金	利率互换	代理净值	人民币	0.00
2024-09-30	违约基金	利率互换	自营净值	人民币	18,445,393,318.53
2024-09-30	违约基金	利率互换	总额	人民币	26,798,407,139.88
2024-09-30	违约基金	标准债券远期	代理全值	人民币	80,995,000.00
2024-09-30	违约基金	标准债券远期	代理净值	人民币	0.00
2024-09-30	违约基金	标准债券远期	自营净值	人民币	234,479,491.56
2024-09-30	违约基金	标准债券远期	总额	人民币	315,474,491.56
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	代理全值	美元	305,208,173.00
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	代理净值	美元	0.00
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	自营净值	美元	18,552,790,682.00
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	总额	美元	18,857,998,855.00
2024-09-30	违约基金	外币对	代理全值	美元	30,825,093.00
2024-09-30	违约基金	外币对	代理净值	美元	0.00
2024-09-30	违约基金	外币对	自营净值	美元	960,430,315.00
2024-09-30	违约基金	外币对	总额	美元	991,255,408.00

披露日期	披露等级	披露等级说明	描述	货币单位	6.2.1	6.2.2	6.2.3	6.2.4	6.2.5	6.2.6
2024-09-30	违约基金	债券	代理-扣除折扣率后	人民币	0.00	0.00	0.00	5,628,263.06	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	债券	代理-扣除折扣率前	人民币	0.00	0.00	0.00	5,628,263.06	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	债券	自营-扣除折扣率后	人民币	0.00	0.00	0.00	1,264,400,497.60	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	债券	自营-扣除折扣率前	人民币	0.00	0.00	0.00	1,264,400,497.60	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	债券	总额-扣除折扣率后	人民币	0.00	0.00	0.00	1,270,028,760.66	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	债券	总额-扣除折扣率前	人民币	0.00	0.00	0.00	1,270,028,760.66	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	大宗商品	代理-扣除折扣率后	人民币	0.00	0.00	0.00	48,864,571.46	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	大宗商品	代理-扣除折扣率前	人民币	0.00	0.00	0.00	48,864,571.46	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	大宗商品	自营-扣除折扣率后	人民币	0.00	0.00	0.00	13,738,804.95	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	大宗商品	自营-扣除折扣率前	人民币	0.00	0.00	0.00	13,738,804.95	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	大宗商品	总额-扣除折扣率后	人民币	0.00	0.00	0.00	62,603,376.41	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	大宗商品	总额-扣除折扣率前	人民币	0.00	0.00	0.00	62,603,376.41	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	利率互换	代理-扣除折扣率后	人民币	0.00	0.00	0.00	8,616,605,747.75	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	利率互换	代理-扣除折扣率前	人民币	0.00	0.00	0.00	8,616,605,747.75	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	利率互换	自营-扣除折扣率后	人民币	0.00	0.00	0.00	20,999,960,024.75	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	利率互换	自营-扣除折扣率前	人民币	0.00	0.00	0.00	20,999,960,024.75	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	利率互换	总额-扣除折扣率后	人民币	0.00	0.00	0.00	29,616,565,772.50	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	利率互换	总额-扣除折扣率前	人民币	0.00	0.00	0.00	29,616,565,772.50	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	标准债券远期	代理-扣除折扣率后	人民币	0.00	0.00	0.00	94,794,764.62	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	标准债券远期	代理-扣除折扣率前	人民币	0.00	0.00	