

标准债券远期集中清算系统操作手册 (会员终端)

目录

1	前言	3
1.1	概述	3
1.2	内容简介	3
2	用户与权限管理	5
2.1	用户登录	5
2.2	密码修改	5
2.3	用户管理	6
2.4	机构证书管理	13
3	实时监测	16
3.1	实时风控查询	16
4	基础信息查询	18
4.1	合约信息查询	18
4.2	公告信息查询	19
4.3	持仓限额查询	20
4.4	费用参数查询	22
4.5	结算价查询	22
4.6	利息清单查询	23
4.7	当月可交割合约信息查询	24
4.8	基准债券查询	26
4.9	可交割债券查询	27
5	统计查询	28
5.1	交易数据查询	28
5.2	历史持仓查询	30
5.3	交割持仓查询	31
5.4	保证金结算清单查询	32
5.5	交割资金结算清单查询	34
5.6	季度费用单据查询	35
5.7	通知单下载	36
5.8	费用明细查询	38
5.9	其他费用查询	39
5.10	历史交割信息查询	40
6	会员报价	41
6.1	远期合约报价	41
6.2	主要期限点报价	43
7	资金结算账户管理	46
7.1	资金提取	46
7.2	资金提取复核查询	47

1 前言

1.1 概述

本文档为上海清算所会员机构提供使用标准利率衍生品集中清算业务会员终端系统的使用说明。

1.2 内容简介

本文档介绍了上海清算所标准利率衍生品集中清算会员终端系统的主要功能和使用方法。

章节	内容
1 前言	主要介绍客户端基本情况
2 用户与权限管理	主要用于首席操作员进行用户岗位设置管理
3 实时监测	主要用于普通操作员进行实时风控监测
4 基础信息查询	主要用于普通操作员进行基础信息查询
5 统计查询	主要用于普通操作员进行统计信息查询
6 会员报价	主要用于普通操作员进行查询报价与设置报价

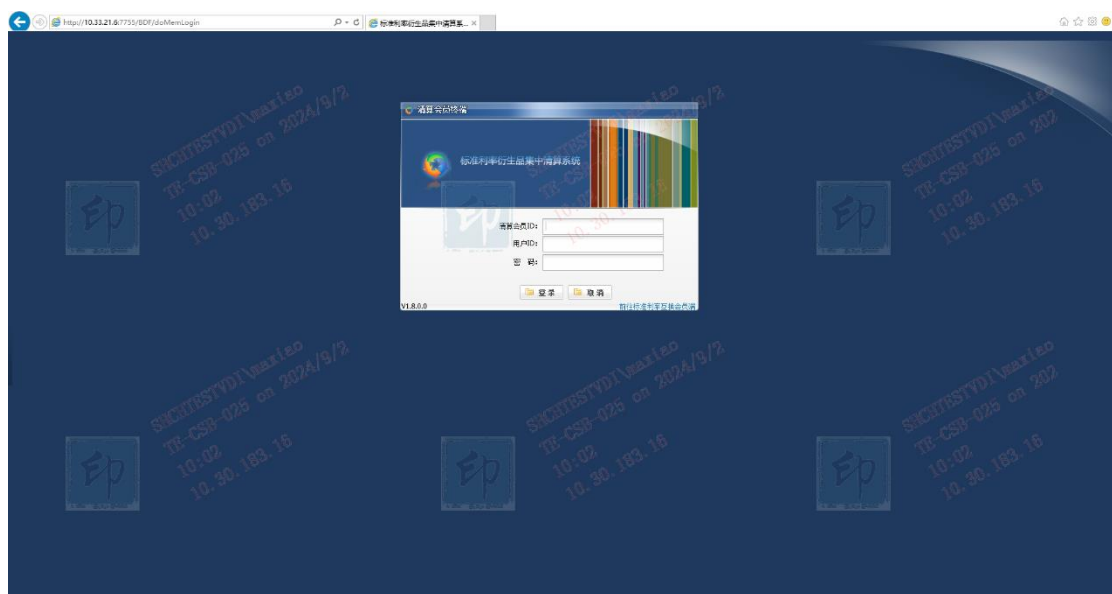
7 资金结算账户管理

主要用于普通操作员进行资金提取操作与资金提取记录查询

2 用户与权限管理

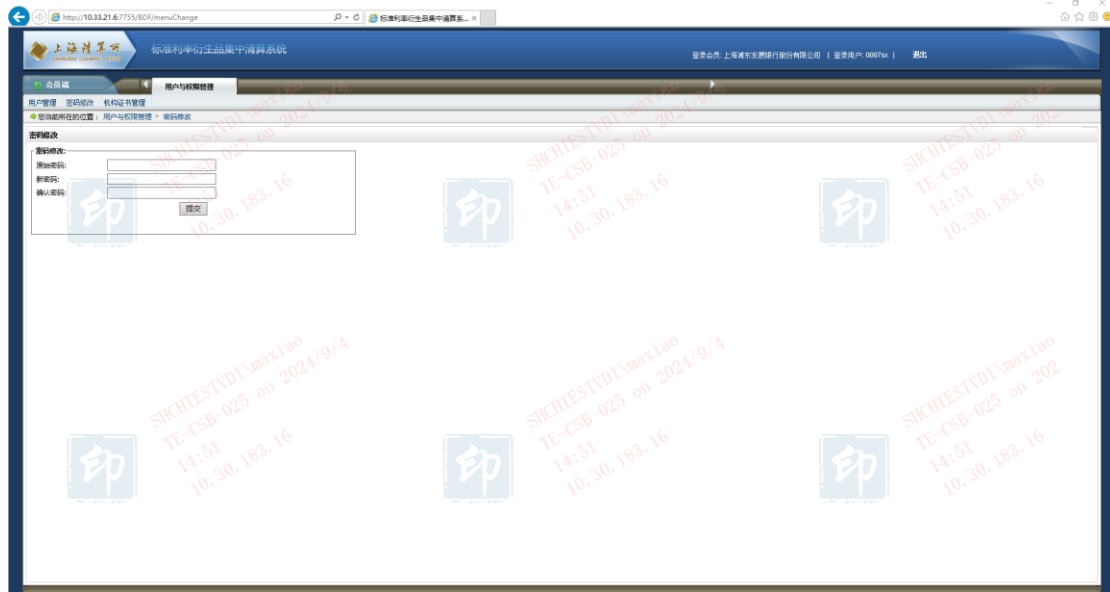
2.1 用户登录

使用 IE 浏览器进入会员端界面后，首席管理员输入：清算会员 ID、用户 ID、密码。点击登录，选择正确的证书，即登录会员端界面。点击取消，可清空清算会员 ID、用户 ID、密码框中的数据。（登录界面可点击链接前往标准利率互换会员端）



2.2 密码修改

1. 若修改密码，点击“用户与权限管理”>“密码修改”进行操作。输入原始密码、新密码和确认密码后，点击提交完成操作。

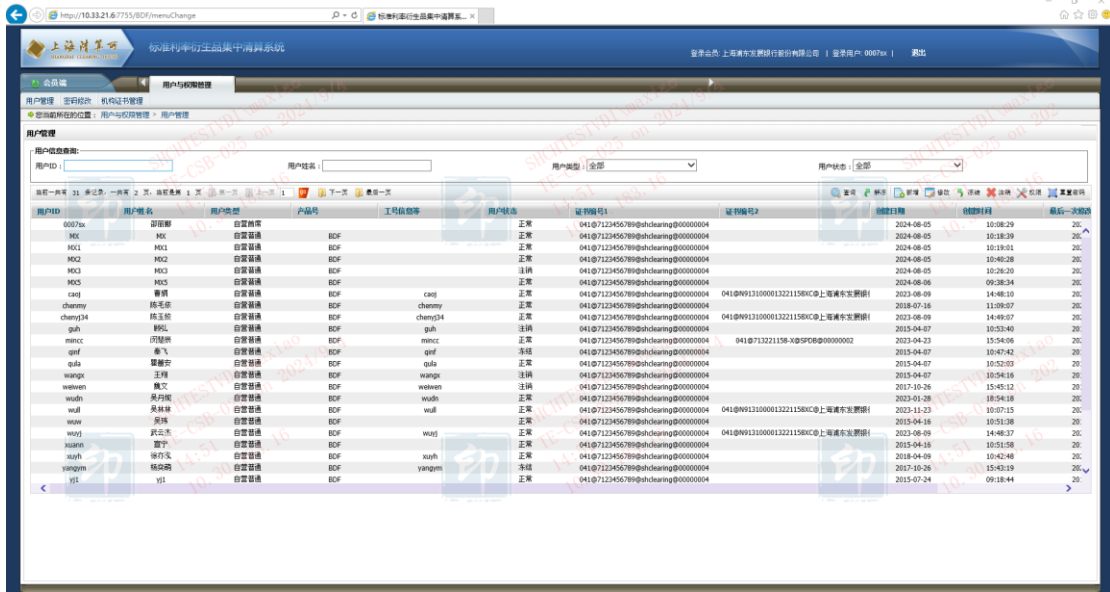


2.3 用户管理

打开页面：“用户与权限管理” > “用户管理”（仅首席用户可打开）。

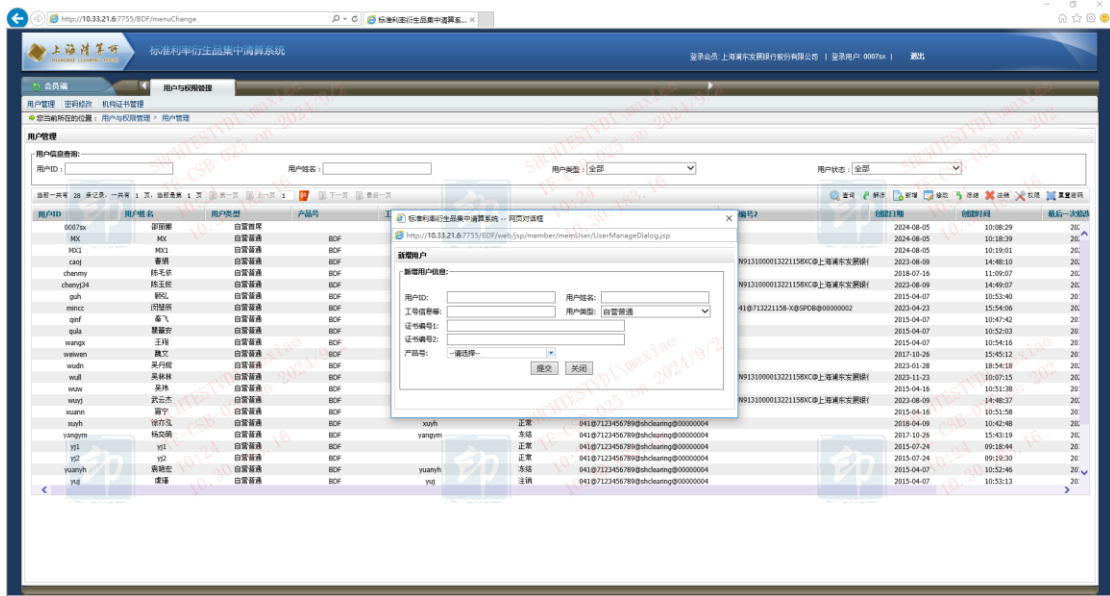
1. 查询：

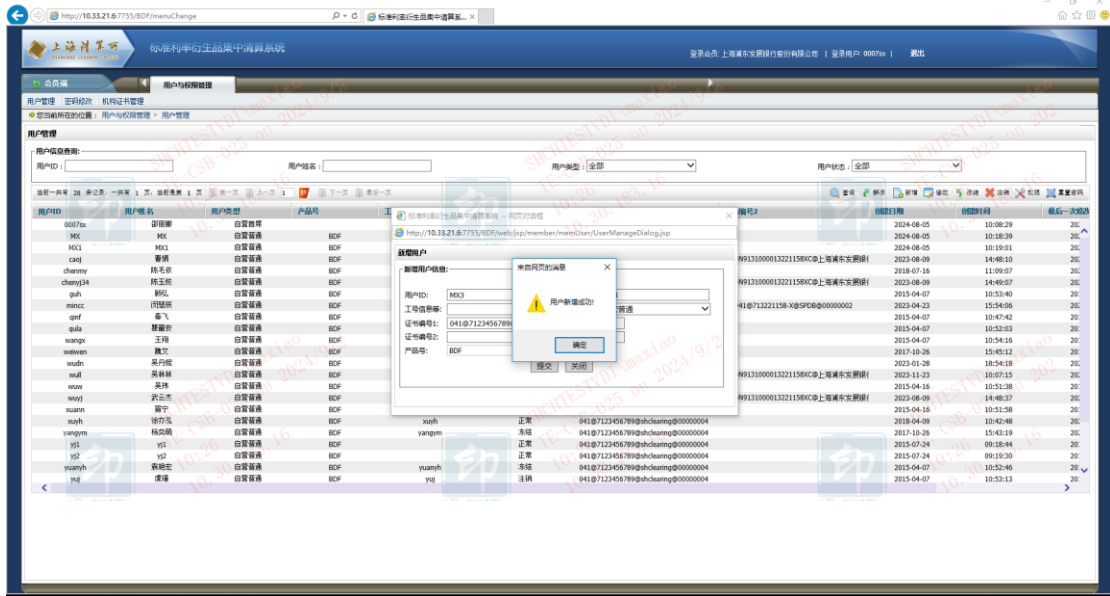
点击查询，可显示现有所有普通和首席操作员，也可输入条件筛选后查询。支持用户 ID、用户姓名模糊查询，用户类型、用户状态下拉框选择查询。



2. 新增:

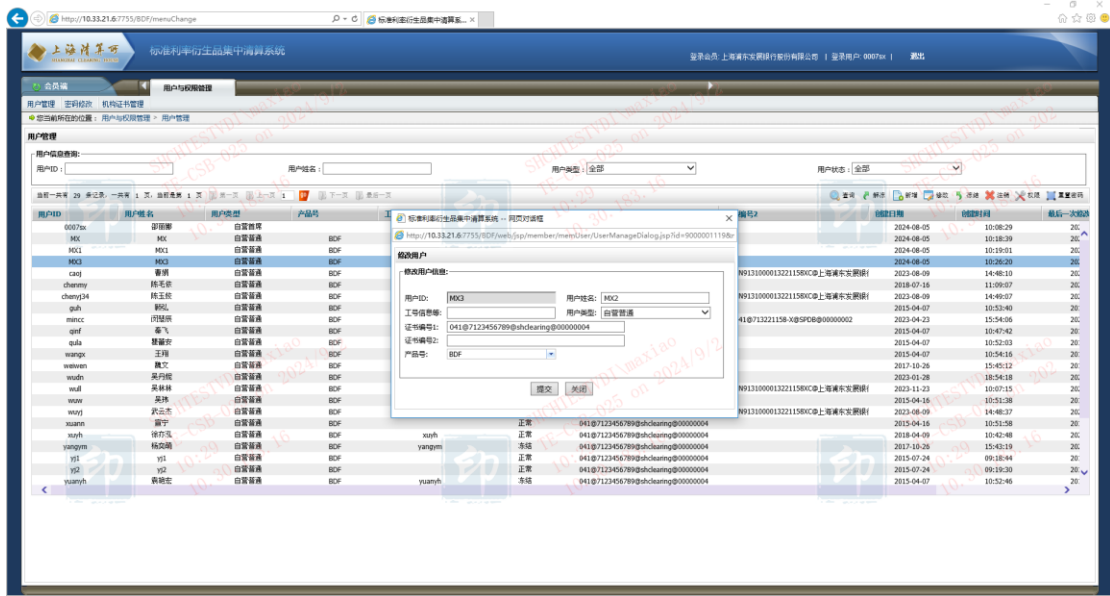
点击新增键后，输入用户 ID（必填）、用户姓名（必填）、工号信息等（选填），点击提交，提示普通用户新增成功。

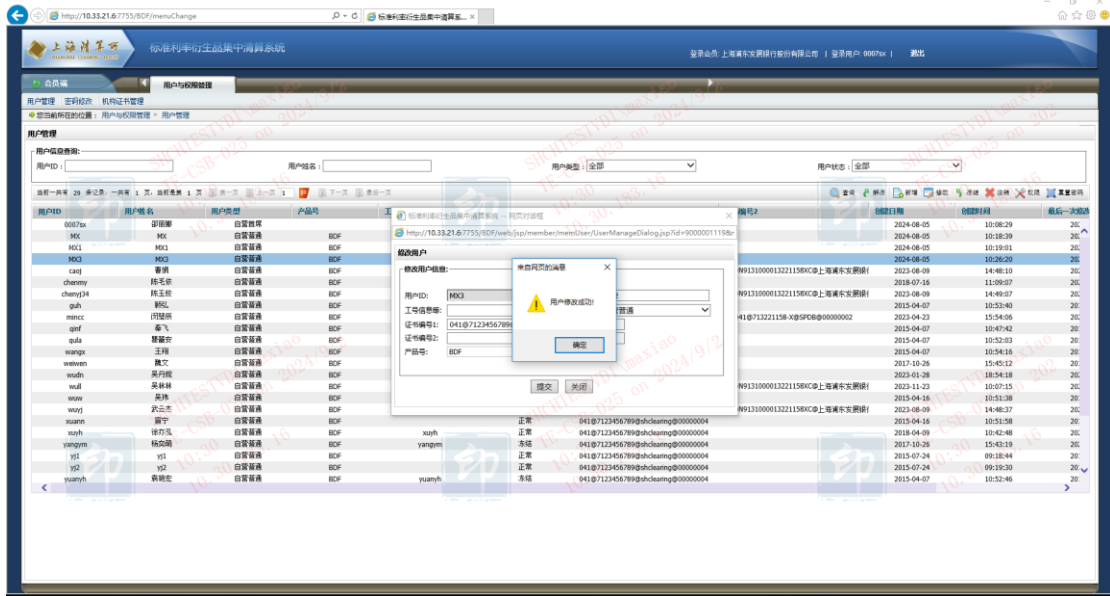




3. 修改:

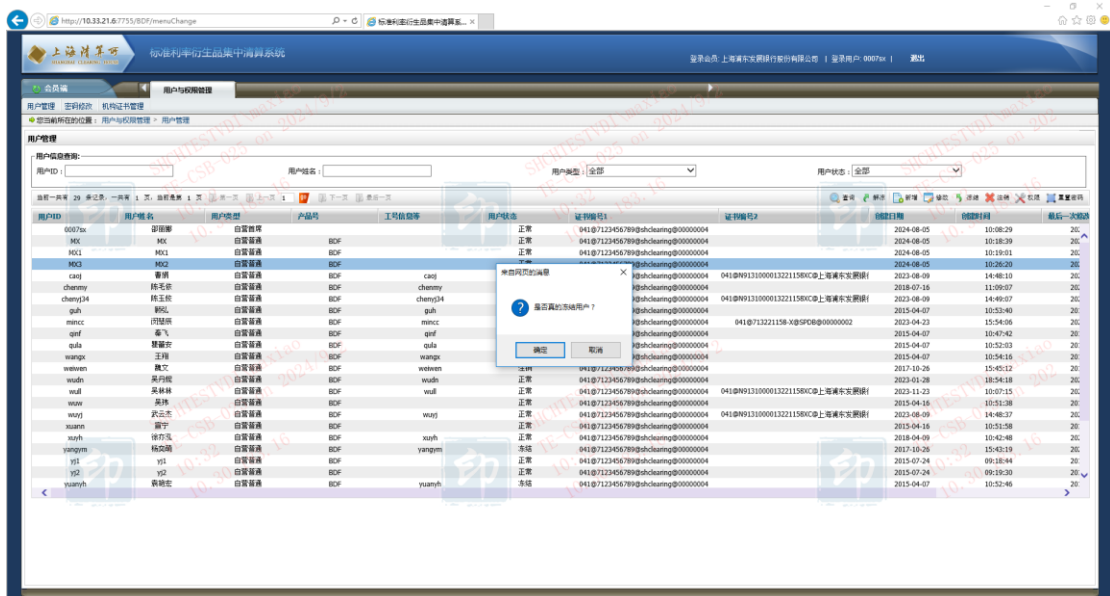
选择一条用户状态为非注销的用户信息，点击修改键可编辑其用户姓名和工号信息等内容，点击提交，提示用户修改成功。

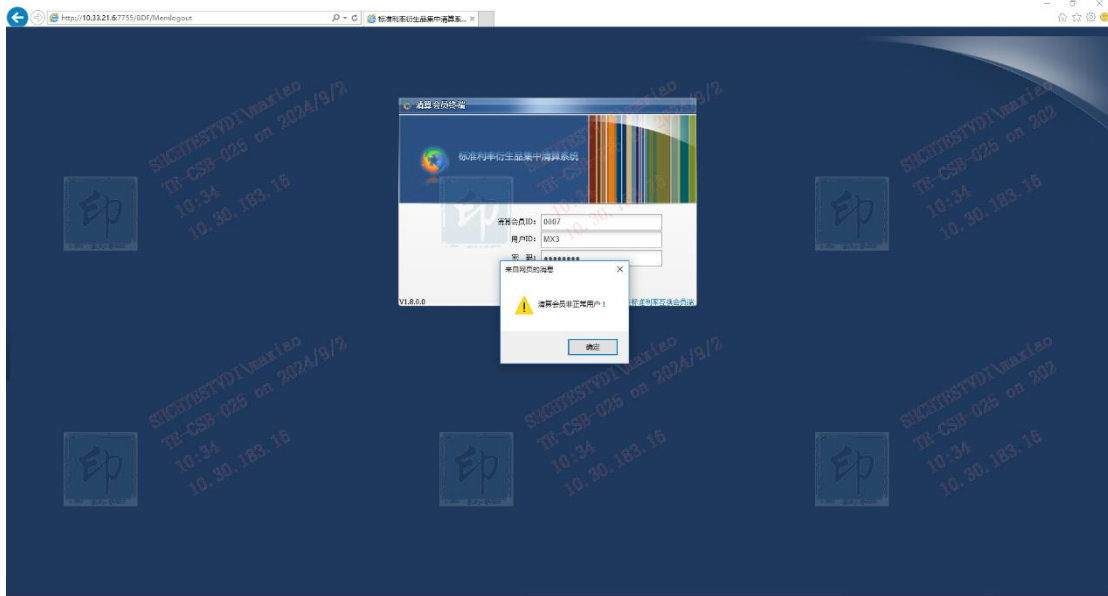
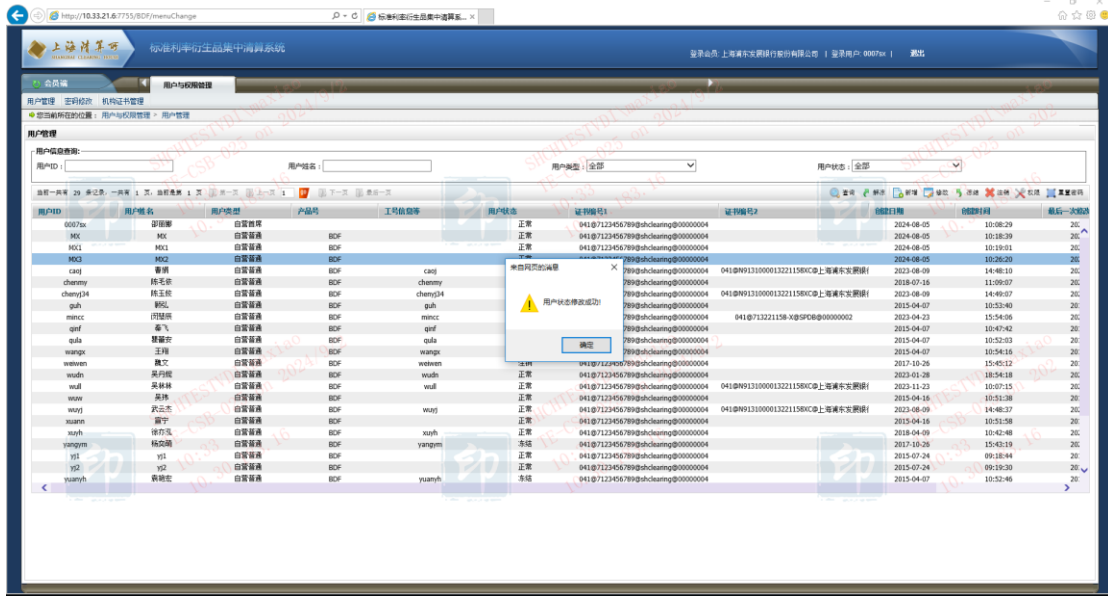




4. 冻结:

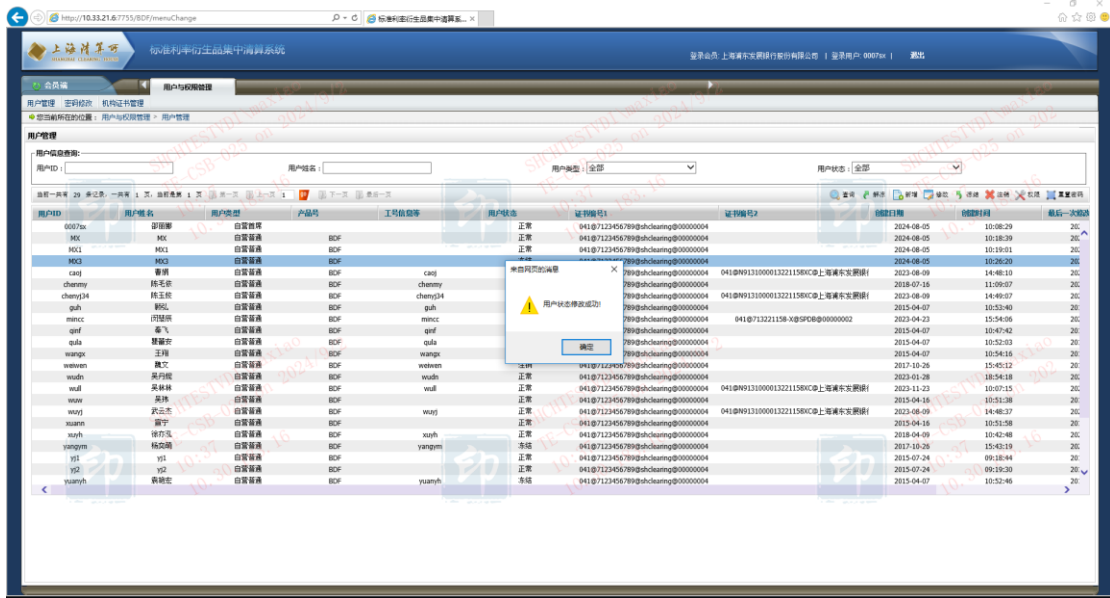
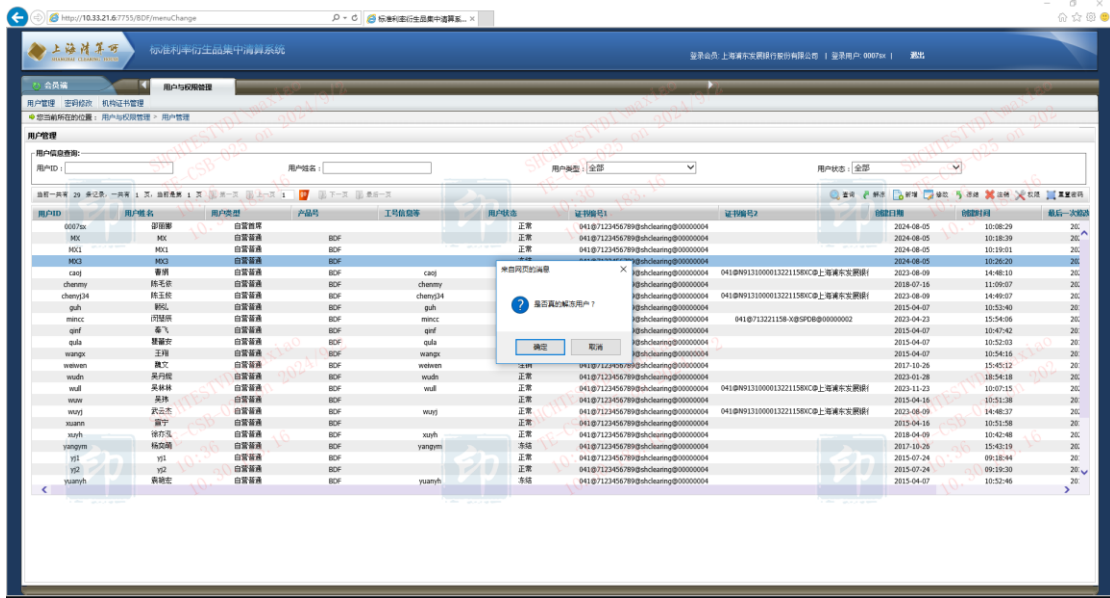
选择一条用户状态为正常的用户信息，点击冻结键后系统提示“是否真的冻结用户？”，点击确定键即完成冻结操作。冻结用户将无法登录，提示非正常用户，登录失败，解冻后可恢复正常登录。





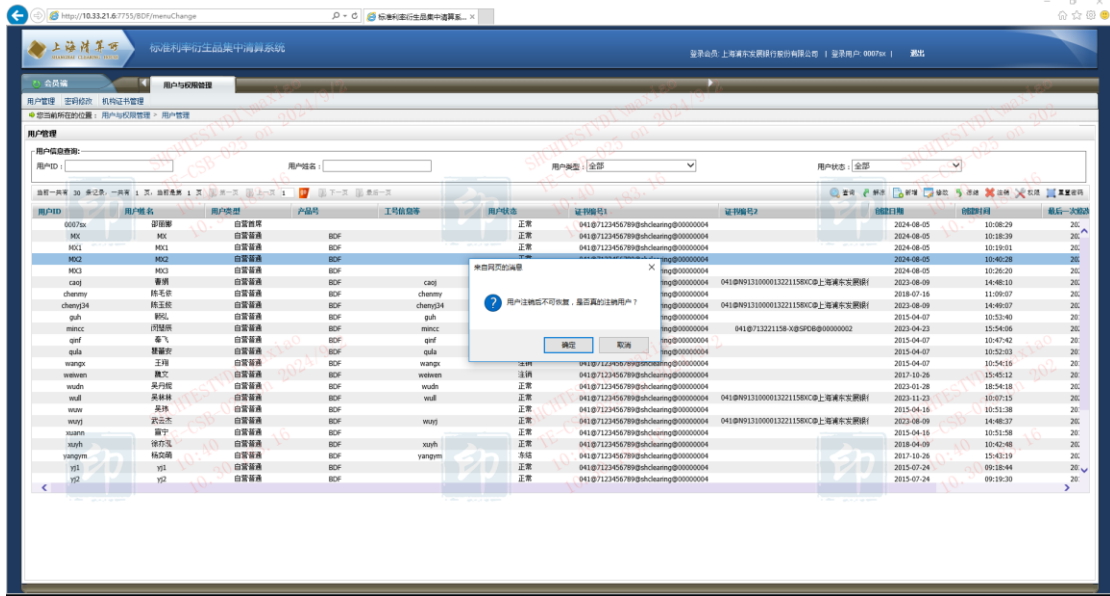
5. 解冻:

选择一条用户状态为冻结的用户信息，点击解冻键后系统提示“是否真的解冻该用户？”，点击确认键后提示“用户状态修改成功”。



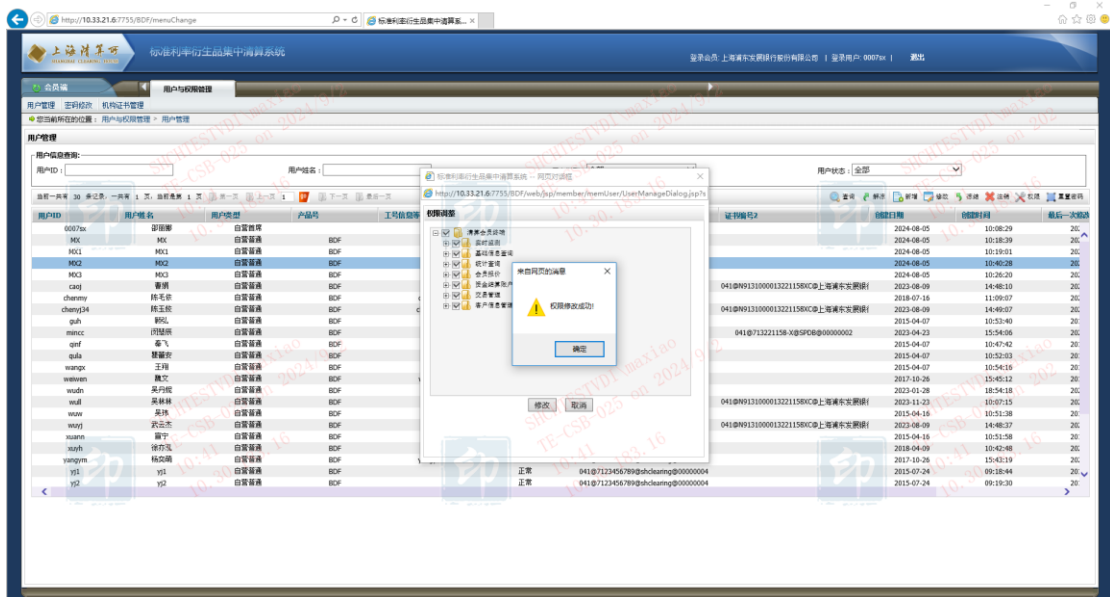
6. 注销:

选择一条状态为非注销的用户信息，系统提示“用户注销后不可恢复，是否真的注销用户？”，点击确认键后，提示用户状态修改成功，则该用户将注销无法登录。



7. 权限:

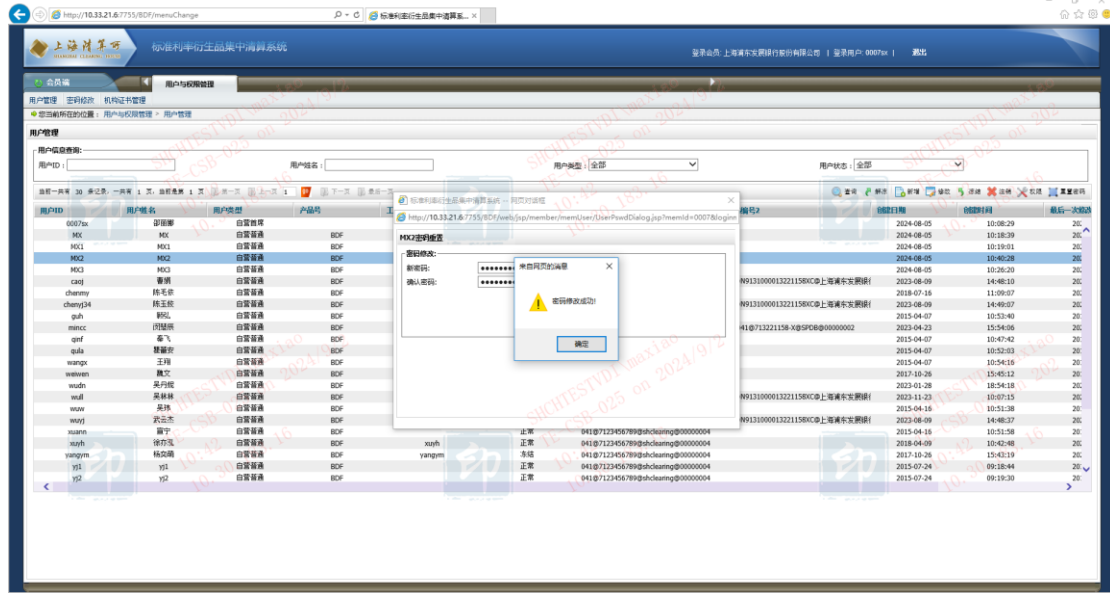
选择一条普通会员信息条目，点击权限，对需要开通的权限打勾，点击修改键，系统提示“权限修改成功”，完成权限分配操作。



8. 重置密码:

选择一条需要重置密码的普通会员信息，点击重置密码键，

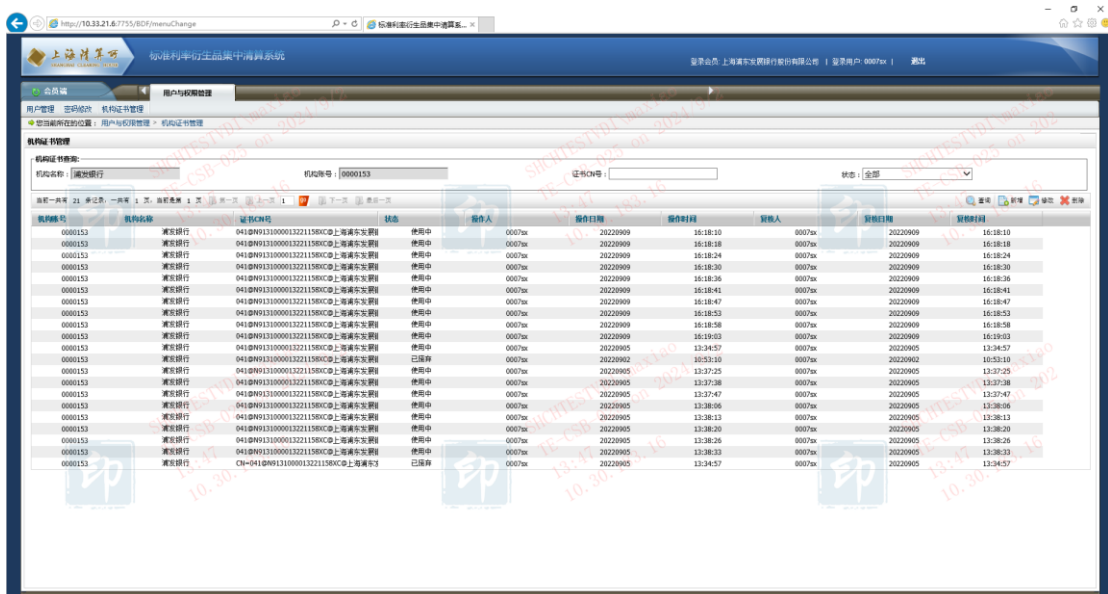
输入新密码、确认密码（密码为 8 位到 10 位），点击提交键，系统提示“修改密码成功”，则该普通会员密码重置成功。