0.00	94,794,764.62	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	标准债券远期	自营-扣除折扣率后	人民币	0.00	0.00	0.00	696,923,307.17	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	标准债券远期	自营-扣除折扣率前	人民币	0.00	0.00	0.00	696,923,307.17	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	标准债券远期	总额-扣除折扣率后	人民币	0.00	0.00	0.00	791,718,071.79	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	标准债券远期	总额-扣除折扣率前	人民币	0.00	0.00	0.00	791,718,071.79	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	代理-扣除折扣率后	美元	0.00	0.00	0.00	20,000,041.67	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	代理-扣除折扣率前	美元	0.00	0.00	0.00	20,000,041.67	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	自营-扣除折扣率后	美元	0.00	0.00	0.00	3,181,169,923.61	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	自营-扣除折扣率前	美元	0.00	0.00	0.00	3,181,169,923.61	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	总额-扣除折扣率后	美元	0.00	0.00	0.00	3,201,169,965.28	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	总额-扣除折扣率前	美元	0.00	0.00	0.00	3,201,169,965.28	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	代理-扣除折扣率后	人民币	0.00	0.00	0.00	3,055,464,350.49	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	代理-扣除折扣率前	人民币	0.00	0.00	0.00	3,206,153,568.20	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	自营-扣除折扣率后	人民币	0.00	0.00	0.00	117,408,254,651.89	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	自营-扣除折扣率前	人民币	0.00	0.00	0.00	123,198,588,302.09	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	总额-扣除折扣率后	人民币	0.00	0.00	0.00	120,463,719,002.39	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	总额-扣除折扣率前	人民币	0.00	0.00	0.00	126,404,741,870.29	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	外币对	代理-扣除折扣率后	美元	0.00	0.00	0.00	50,000.00	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	外币对	代理-扣除折扣率前	美元	0.00	0.00	0.00	50,000.00	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	外币对	自营-扣除折扣率后	美元	0.00	0.00	0.00	1,000,000.00	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	外币对	自营-扣除折扣率前	美元	0.00	0.00	0.00	1,000,000.00	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	外币对	总额-扣除折扣率后	美元	0.00	0.00	0.00	1,050,000.00	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	外币对	总额-扣除折扣率前	美元	0.00	0.00	0.00	1,050,000.00	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	外币对	代理-扣除折扣率后	人民币	0.00	0.00	0.00	77,132,688.42	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	外币对	代理-扣除折扣率前	人民币	0.00	0.00	0.00	80,936,713.98	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	外币对	自营-扣除折扣率后	人民币	0.00	0.00	0.00	6,964,651,343.59	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	外币对	自营-扣除折扣率前	人民币	0.00	0.00	0.00	7,308,133,623.91	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	外币对	总额-扣除折扣率后	人民币	0.00	0.00	0.00	7,041,784,032.01	0.00	0.00
2024-09-30	违约基金	外币对	总额-扣除折扣率前	人民币	0.00	0.00	0.00	7,389,070,337.89	0.00	0.00

披露日期	披露等级	披露等级说明	描述	货币单位	6.2.7	6.2.8	6.2.9	6.2.10	6.2.11	6.2.12	6.2.13	6.2.14	6.2.15
2024-09-30	违约基金	债券	代理-扣除折扣率后	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	5,628,263.06
2024-09-30	违约基金	债券	代理-扣除折扣率前	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	5,628,263.06
2024-09-30	违约基金	债券	自营-扣除折扣率后	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	1,264,400,497.60
2024-09-30	违约基金	债券	自营-扣除折扣率前	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	1,264,400,497.60
2024-09-30	违约基金	债券	总额-扣除折扣率后	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	1,270,028,760.66
2024-09-30	违约基金	债券	总额-扣除折扣率前	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	1,270,028,760.66
2024-09-30	违约基金	大宗商品	代理-扣除折扣率后	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	48,864,571.46
2024-09-30	违约基金	大宗商品	代理-扣除折扣率前	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	48,864,571.46
2024-09-30	违约基金	大宗商品	自营-扣除折扣率后	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	13,738,804.95
2024-09-30	违约基金	大宗商品	自营-扣除折扣率前	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	13,738,804.95
2024-09-30	违约基金	大宗商品	总额-扣除折扣率后	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	62,603,376.41
2024-09-30	违约基金	大宗商品	总额-扣除折扣率前	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	62,603,376.41
2024-09-30	违约基金	利率互换	代理-扣除折扣率后	人民币	0.00	0.00	108,230,000.00	0.00	0.00	0.00	9,379,905.19	0.00	8,734,215,652.94
2024-09-30	违约基金	利率互换	代理-扣除折扣率前	人民币	0.00	0.00	108,950,000.00	0.00	0.00	0.00	9,379,905.19	0.00	8,734,935,652.94
2024-09-30	违约基金	利率互换	自营-扣除折扣率后	人民币	0.00	0.00	7,397,690,400.00	0.00	0.00	0.00	325,883,368.73	0.00	28,723,533,793.48
2024-09-30	违约基金	利率互换	自营-扣除折扣率前	人民币	0.00	0.00	7,516,804,400.00	0.00	0.00	0.00	471,750,993.69	0.00	28,988,515,418.44
2024-09-30	违约基金	利率互换	总额-扣除折扣率后	人民币	0.00	0.00	7,505,920,400.00	0.00	0.00	0.00	335,263,273.92	0.00	37,457,749,446.42
2024-09-30	违约基金	利率互换	总额-扣除折扣率前	人民币	0.00	0.00	7,625,754,400.00	0.00	0.00	0.00	481,130,898.88	0.00	37,723,451,071.38
2024-09-30	违约基金	标准债券远期	代理-扣除折扣率后	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	94,794,764.62
2024-09-30	违约基金	标准债券远期	代理-扣除折扣率前	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	94,794,764.62
2024-09-30	违约基金	标准债券远期	自营-扣除折扣率后	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	696,923,307.17
2024-09-30	违约基金	标准债券远期	自营-扣除折扣率前	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	696,923,307.17
2024-09-30	违约基金	标准债券远期	总额-扣除折扣率后	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	791,718,071.79
2024-09-30	违约基金	标准债券远期	总额-扣除折扣率前	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	791,718,071.79
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	代理-扣除折扣率后	美元	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	20,000,041.67
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	代理-扣除折扣率前	美元	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	20,000,041.67
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	自营-扣除折扣率后	美元	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	3,181,169,923.61
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	自营-扣除折扣率前	美元	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	3,181,169,923.61
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	总额-扣除折扣率后	美元	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	3,201,169,965.28
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	总额-扣除折扣率前	美元	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	3,201,169,965.28
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	代理-扣除折扣率后	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	3,055,464,350.49
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	代理-扣除折扣率前	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	3,206,153,568.20
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	自营-扣除折扣率后	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	117,408,254,651.89
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	自营-扣除折扣率前	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	123,198,588,302.09
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	总额-扣除折扣率后	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	120,463,719,002.39
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	总额-扣除折扣率前	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	126,404,741,870.29
2024-09-30	违约基金	外币对	代理-扣除折扣率后	美元	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	50,000.00
2024-09-30	违约基金	外币对	代理-扣除折扣率前	美元	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	50,000.00
2024-09-30	违约基金	外币对	自营-扣除折扣率后	美元	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	1,000,000.00
2024-09-30	违约基金	外币对	自营-扣除折扣率前	美元	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	1,000,000.00
2024-09-30	违约基金	外币对	总额-扣除折扣率后	美元	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	1,050,000.00
2024-09-30	违约基金	外币对	总额-扣除折扣率前	美元	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	1,050,000.00
2024-09-30	违约基金	外币对	代理-扣除折扣率后	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	77,132,688.42
2024-09-30	违约基金	外币对	代理-扣除折扣率前	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	80,936,713.98
2024-09-30	违约基金	外币对	自营-扣除折扣率后	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	6,964,651,343.59
2024-09-30	违约基金	外币对	自营-扣除折扣率前	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	7,308,133,623.91
2024-09-30	违约基金	外币对	总额-扣除折扣率后	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	7,041,784,032.01
2024-09-30	违约基金	外币对	总额-扣除折扣率前	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	7,389,070,337.89