2.4 机构证书管理

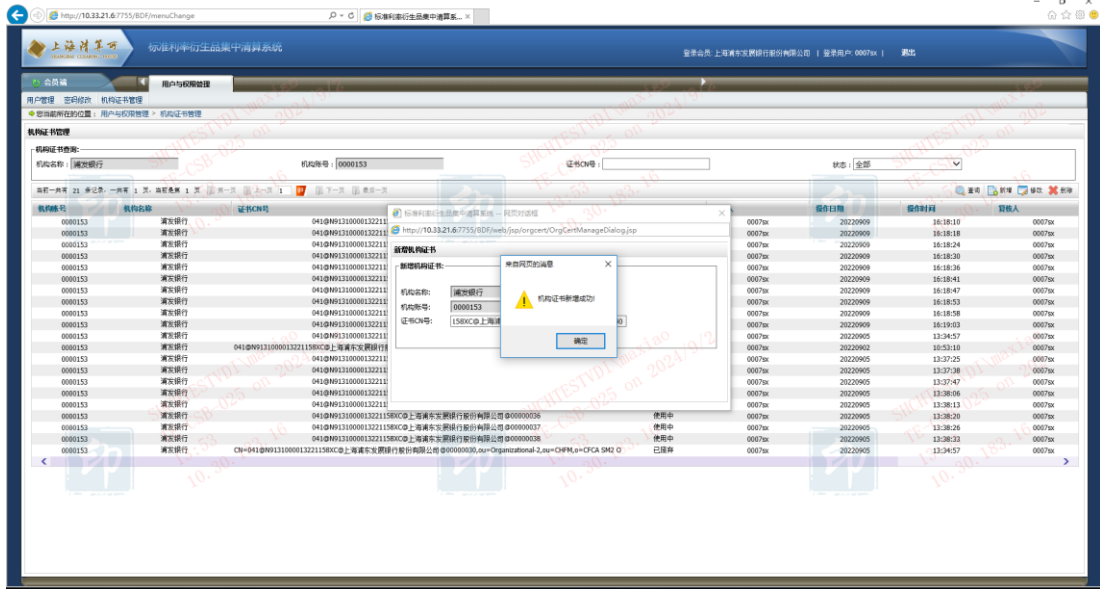
1. 查询：

点击查询，即可查询机构证书信息。



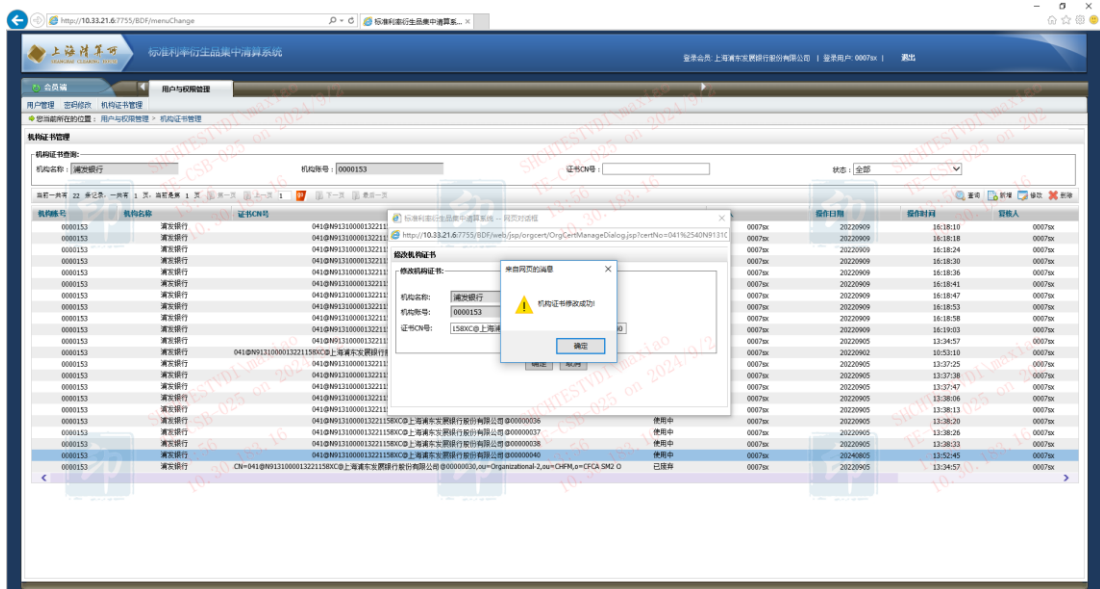
2. 新增:

点击新增键后, 输入机构名称 (默认), 机构账号 (默认)、证书 CN 号, 点击提交, 提示机构证书新增成功。



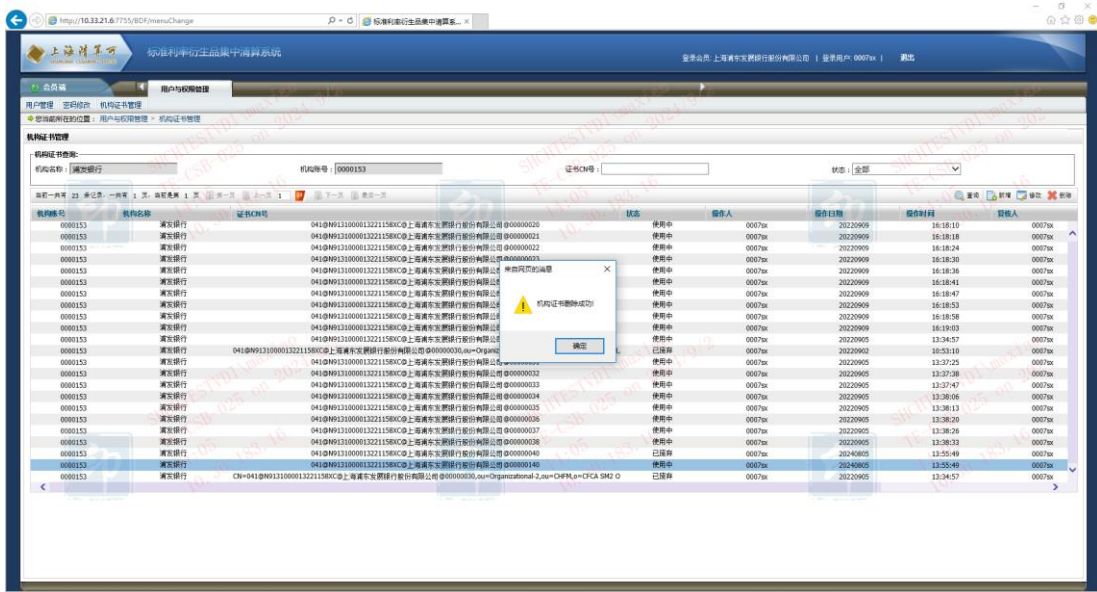
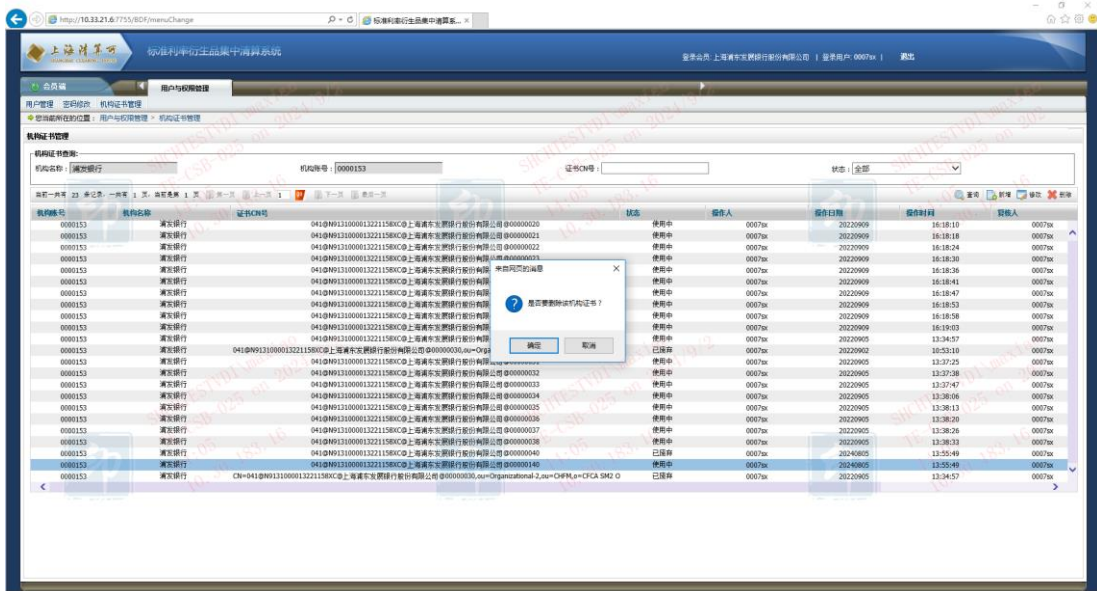
3. 修改:

选择一条用户状态为使用中的机构证书, 点击修改键可编辑其证书 CN 号, 点击提交, 提示机构证书修改成功。



4. 删除:

点击删除键, 删除机构证书。

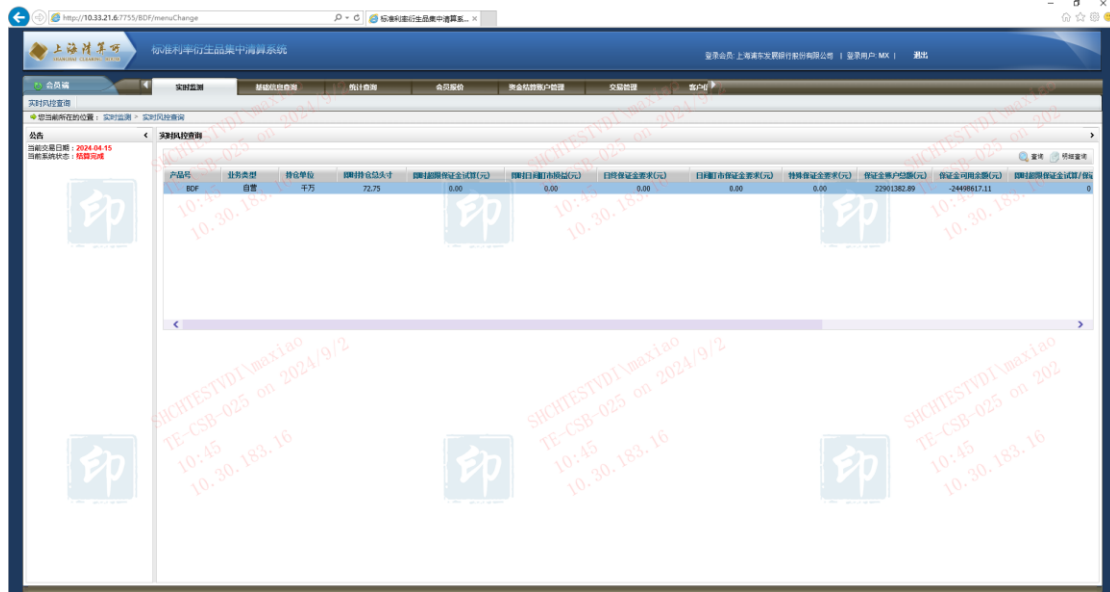


3 实时监测

3.1 实时风控查询

1. 查询：

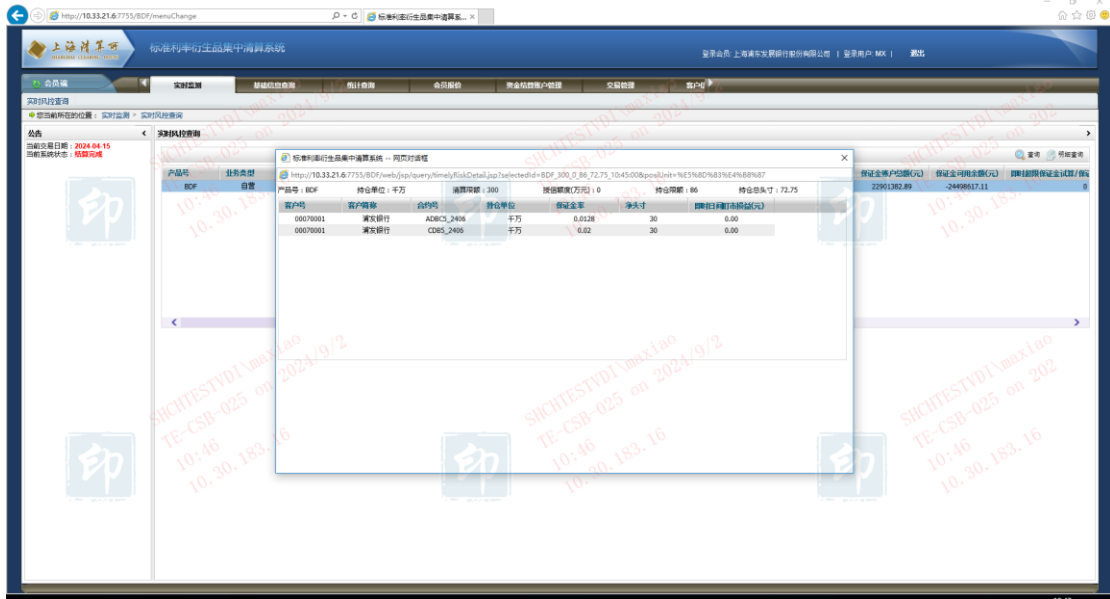
点击查询键，即可查询出实时风控信息。



产品号	业务类型	单位名称	质押持仓总头寸	质押非融资保证金(万元)	质押非融资(非融资)(万元)	日终保证金需求(万元)	日终融市保证金需求(万元)	特准保证金需求(万元)	保证金账户余额(万元)	质押融资保证金(万元)
BCF	自营	千万	72.75	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	2291382.89	24498617.11

2. 明细查询：

点击明细查询键，即可查询实时风控明细。



公告
 当前收盘日期: 2024-04-15
 当前系统状态: 正常

产品代码: BCF
 业务类型: 日常

产品号	客户名称	合约号	清算单位	清算币种	清算日期	净头寸	质押品(人民币)	质押品(美元)
00070001	浦发银行	AD05_2405	千万	人民币	2024-04-15	0.0128	30	0.00
00070001	浦发银行	CD05_2405	千万	人民币	2024-04-15	0.62	30	0.00

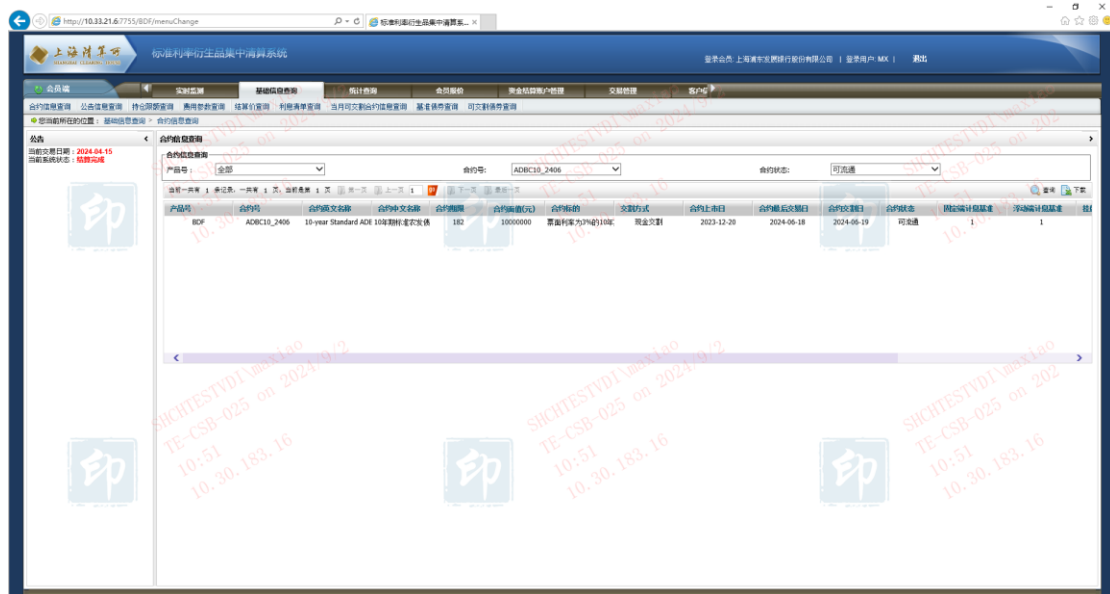
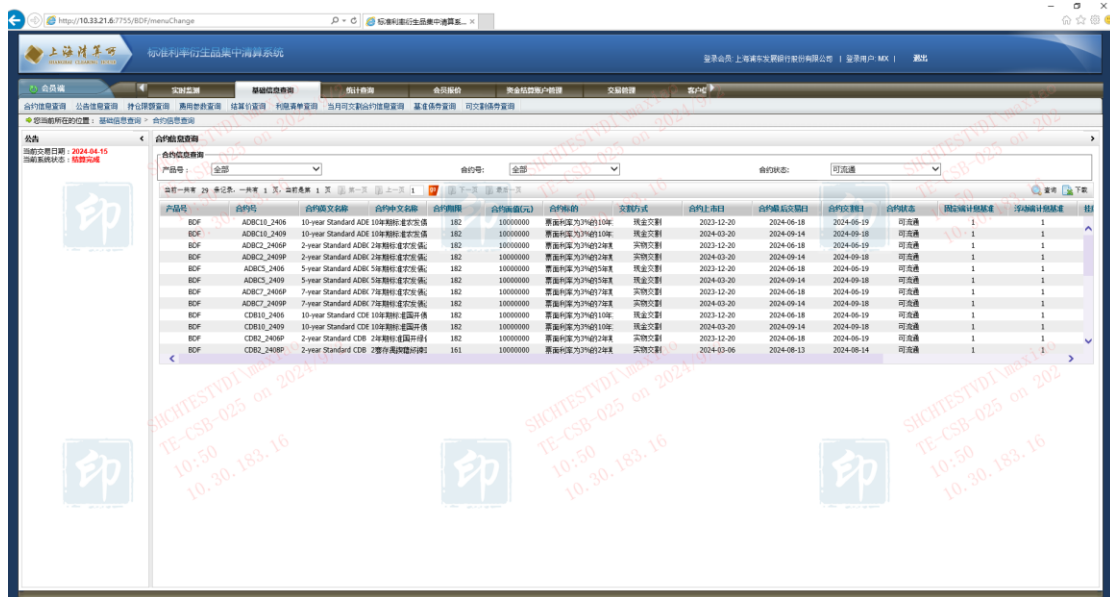
清算单位: 千万
 清算币种: 人民币
 清算日期: 2024-04-15
 净头寸: 0.6328
 质押品(人民币): 60
 质押品(美元): 0

4 基础信息查询

4.1 合约信息查询

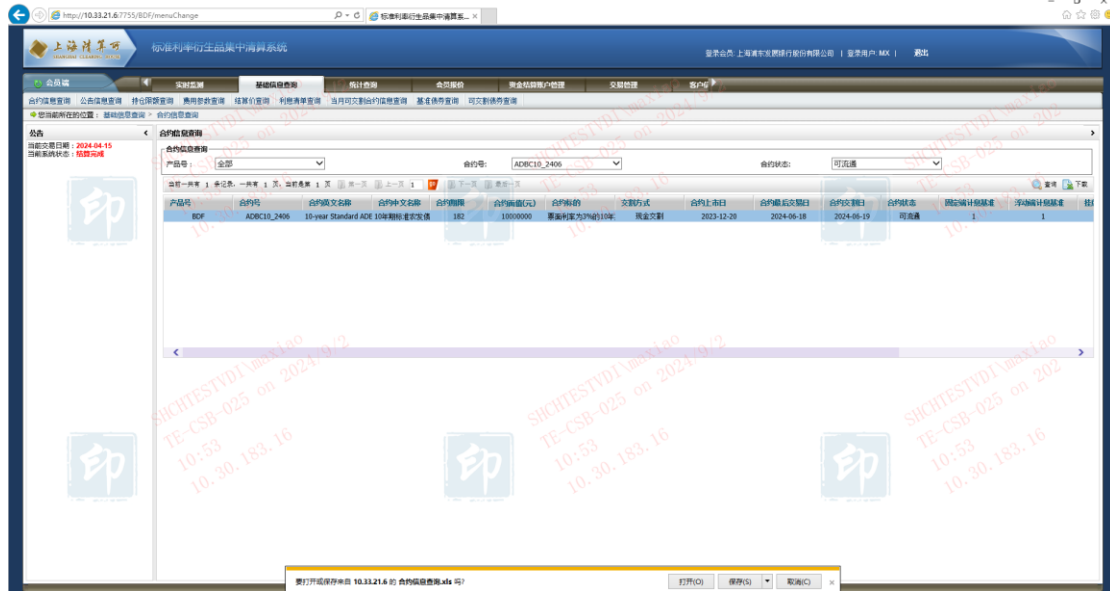
1. 查询：

选择筛选条件点击查询，可查询合约信息。支持产品号与合约号、合约状态下拉框条件选择查询。



2. 下载:

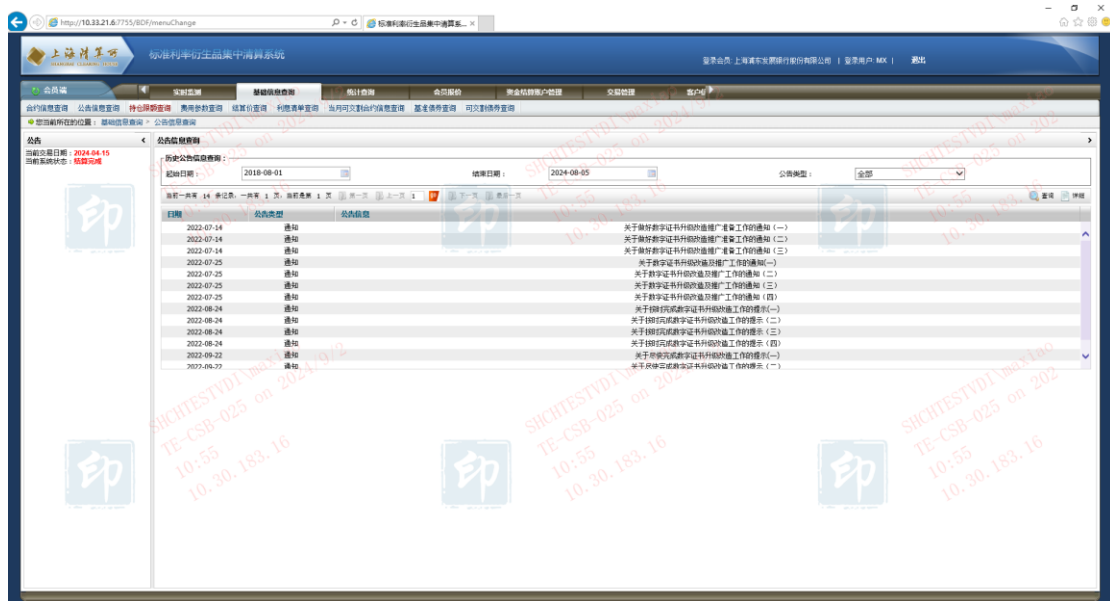
点击下载键即可下载查询出的合约信息:



4.2 公告信息查询

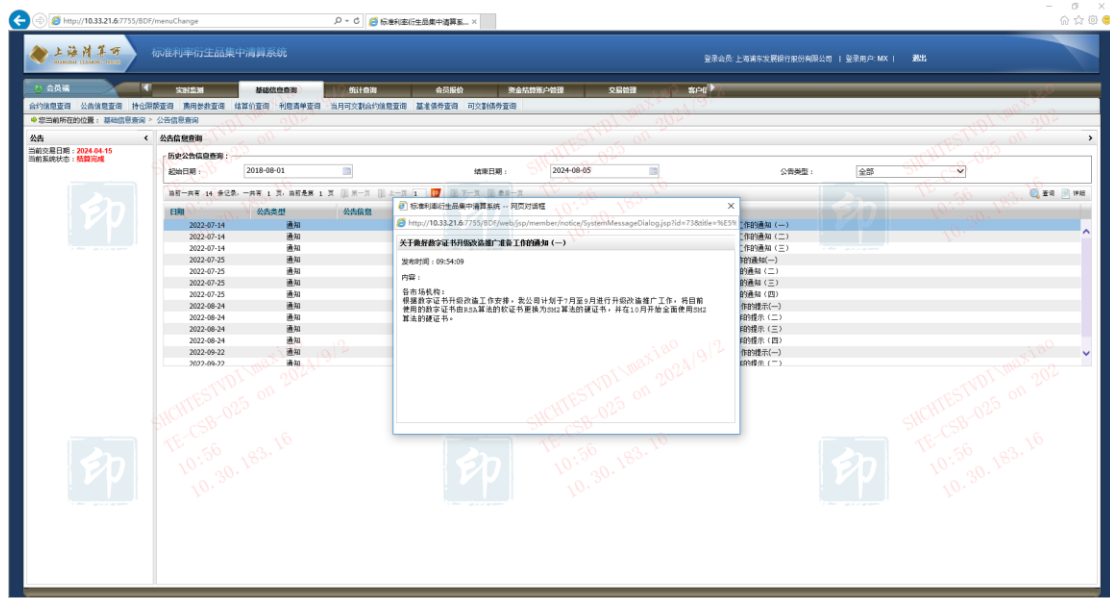
1. 查询:

输入需要查询的开始日期、结束日期、公告类型，点击查询，则可查询该时间段内公告信息。



2. 详细:

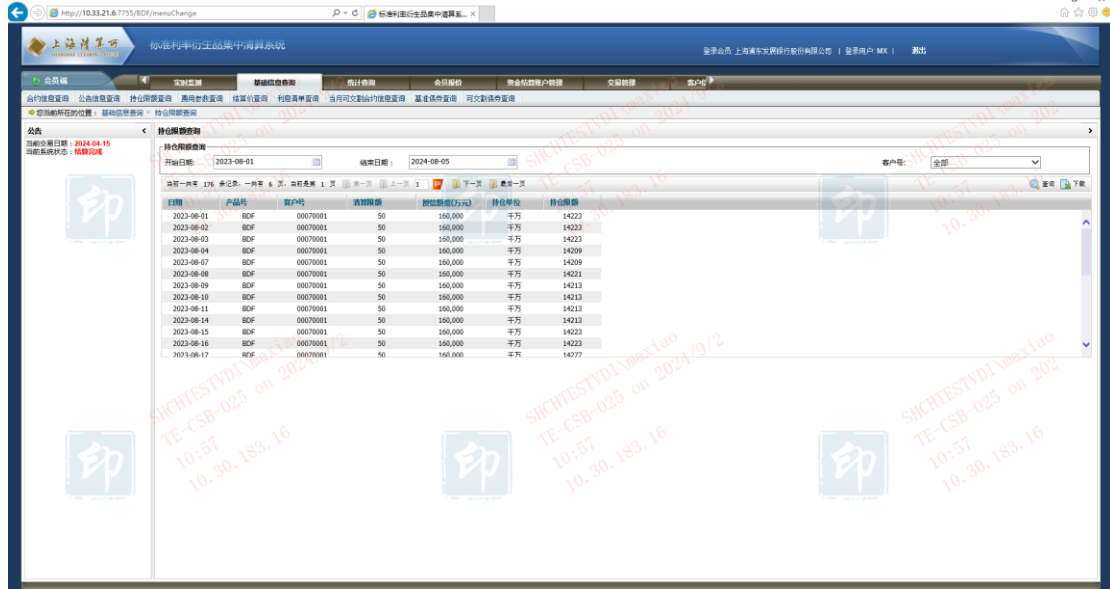
选择需要查看的公告信息条目，点击详细键，即可察看发布时间和内容。



4.3 持仓限额查询

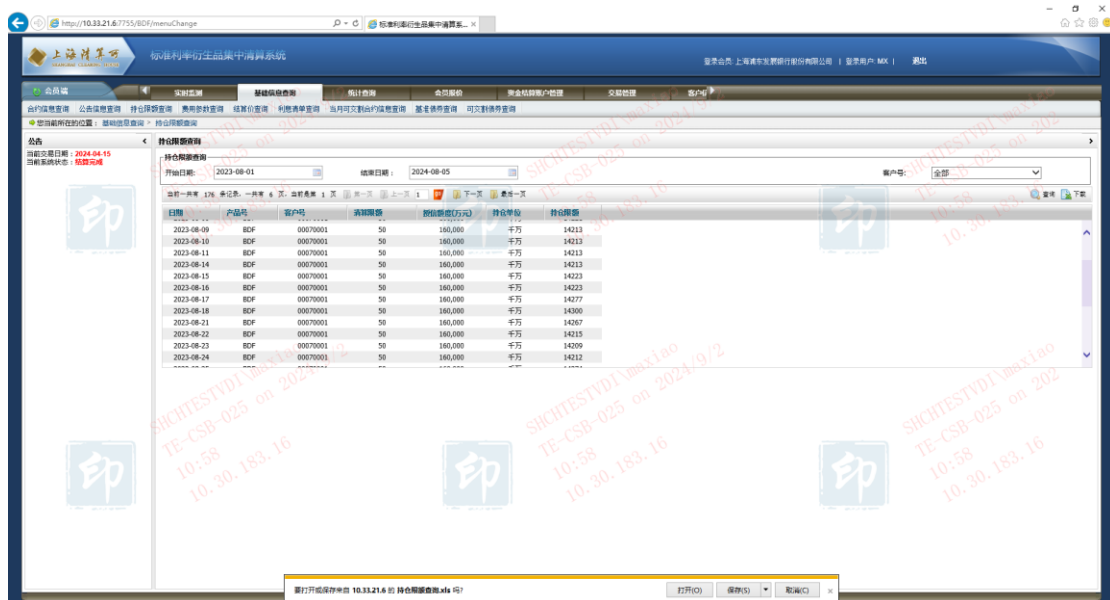
1. 查询:

输入需要查询的开始日期和结束日期，下拉框选择客户号，点击查询键，即可查询该时间段内客户的持仓限额。



2. 下载:

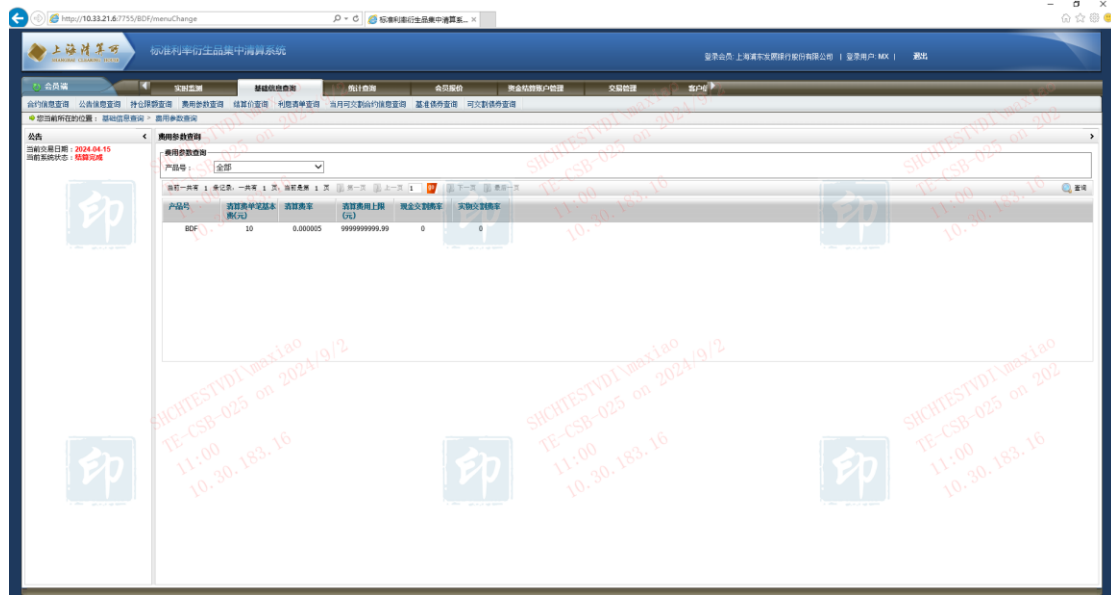
点击下载键即可下载查询出的持仓限额:



4.4 费用参数查询

1. 查询：

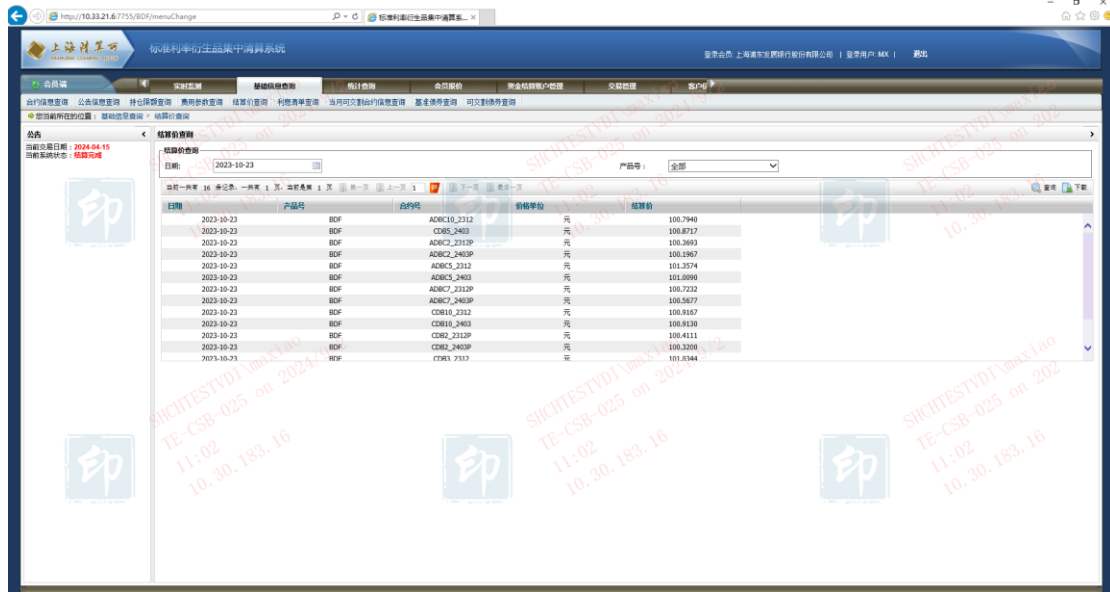
下拉框选择产品号，点击查询，即可查询出对应产品的费用参数。



4.5 结算价查询

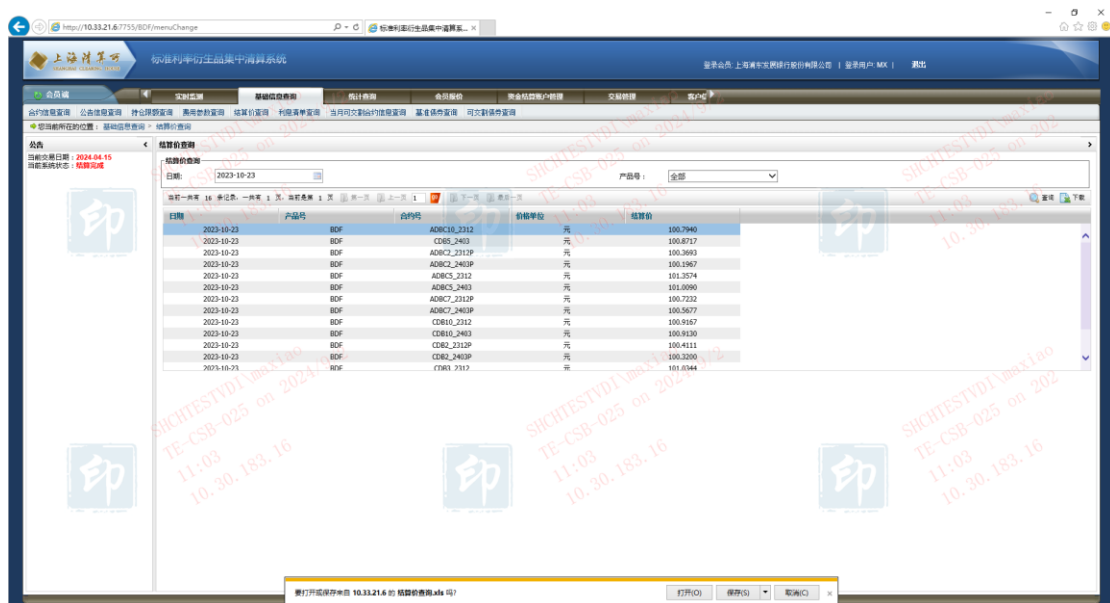
1. 查询：

选择需要查询的日期和产品号，点击查询键，即可查询出该日期各个合约的结算价。



2. 下载:

点击下载键即可下载查询出的结算价:

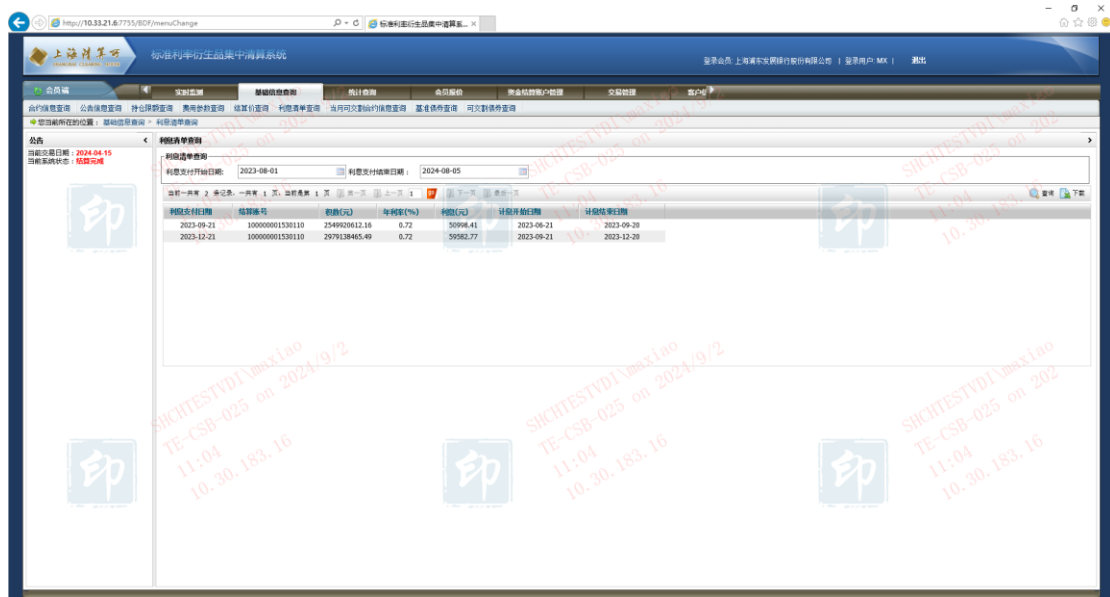


4.6 利息清单查询

1. 查询:

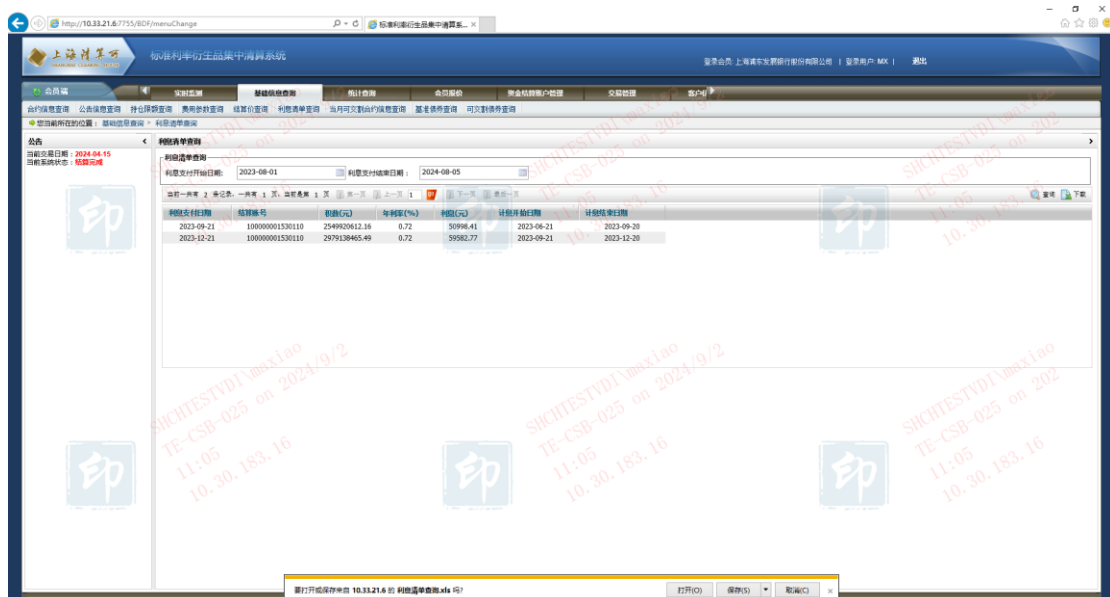
选择需要查询的利息支付开始日期和结束日期, 点击查询键, 即

可查询出利息清单。



2. 下载:

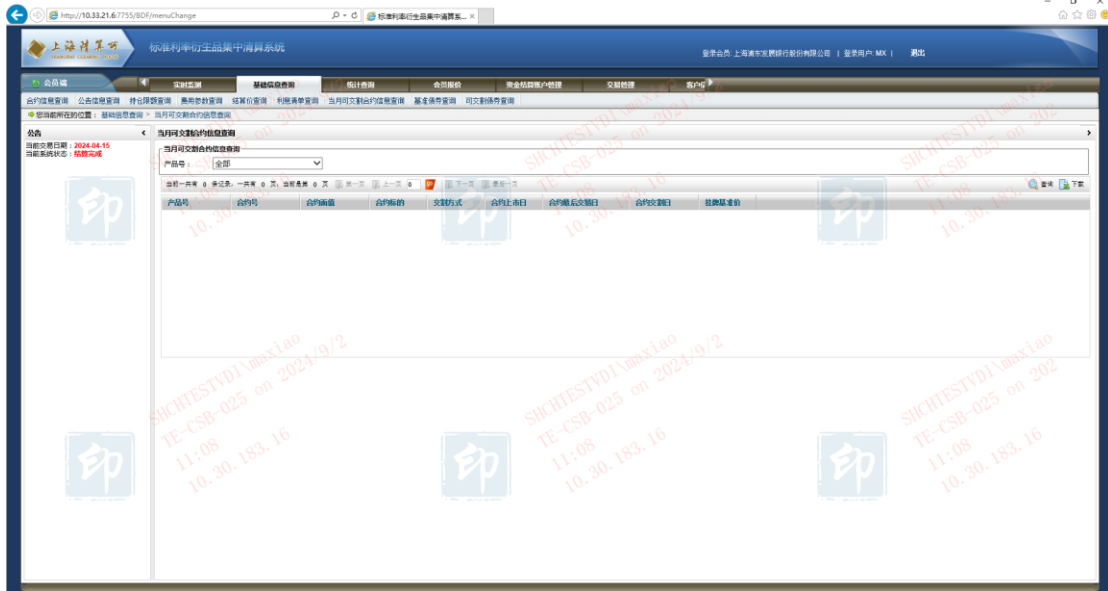
点击下载键即可下载查询出的利息清单:



4.7 当月可交割合约信息查询

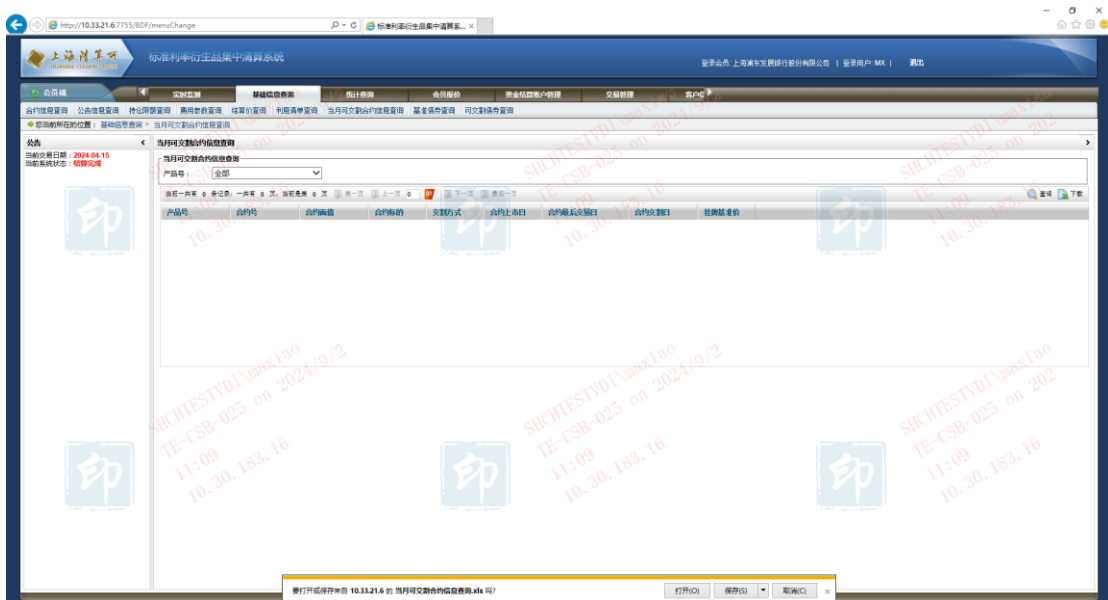
1. 查询:

选择需要查询的产品号，点击查询键，即可查询出当月可交割合约信息。



2. 下载:

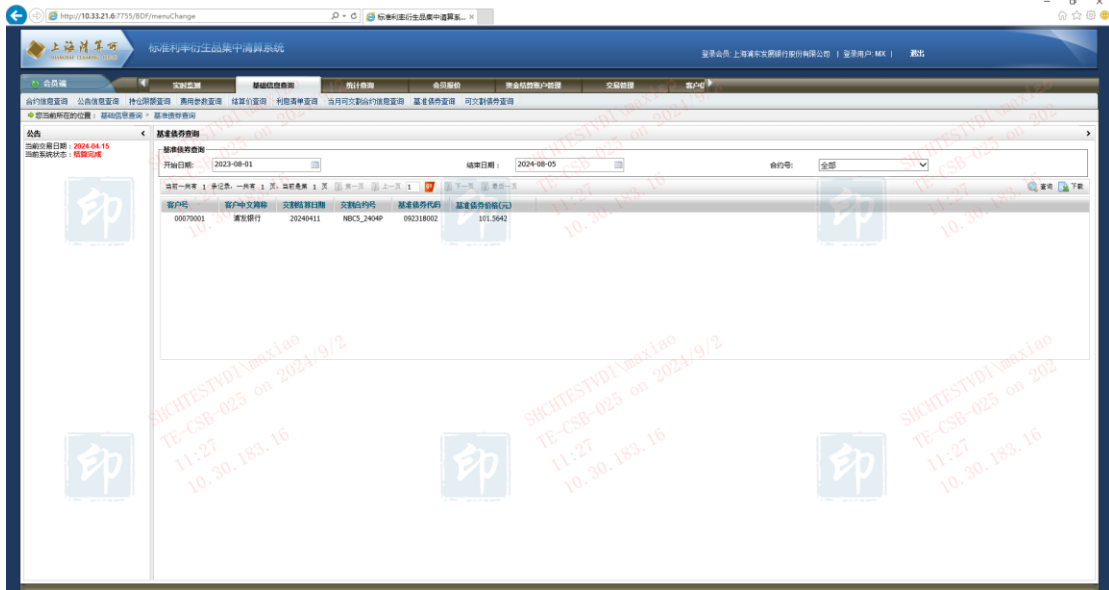
点击下载键即可下载查询出的当月可交割合约信息:



4.8 基准债券查询

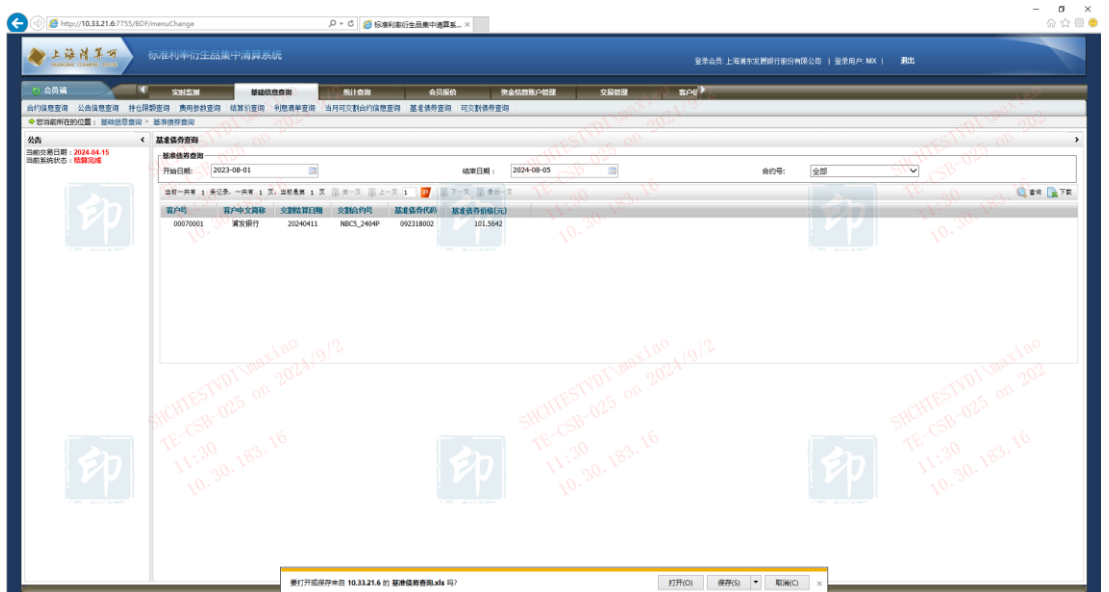
1. 查询：

选择开始日期，结束日期，合约号，点击查询键即可查询出基准债券信息。



2. 下载：

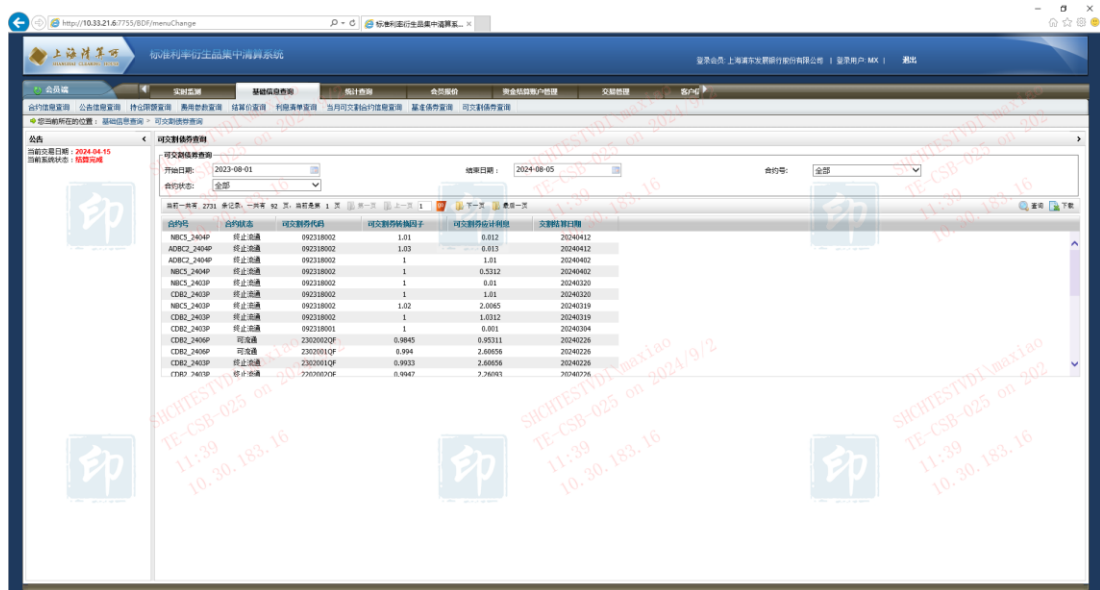
点击下载键即可下载查询出的基准债券信息：



4.9 可交割债券查询

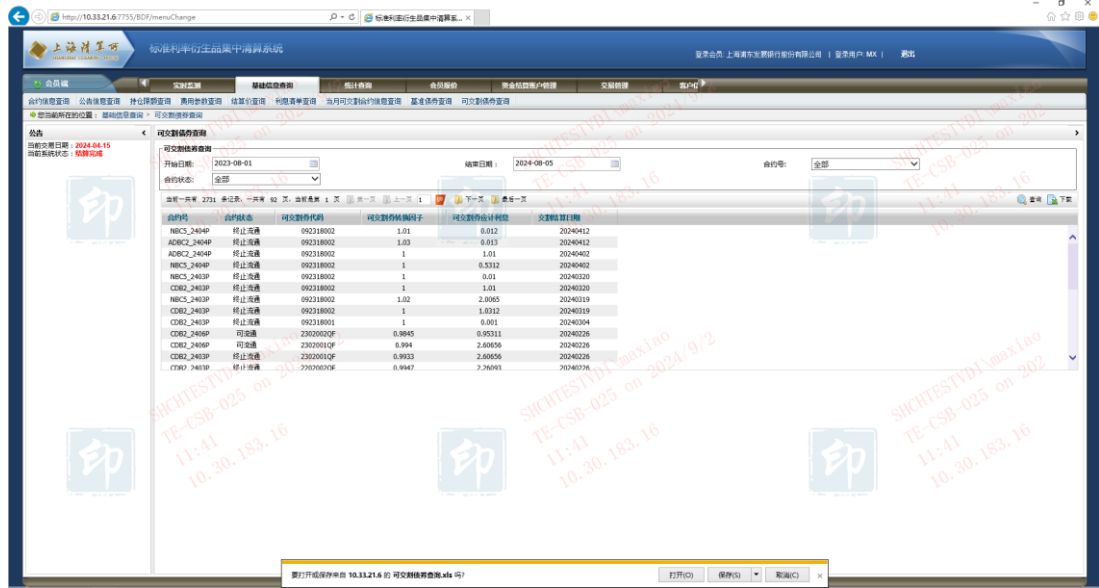
1. 查询：

选择开始日期，结束日期，合约号，合约状态，点击查询键即可查询出可交割债券信息。



2. 下载：

点击下载键即可下载查询出的可交割债券信息：

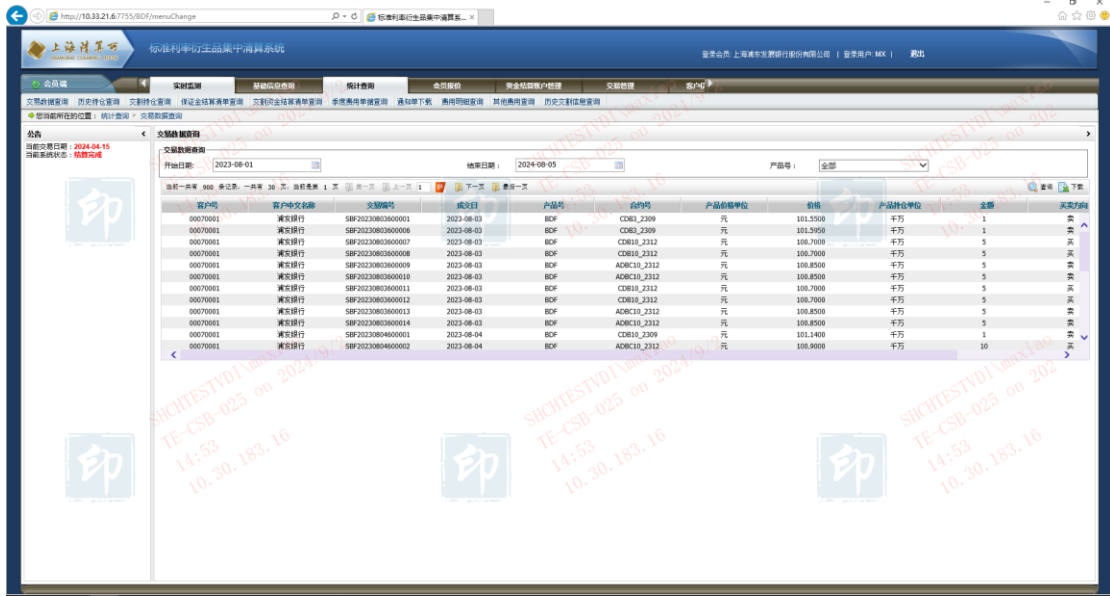


5 统计查询

5.1 交易数据查询

1. 查询:

输入需要查询的开始日期、结束日期，下拉框选择产品号，即可查询出相应的交易数据记录。



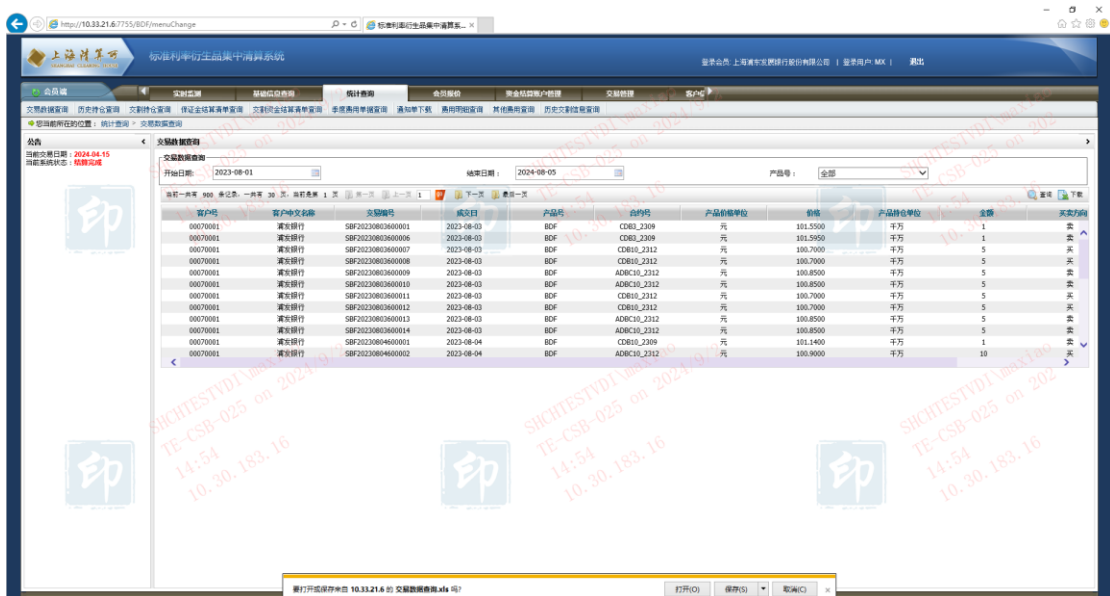
当前交易日期: 2024-08-15
当前系统状态: 正常

开始日期: 2023-08-01 结束日期: 2024-08-05 产品号: 全部

客户号	客户中文名称	交易日期	成交行	产品号	合约	产品持仓单位	价格	产品持仓单位	金额	买卖方向
00070001	浦发银行	SBF20230803600001	2023-08-03	BOF	CD01_2309	元	101.5500	千万	1	卖
00070001	浦发银行	SBF20230803600006	2023-08-03	BOF	CD01_2309	元	101.5450	千万	1	卖
00070001	浦发银行	SBF20230803600007	2023-08-03	BOF	CD010_2312	元	100.7000	千万	5	买
00070001	浦发银行	SBF20230803600008	2023-08-03	BOF	CD010_2312	元	100.7000	千万	5	买
00070001	浦发银行	SBF20230803600009	2023-08-03	BOF	AD0C10_2312	元	100.8500	千万	5	卖
00070001	浦发银行	SBF20230803600010	2023-08-03	BOF	AD0C10_2312	元	100.8500	千万	5	卖
00070001	浦发银行	SBF20230803600011	2023-08-03	BOF	CD010_2312	元	100.7000	千万	5	买
00070001	浦发银行	SBF20230803600012	2023-08-03	BOF	CD010_2312	元	100.7000	千万	5	买
00070001	浦发银行	SBF20230803600013	2023-08-03	BOF	AD0C10_2312	元	100.8500	千万	5	卖
00070001	浦发银行	SBF20230803600014	2023-08-03	BOF	AD0C10_2312	元	100.8500	千万	5	卖
00070001	浦发银行	SBF20230804600001	2023-08-04	BOF	CD010_2309	元	101.1400	千万	1	卖
00070001	浦发银行	SBF20230804600002	2023-08-04	BOF	AD0C10_2312	元	100.9000	千万	10	买

2. 下载:

点击下载键即可下载查询出的交易数据:



当前交易日期: 2024-08-15
当前系统状态: 正常

开始日期: 2023-08-01 结束日期: 2024-08-05 产品号: 全部

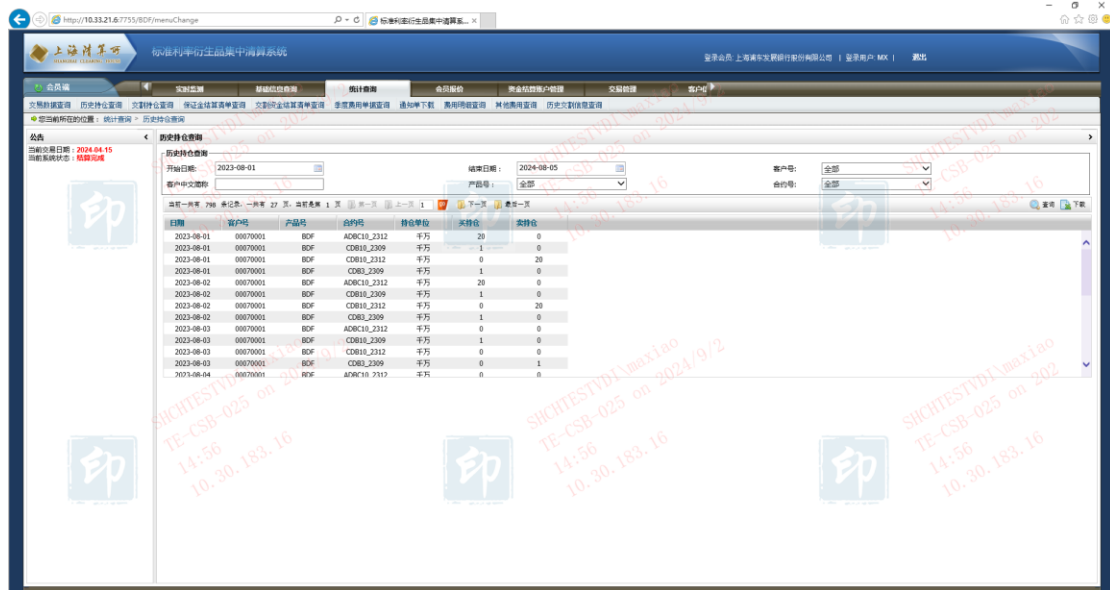
客户号	客户中文名称	交易日期	成交行	产品号	合约	产品持仓单位	价格	产品持仓单位	金额	买卖方向
00070001	浦发银行	SBF20230803600001	2023-08-03	BOF	CD01_2309	元	101.5500	千万	1	卖
00070001	浦发银行	SBF20230803600006	2023-08-03	BOF	CD01_2309	元	101.5450	千万	1	卖
00070001	浦发银行	SBF20230803600007	2023-08-03	BOF	CD010_2312	元	100.7000	千万	5	买
00070001	浦发银行	SBF20230803600008	2023-08-03	BOF	CD010_2312	元	100.7000	千万	5	买
00070001	浦发银行	SBF20230803600009	2023-08-03	BOF	AD0C10_2312	元	100.8500	千万	5	卖
00070001	浦发银行	SBF20230803600010	2023-08-03	BOF	AD0C10_2312	元	100.8500	千万	5	卖
00070001	浦发银行	SBF20230803600011	2023-08-03	BOF	CD010_2312	元	100.7000	千万	5	买
00070001	浦发银行	SBF20230803600012	2023-08-03	BOF	CD010_2312	元	100.7000	千万	5	买
00070001	浦发银行	SBF20230803600013	2023-08-03	BOF	AD0C10_2312	元	100.8500	千万	5	卖
00070001	浦发银行	SBF20230803600014	2023-08-03	BOF	AD0C10_2312	元	100.8500	千万	5	卖
00070001	浦发银行	SBF20230804600001	2023-08-04	BOF	CD010_2309	元	101.1400	千万	1	卖
00070001	浦发银行	SBF20230804600002	2023-08-04	BOF	AD0C10_2312	元	100.9000	千万	10	买