披露日期	披露等级	披露等级说明	描述	货币单位	7.1.2	7.1.3	7.1.4	7.1.5	7.1.6	7.1.7	7.1.8	7.1.9
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	合格流动性资源的规模和组	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	79,500,000,000.00	0.00	0.00
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	合格流动性资源的规模和组	美元	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	3,500,000,000.00	0.00	0.00

披露日期	披露等级	披露等级说明	描述	货币单位	7. 3. 1	7. 3. 4	7. 3. 5
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	单日付款总额	人民币	133, 978, 988, 004. 57	63, 671, 185, 444. 95	
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	多日付款	人民币	175, 276, 603, 006. 71	98, 157, 502, 458. 37	
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	单日付款	人民币			133, 115, 251, 698. 53
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	单日付款	美元			5, 818, 996, 752. 26
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	单日付款	英镑			243, 800, 000. 00
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	单日付款	日元			115, 697, 231, 950. 00
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	单日付款	欧元			753, 700, 000. 00
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	单日付款	澳元			150, 000, 000. 00
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	单日付款	港币			3, 831, 975, 870. 00

披露日期	披露等级	披露等级说明	描述	货币单位	7.3.3	7.3.7
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	超出数量	人民币	不适用	不适用

披露日期	披露等级	披露等级说明	描述	7.3.6
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	天数	不适用

披露日期	披露等级	披露等级说明	描述	16.2.8	16.2.15
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	百分比-人民币	76.64%	0.00%
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	百分比-美元	23.36%	0.00%

披露日期	披露等级	披露等级说明	描述	货币单位	16. 3. 3	16. 3. 4
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	隔夜/一天；	人民币	不适用	不适用
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	一天以上到最多一周；	人民币	不适用	不适用
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	一周以上到最多一个月	人民币	不适用	不适用
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	一个月以上到最多一年	人民币	不适用	不适用
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	一年以上到最多两年；	人民币	不适用	不适用
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	两年以上	人民币	不适用	不适用

披露日期	披露等级	披露等级说明	描述	17.3.1
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	故障持续时间	0:00:00

披露日期	披露等级	披露等级说明	描述	18.2.1	18.2.2	18.2.3	18.3.1	18.3.2	18.3.3
2024-09-30	违约基金	债券	季度均值	不适用	46.47%	67.05%	不适用	37.96%	51.15%
2024-09-30	违约基金	大宗商品	季度均值	100.00%	不适用	不适用	100.00%	不适用	不适用
2024-09-30	违约基金	利率互换	季度均值	不适用	44.09%	61.72%	不适用	63.24%	76.51%
2024-09-30	违约基金	标准债券远期	季度均值	不适用	73.07%	95.56%	不适用	51.03%	69.10%
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	季度均值	不适用	42.19%	64.61%	不适用	63.89%	77.04%
2024-09-30	违约基金	外币对	季度均值	90.58%	不适用	不适用	75.86%	不适用	不适用
2024-09-30	违约基金	债券	季度峰值	不适用	55.43%	77.55%	不适用	41.88%	54.19%
2024-09-30	违约基金	大宗商品	季度峰值	100.00%	不适用	不适用	100.00%	不适用	不适用
2024-09-30	违约基金	利率互换	季度峰值	不适用	44.52%	62.05%	不适用	64.01%	76.83%
2024-09-30	违约基金	标准债券远期	季度峰值	不适用	88.99%	100.00%	不适用	55.95%	73.45%
2024-09-30	违约基金	人民币外汇	季度峰值	不适用	43.14%	65.59%	不适用	65.64%	79.70%
2024-09-30	违约基金	外币对	季度峰值	92.09%	不适用	不适用	80.08%	不适用	不适用

披露日期	披露等级	披露等级说明	中央对手方链接	货币单位	20.1.1	20.2.1	20.4.1.1	20.4.1.2	20.4.1.3	20.4.2	20.4.3	20.5.1.1	20.5.1.2	20.6.1.1	20.6.1.2	20.7.1	20.7.2
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	不适用	人民币	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