新打开或保存来自 10.33.21.6 的交易数据表.xlsx

5.2 历史持仓查询

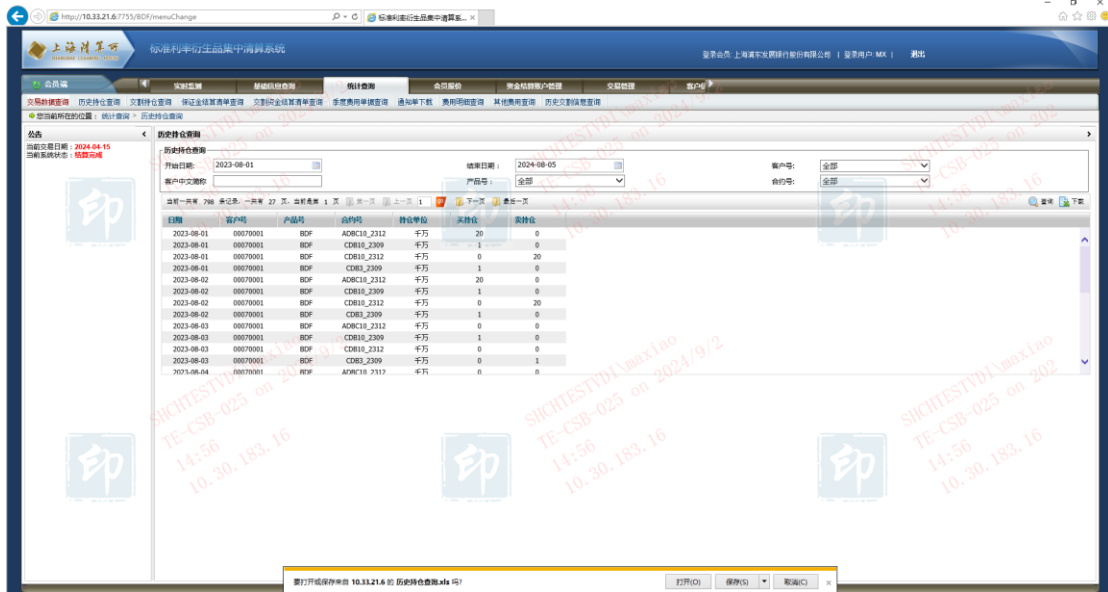
1. 查询：

选择需要查询的开始日期、结束日期，下拉框选择客户号、合约号和产品号，输入客户中文简称，点击查询键，即可查询出相应的历史持仓记录。



2. 下载：

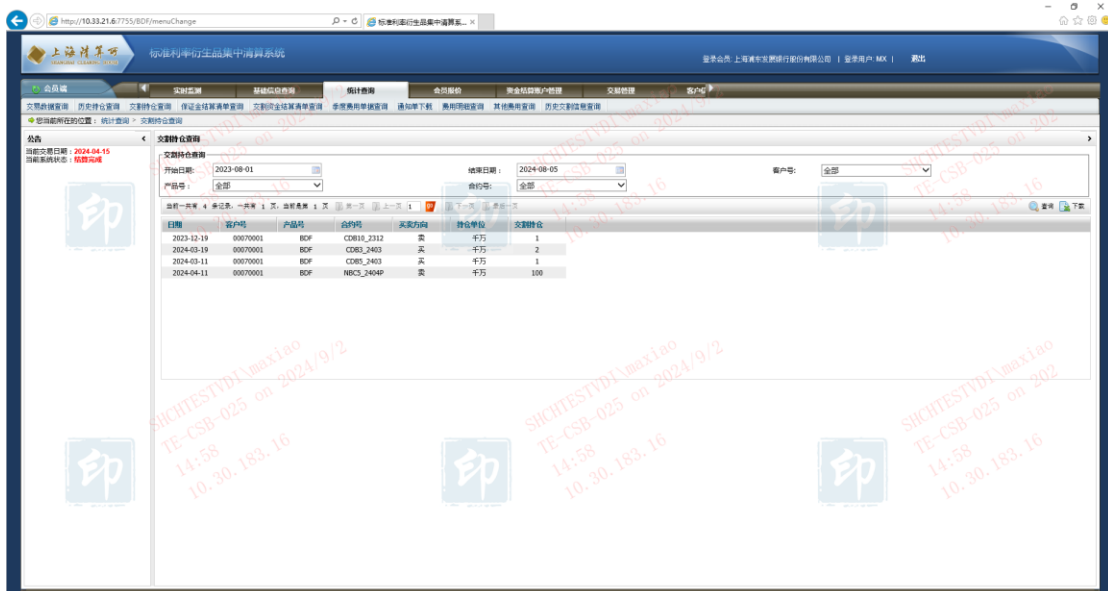
点击下载键即可下载查询出的交易数据：



5.3 交割持仓查询

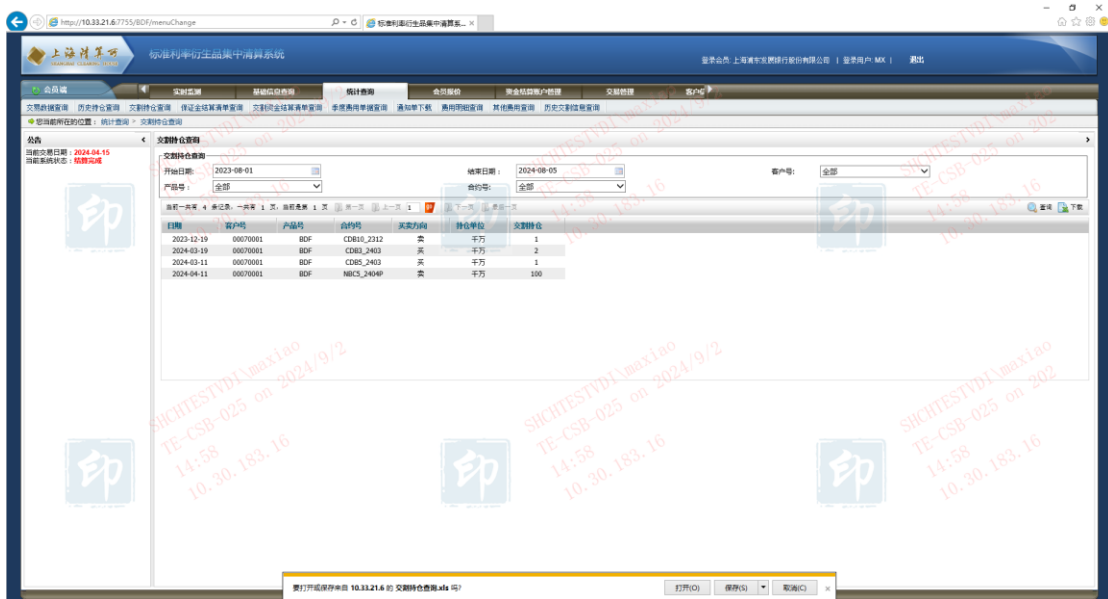
1. 查询：

选择需要查询的开始日期、结束日期，下拉框选择产品号、合约号和客户号，即可查询出相应的交割持仓记录。



2. 下载：

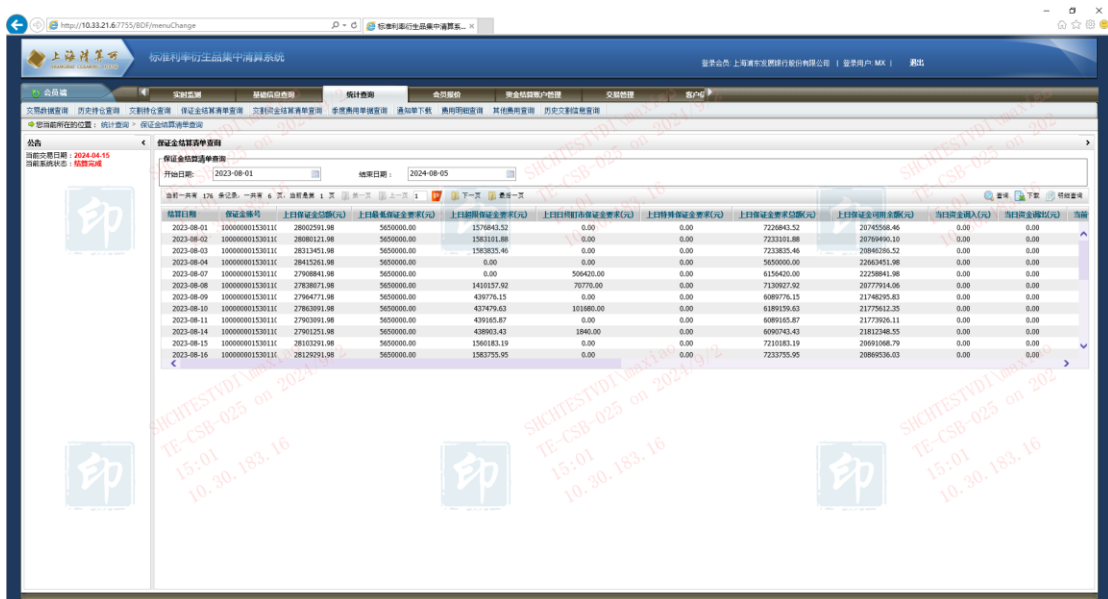
点击下载键即可下载查询出的交割持仓数据：



5.4 保证金结算清单查询

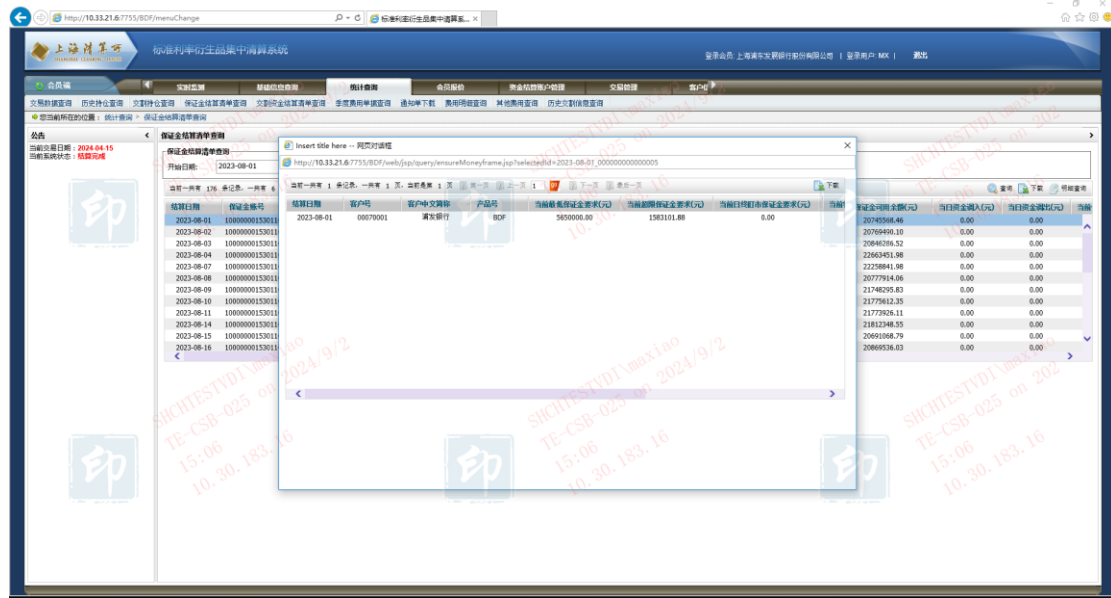
1. 查询：

选择需要查询的开始日期、结束日期，点击查询键，即可查询出相应的保证金结算清单。



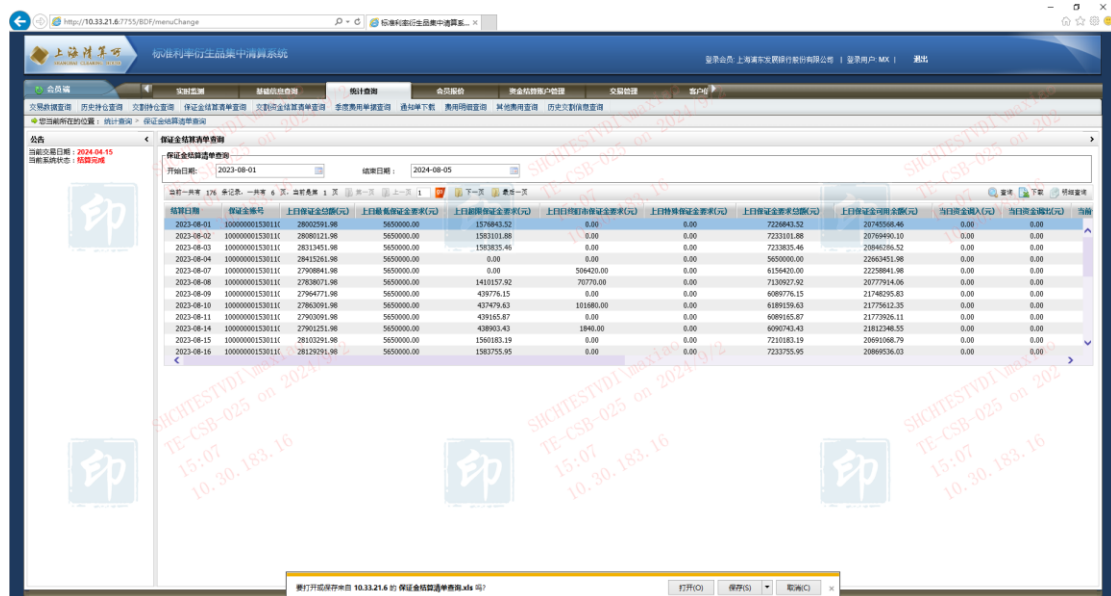
2. 明细查询：

选择需要查看的保证金结算清单条目，点击明细查询键，即可查询对应的保证金结算清单的详细内容。



3. 下载：

点击下载键即可下载查询出的保证金结算清单：



5.5 交割资金结算清单查询

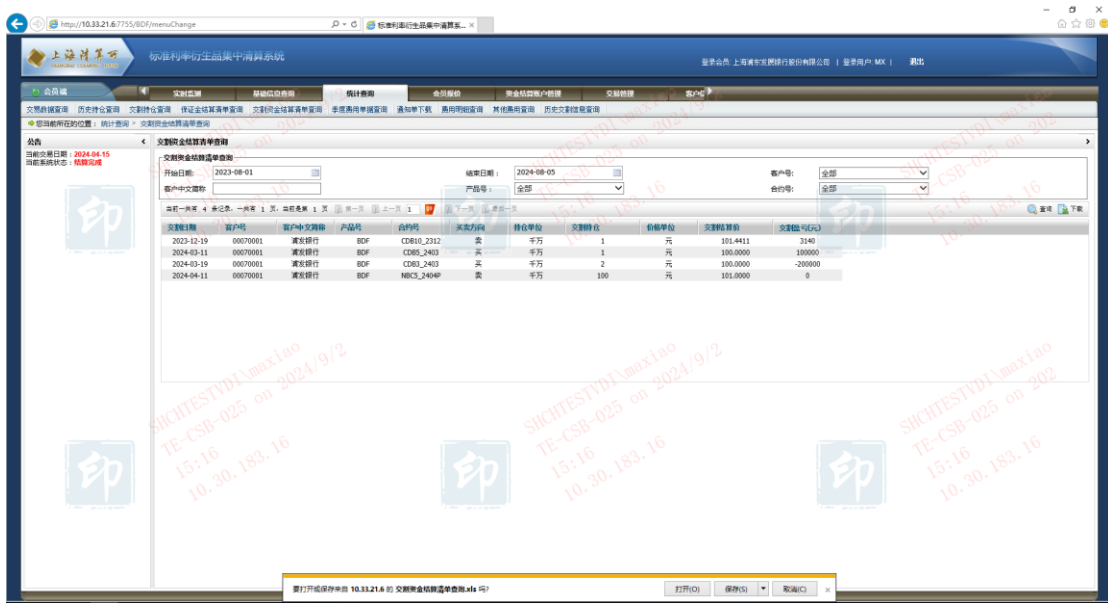
1. 查询：

选择需要查询的开始日期、结束日期，下拉框选择产品号、合约号和客户号，输入客户中文简称，即可查询出相应的交割资金结算清单记录。



2. 下载：

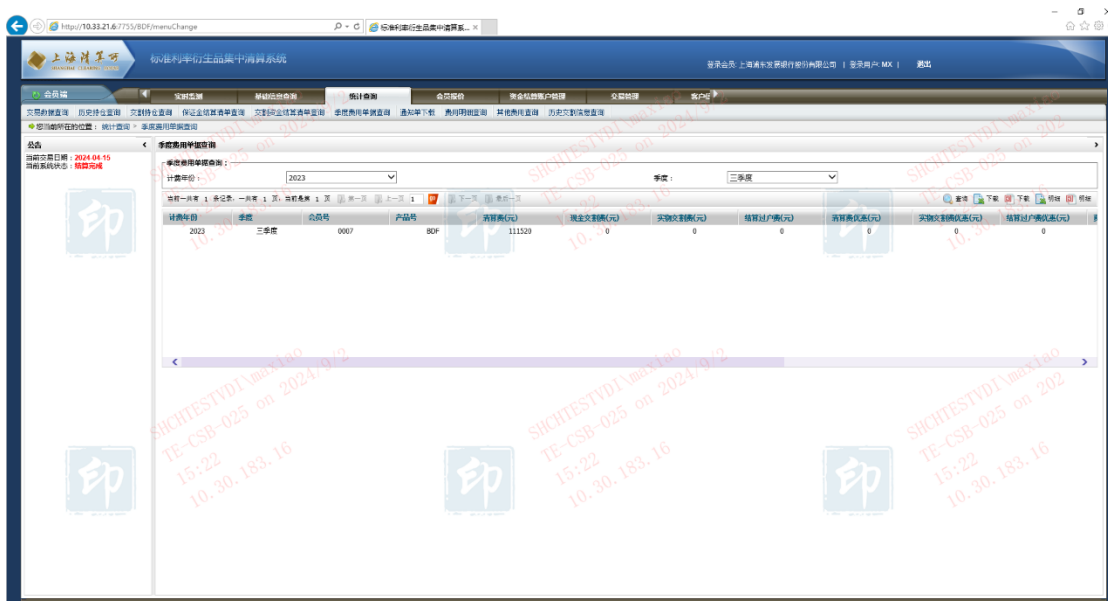
点击下载键即可下载查询出的交割资金结算清单：



5.6 季度费用单据查询

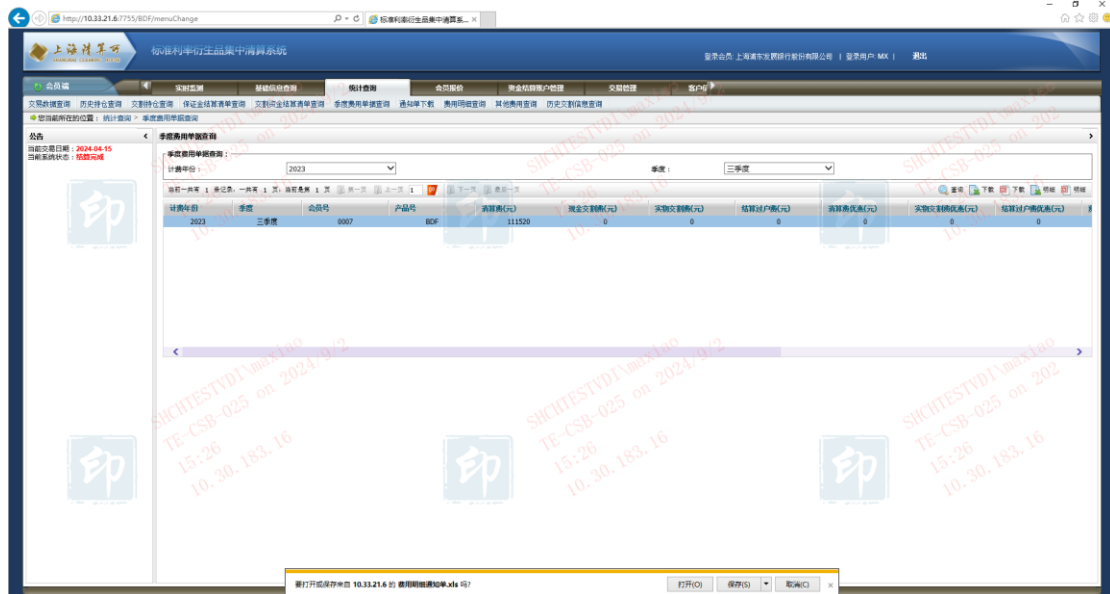
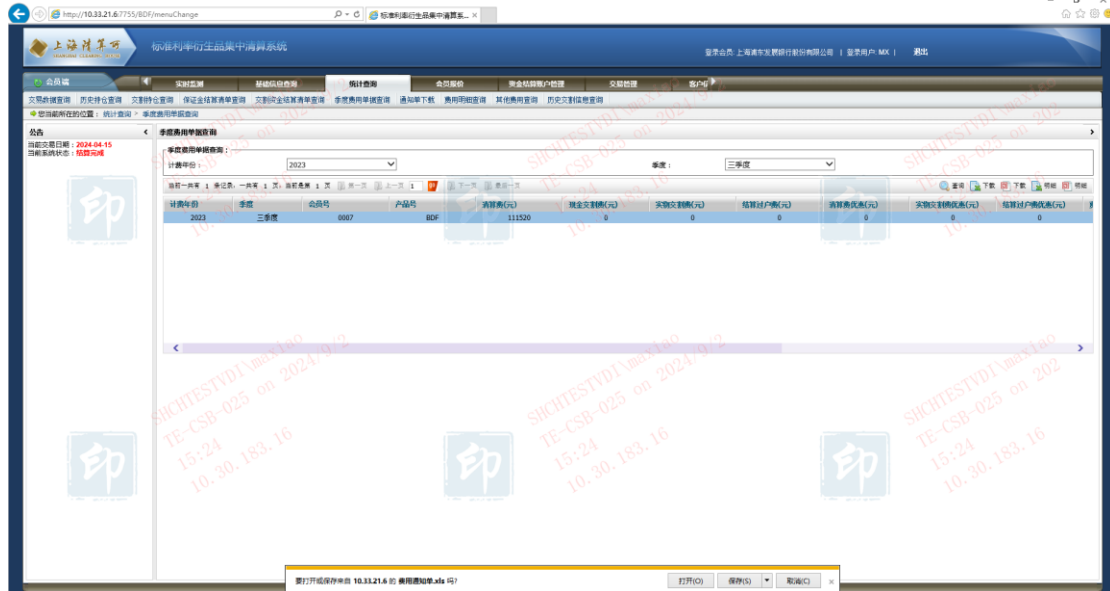
1. 查询:

下拉框选择需要查询的计费年份和季度,即可查询出相应的季度费用记录。



2. 下载:

选择季度的费用记录条目，即可下载相应格式的季度费用清单、
明细。

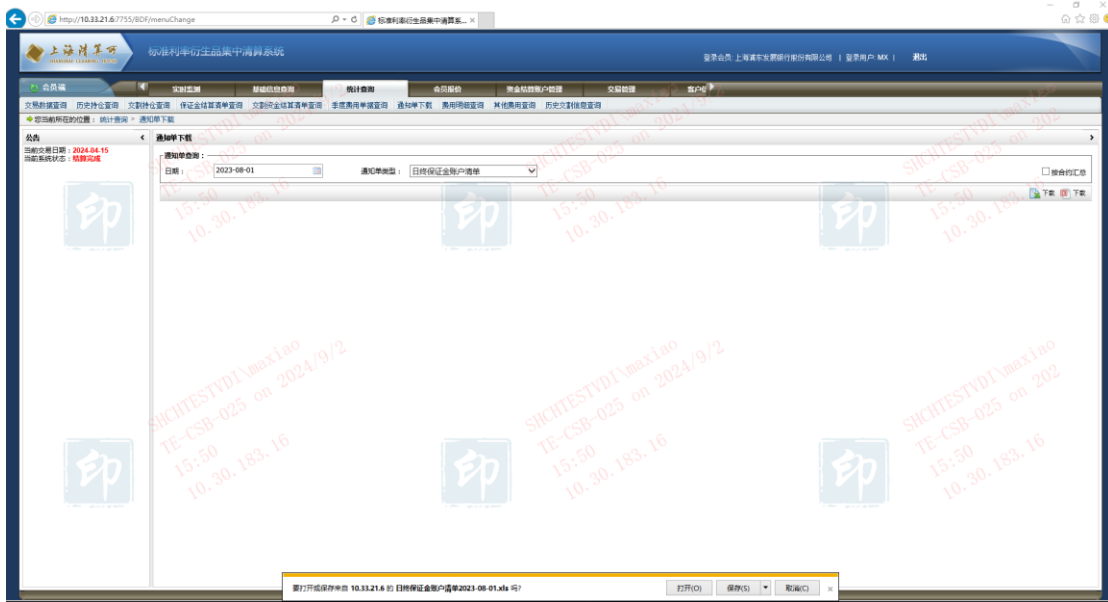
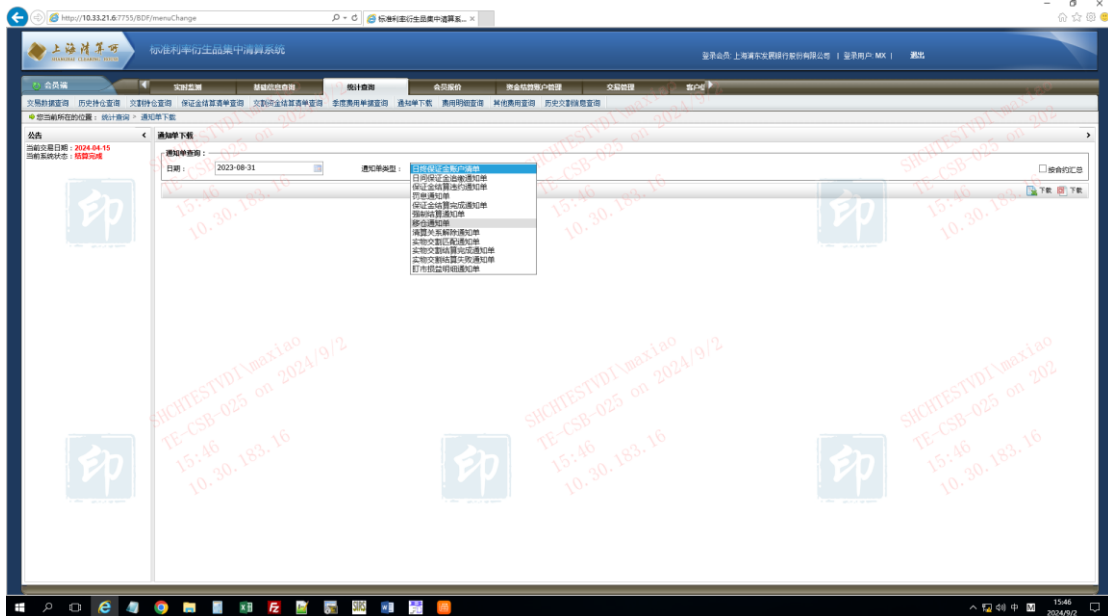


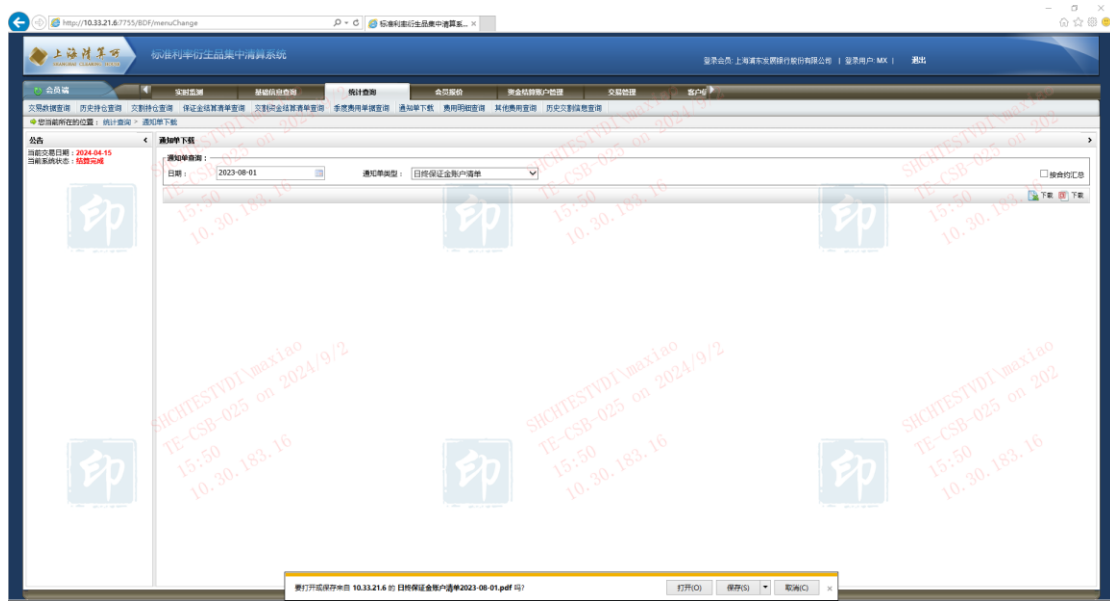
5.7 通知单下载

1. 下载：

下拉框选择需要下载的通知单类型和日期，点击下载，即可下载

对应日期和通知单。

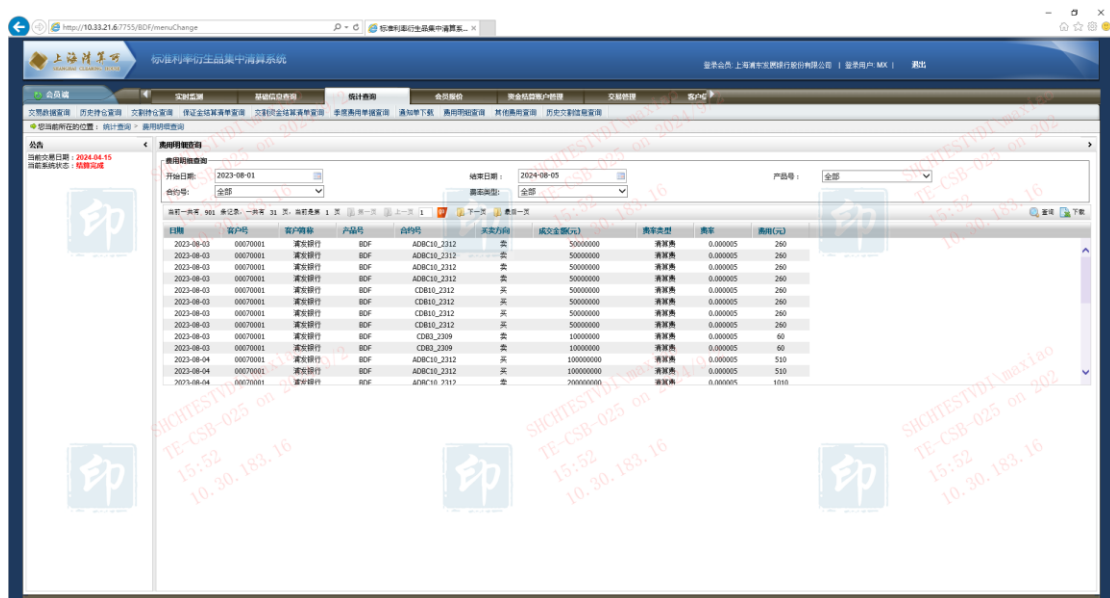




5.8 费用明细查询

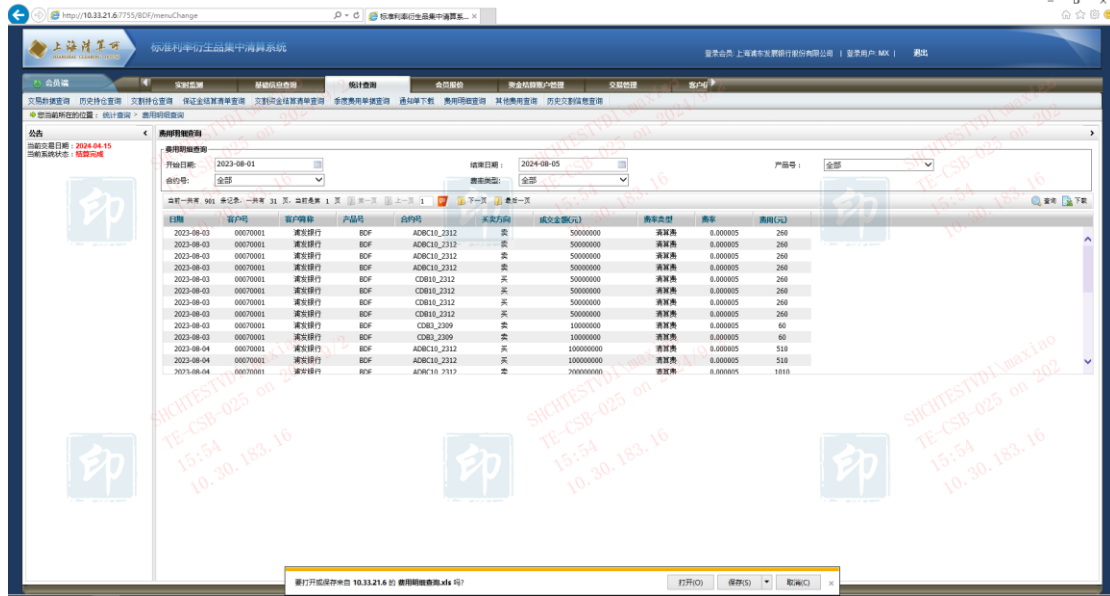
1. 查询：

选择需要查询的开始日期和结束日期，下拉框选择合约号和产品号，点击查询键，即可查询出相应时间段的费用明细。



2. 下载：

点击下载键即可下载查询出的清算费明细：



5.9 其他费用查询

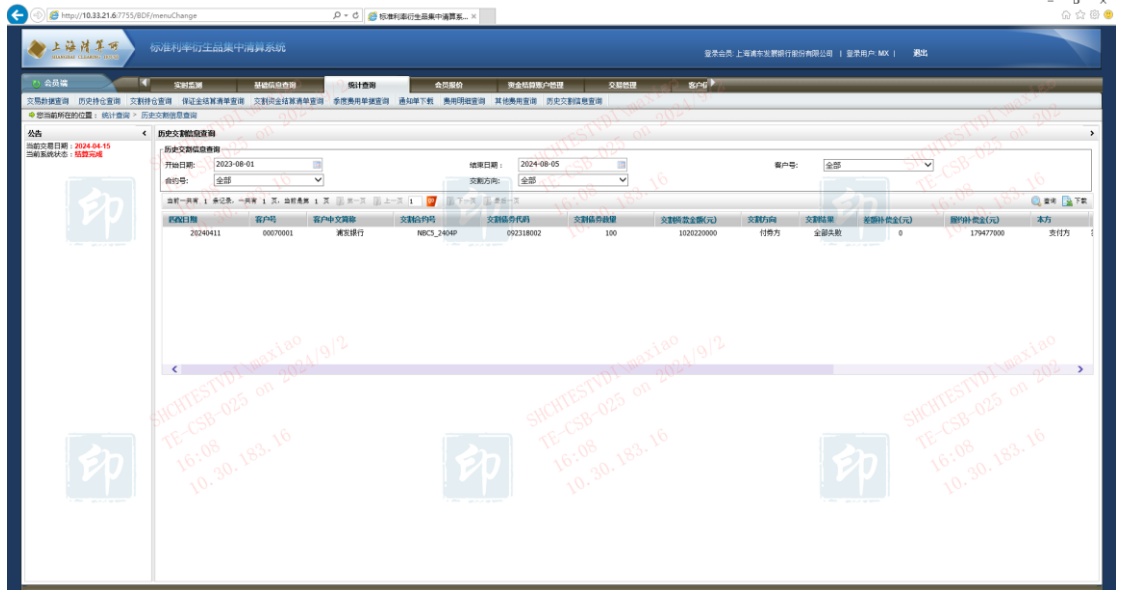
点击查询键，即可查询相应日期的其他费用信息。



5.10 历史交割信息查询

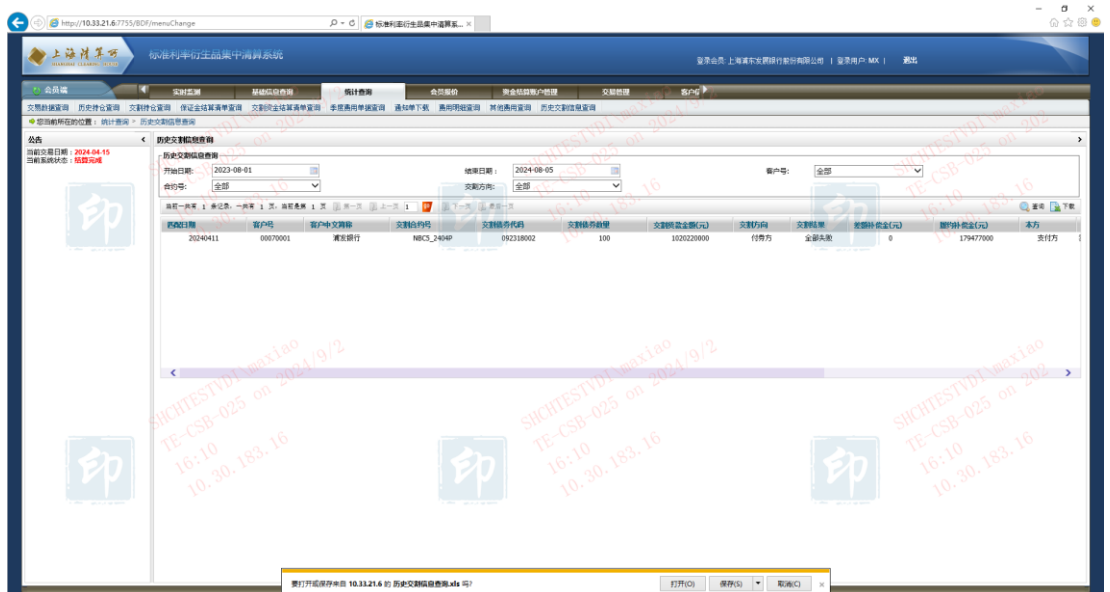
1. 查询：

选择开始日期、结束日期、客户号、合约号、交割方向，点击查询键，即可查询历史交割信息。



2. 下载：

点击下载键即可下载查询出的历史交割信息：



6 会员报价

6.1 远期合约报价

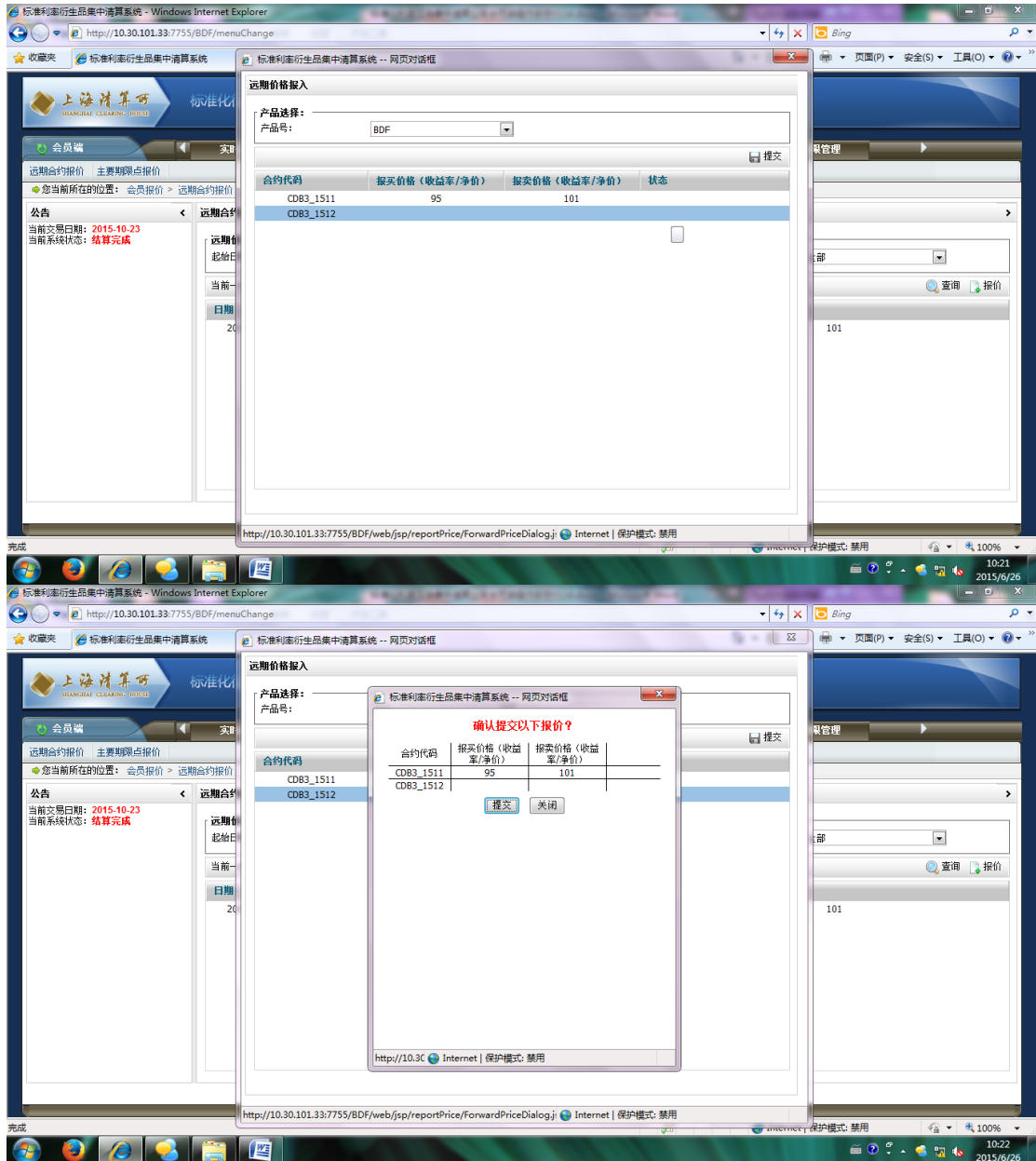
1. 查询：

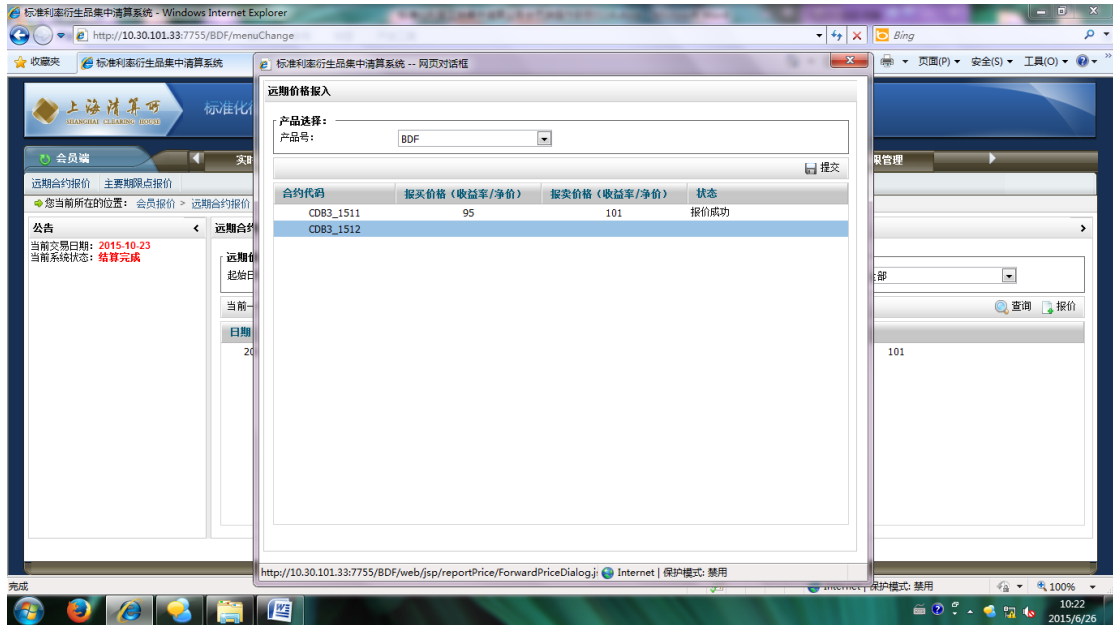
选择需要查询的开始日期和结束日期，下拉框选择产品号，点击查询键，即可查询对应时间段内录入的远期合约报价信息。



2. 报价：

点击报价键，界面弹出报价输入窗口。选择产品号，输入合约的报买价格、报卖价格，点击提交键，即完成远期合约报价提交。





6.2 主要期限点报价

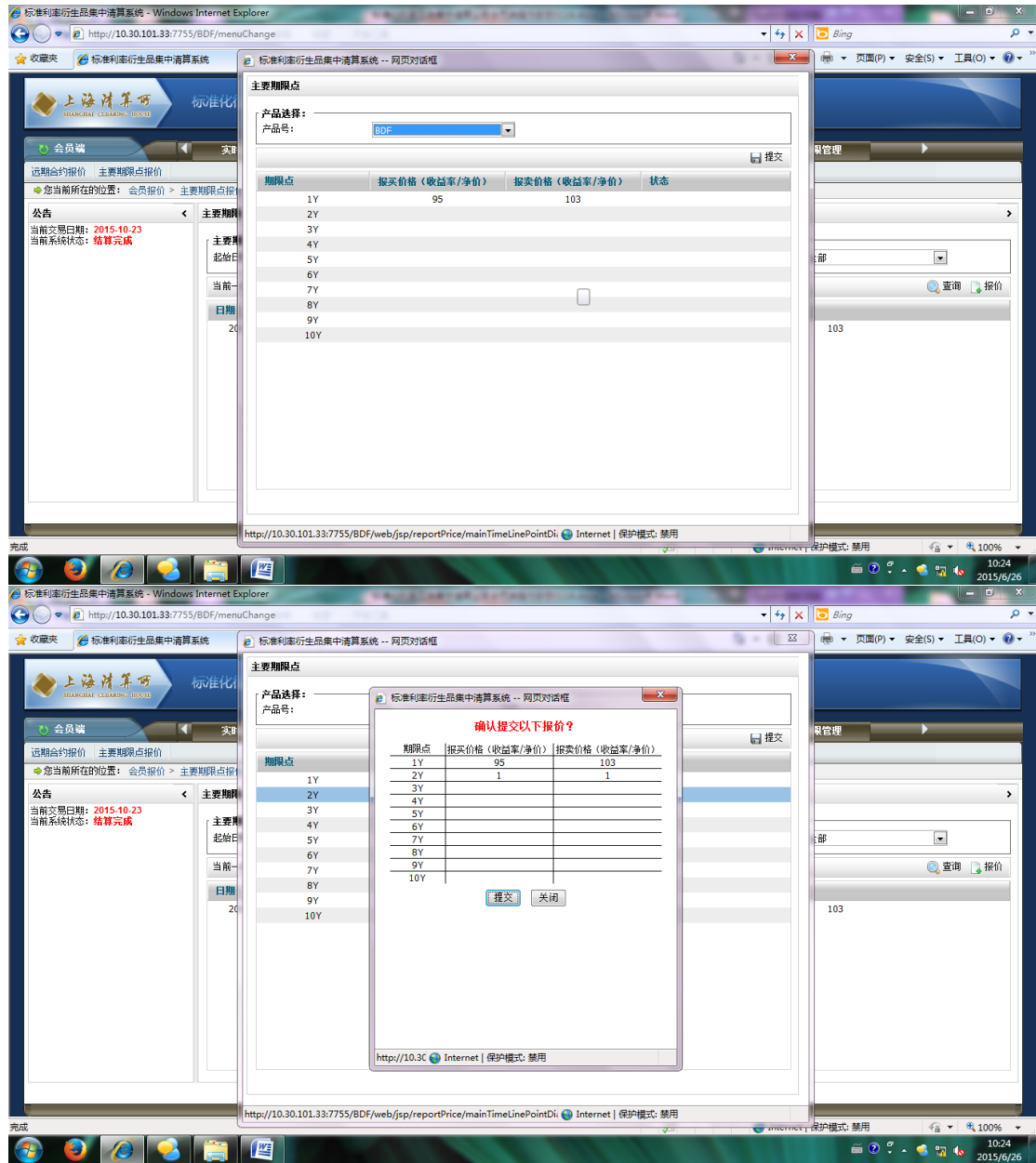
1. 查询：

选择需要查询的起始日期和结束日期，下拉框选择产品号，点击查询键，即可查询对应时间段内录入的远期合约报价信息。



2. 报价：

点击报价键，界面弹出报价输入窗口。选择产品号，输入合约的报买价格、报卖价格，点击提交键，即完成远期合约报价提交。



标准利率衍生品集中清算系统 - Windows Internet Explorer

http://10.30.101.33:7755/BDF/menuChange

收藏夹 标准利率衍生品集中清算系统 标准利率衍生品集中清算系统 - 网页对话框

公告
当前交易日期: 2015-10-23
当前系统状态: 结算完成

会员端

远期合约报价 主要期限点报价

您当前所在的位置: 会员报价 > 主要期限点报

主要期限点

产品选择:
产品号: BDF

提交

期限点	报买价格 (收益率/净价)	报卖价格 (收益率/净价)	状态
1Y	95	103	
2Y	1	1	报价成功
3Y			
4Y			
5Y			
6Y			
7Y			
8Y			
9Y			
10Y			

报告管理

部门

103

查询 报价

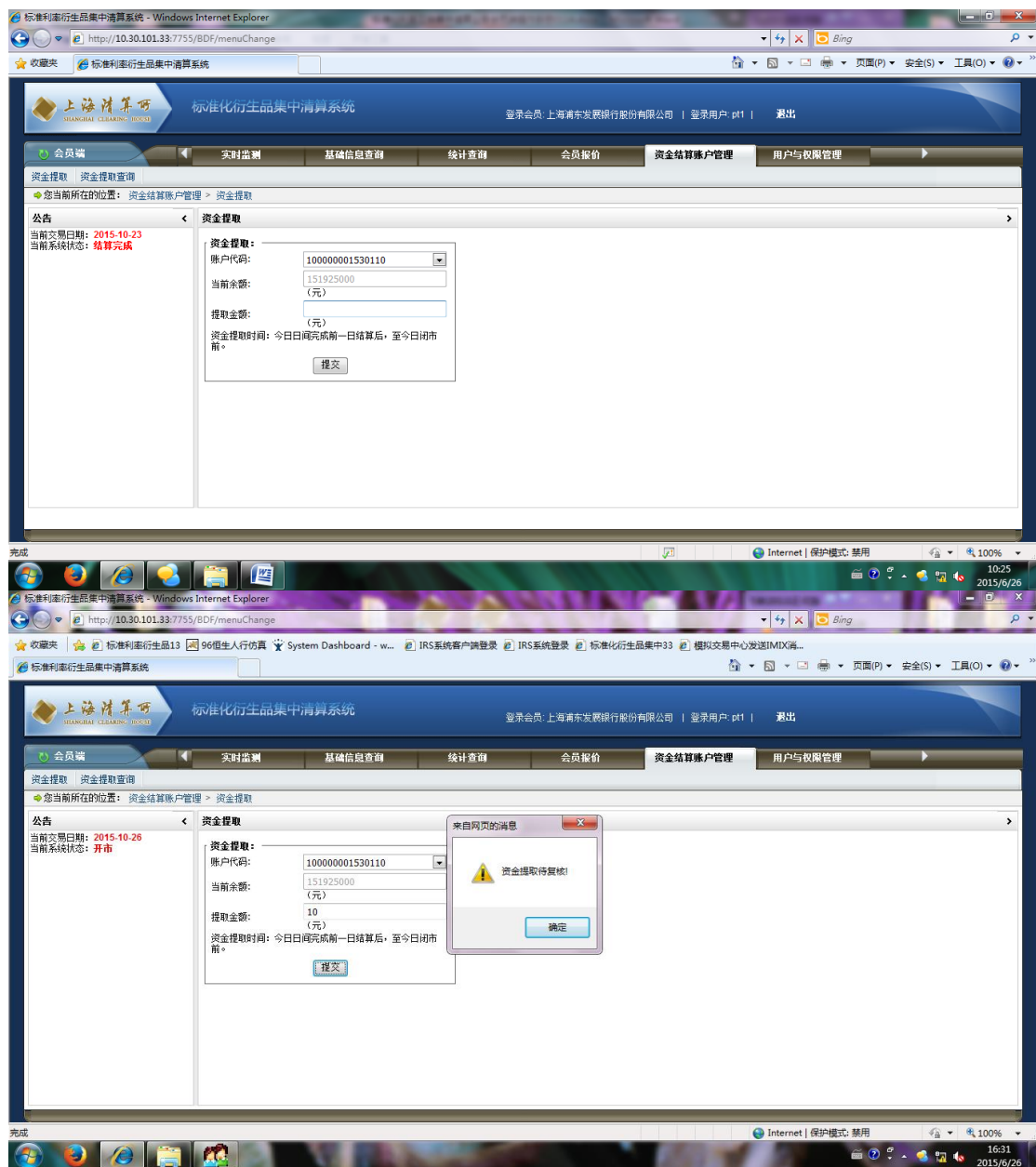
http://10.30.101.33:7755/BDF/web/jsp/reportPrice/mainTimeLinePointDi Internet | 保护模式: 禁用

10:25 2015/6/26

7 资金结算账户管理

7.1 资金提取

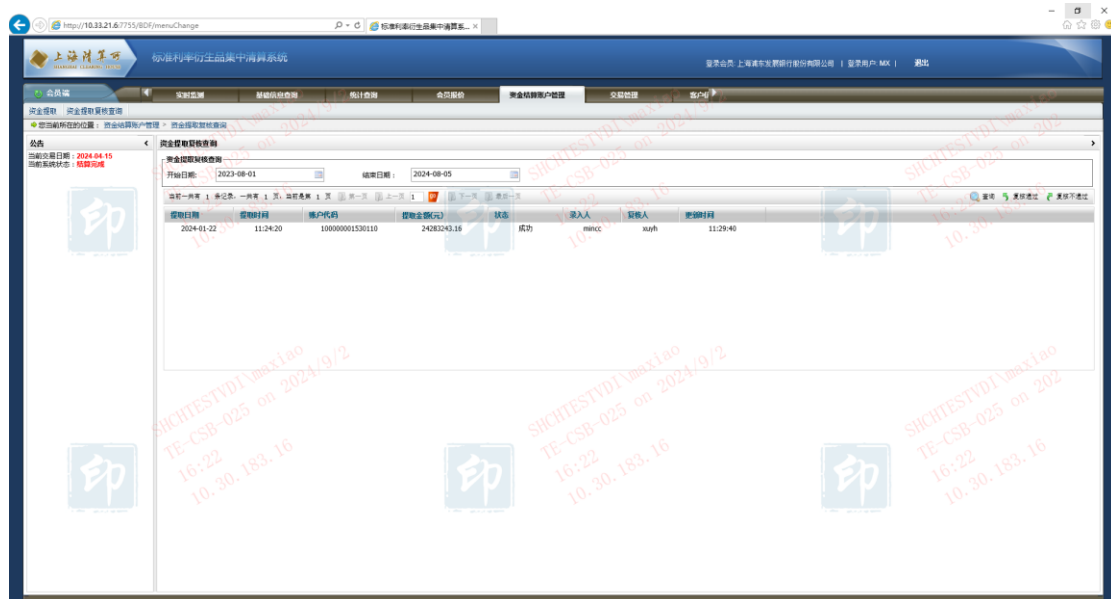
下拉框选择保证金帐号，系统自动显示当前余额，输入提取金额，点击提交键，界面提示资金提取需复核。第二名操作员在资金提取查询界面选中该条，点击复核通过完成。



7.2 资金提取复核查询

1. 查询：

选择需要查询的开始日期、结束日期，点击查询键，即可查询出相应的资金提取记录。



2. 复核通过：

选择需复核的记录条目，点击复核确认通过，（录入人不能与复核人相同），提示申请发送成功。等待资金系统进行后续处理。