披露日期	披露等级	披露等级说明	中央对手方链接	描述	货币单位	20.3.1
2024-09-30	中央对手方	上海清算所	不适用	扣除折扣率前	人民币	--

披露日期	披露等级	披露等级说明	描述	货币单位	23. 1. 1	23. 1. 2	23. 2. 1	23. 2. 2	23. 2. 3	23. 2. 4
2024-09-30	清算服务	债券	场外	人民币	73	51661851899. 60	54490500000. 00	债券	债券	不适用
2024-09-30	清算服务	大宗商品	场外	人民币	2	53339141. 82	0. 00	大宗商品	大宗商品	不适用
2024-09-30	清算服务	利率互换	场外	人民币	1293	118977056060. 61	33336049500000. 00	利率互换	利率互换	不适用
2024-09-30	清算服务	标准债券远期	场外	人民币	39	4372272727. 27	2910000000. 00	标准债券远期	标准债券远期	不适用
2024-09-30	清算服务	人民币外汇	场外	人民币	14318	667866436504. 14	20285762025975. 90	人民币外汇	人民币外汇	不适用
2024-09-30	清算服务	外币对	场外	美元	490	1918125307. 68	41634346429. 87	外币对	外币对	不适用

披露日期	披露等级	披露等级说明	描述	货币单位	23. 3. 1	23. 3. 2
2024-09-30	清算服务	债券	执行场所	人民币	73	51661851899. 60
2024-09-30	清算服务	大宗商品	执行场所	人民币	2	53339141. 82
2024-09-30	清算服务	利率互换	执行场所	人民币	1293	118977056060. 61
2024-09-30	清算服务	标准债券远期	执行场所	人民币	39	4372272727. 27
2024-09-30	清算服务	人民币外汇	执行场所	人民币	14318	667866436504. 14
2024-09-30	清算服务	外币对	执行场所	美元	490	1918125307. 68

备注

原则	条目	解释
原则	条目	[原则要点] & “-” & [解释]
4	4.1.1 - 4.1.3	上海清算所依次使用以下风险准备资源进行违约处置： （一）违约清算会员在涉及违约的中央对手清算业务中交纳的保证金； （二）违约清算会员在涉及违约的中央对手清算业务中交纳的清算基金； （三）不超过该违约发生前上一会计年度末上海清算所向相关清算会员公布的风险准备金总额的 10%； （四）未违约的清算会员在涉及违约的中央对手清算业务中交纳的清算基金； （五）未违约的清算会员根据上海清算所规定交纳的相关中央对手清算业务补充清算基金； （六）上海清算所剩余的风险准备金； （七）其他上海清算所指定的风险准备资源。
4	4.1.4	上海清算所开展信用类衍生品、标准利率互换、中央债券借贷、通用回购的清算业务，本次暂不披露相关明细数据，下同。
4	4.1.8	补充清算基金份额不大于其应缴纳的清算基金份额。
4	4.2.1	上海清算所使用交易对手信用风险计量标准方法计算K _{CCP} 。
4	4.3.4, 4.3.15	无适用折扣率。
6	6.2.1 - 6.2.15	使用保证金账户余额。
6	6.3.1	无单个合约初始保证金率，故不适用。
6	6.4.2, 6.4.4, 6.4.6, 6.4.8, 6.4.12	未发生变化，故不适用。
6	6.4.9 - 6.4.10	未做调整，故不适用。
6	6.4.14	利率互换、人民币外汇、外币对、债券业务风控参数指资信因子；大宗商品的风控参数指保证金要求。
6	6.5.2	大宗商品业务和标准债券远期业务均为回溯期活跃账户总数。
7	7.1.7	无担保的承诺的信用额度指无需提供担保的商业银行授信额度和商业银行外币授信额度。
13	13.1.1 - 13.1.4	未发生违约事件，故不适用。
16	16.2.16 - 16.2.19	未投资以上证券，故不适用。
16	16.3.3 - 16.3.4	不允许再抵押，故不适用。
20	20.1.1-20.7.2	上海清算所开展“互换通”业务，暂不披露相关明细数据。