

附件 4

标准债券远期集中清算业务指南

银行间市场清算所股份有限公司

2015 年 6 月

目录

| | | |
|-------|---------------------|----|
| 1. | 总则 | 5 |
| 2. | 清算产品 | 5 |
| 3. | 清算业务资格申请 | 7 |
| 3.1 | 上海清算所清算会员参与本业务申请 | 7 |
| 3.2 | 其他市场参与者参与本业务资格申请 | 8 |
| 3.2.1 | 本业务普通清算会员资格申请条件 | 8 |
| 3.2.2 | 申请本业务普通清算会员应提交的书面材料 | 9 |
| 3.3 | 综合清算会员资格申请条件 | 10 |
| 3.3.1 | 本业务综合清算会员资格申请条件 | 10 |
| 3.3.2 | 申请本业务综合清算会员应提交的书面材料 | 11 |
| 3.4 | 客户申请参与本业务 | 12 |
| 4. | 业务开展准备 | 12 |
| 4.1 | 签订协议 | 13 |
| 4.2 | 指定或开立账户 | 14 |
| 4.2.1 | 资金结算账户 | 14 |
| 4.2.2 | 保证金账户 | 14 |
| 4.3 | 申请清算限额 | 15 |
| 4.3.1 | 清算限额含义 | 15 |
| 4.3.2 | 清算限额申请 | 15 |
| 4.4 | 交纳保证金和清算基金 | 16 |
| 4.5 | 业务培训 | 16 |
| 5. | 会员资格及相关信息变更与调整 | 16 |
| 5.1 | 会员资格变更与调整 | 16 |
| 5.1.1 | 清算会员资质变更及信息报备 | 16 |
| 5.1.2 | 清算会员自营或代理业务资格终止 | 17 |
| 5.1.3 | 客户终止代理关系 | 19 |
| 5.2 | 清算限额调整 | 19 |
| 5.2.1 | 清算会员限额调整 | 19 |
| 5.2.2 | 客户限额调整 | 20 |
| 5.3 | 账户信息变更 | 20 |
| 5.3.1 | 清算会员账户信息变更 | 20 |
| 5.3.2 | 客户信息变更 | 21 |
| 6. | 清算和结算处理 | 21 |
| 6.1 | 交易数据接收和处理 | 21 |
| 6.2 | 清算结算流程 | 21 |
| 6.2.1 | 日前清算准备 | 21 |

| | | |
|-------|----------------------|----|
| 6.2.2 | 日间清算处理..... | 21 |
| 6.2.3 | 日间保证金追缴..... | 22 |
| 6.2.4 | T日日终清算与T+1日结算处理..... | 23 |
| 7. | 风险管理..... | 24 |
| 7.1 | 风险监控..... | 24 |
| 7.2 | 持仓计算与持仓限额..... | 24 |
| 7.2.1 | 持仓计算..... | 24 |
| 7.2.2 | 持仓限额..... | 25 |
| 7.3 | 价格计算..... | 25 |
| 7.3.1 | 每日结算价格..... | 25 |
| 7.3.2 | 到期交割价格..... | 26 |
| 7.4 | 盯市损益计算..... | 26 |
| 7.4.1 | 日间盯市损益..... | 26 |
| 7.4.2 | 日终盯市损益..... | 27 |
| 7.5 | 保证金计算..... | 27 |
| 7.5.1 | 最低保证金..... | 28 |
| 7.5.2 | 变动保证金..... | 28 |
| 7.5.3 | 特殊保证金..... | 29 |
| 7.5.4 | 日终保证金要求计算..... | 29 |
| 8. | 资金操作处理..... | 30 |
| 8.1 | 资金结算账户操作..... | 30 |
| 8.1.1 | 存入..... | 30 |
| 8.1.2 | 计息..... | 31 |
| 8.2 | 保证金操作..... | 31 |
| 8.2.1 | 保证金的交纳..... | 31 |
| 8.2.2 | 保证金计息..... | 33 |
| 8.2.3 | 保证金提取..... | 33 |
| 8.3 | 清算基金操作..... | 34 |
| 8.3.1 | 清算基金计算..... | 34 |
| 8.3.2 | 清算基金交纳..... | 34 |
| 8.3.3 | 清算基金释放..... | 35 |
| 8.3.4 | 清算基金计息..... | 35 |
| 9. | 交割机制..... | 35 |
| 10. | 代理业务注意事项..... | 36 |
| 10.1 | 客户首次参与业务..... | 36 |
| 10.2 | 客户代理客户关系终止..... | 36 |
| 10.3 | 客户代理关系变更..... | 36 |
| 10.4 | 客户清算限额调整..... | 37 |
| 10.5 | 客户的保证金结算处理..... | 37 |
| 10.6 | 客户的清算费用..... | 37 |
| 10.7 | 综合清算会员代理业务终止..... | 38 |

| | | |
|------|----------------------|----|
| 11. | 违约处理..... | 38 |
| 11.1 | 保证金结算违约和交割违约的处理..... | 38 |
| 11.2 | 违约后续处理..... | 39 |
| 11.3 | 强行平仓..... | 39 |
| 11.4 | 强制结算..... | 40 |
| 11.5 | 损失弥补..... | 40 |
| 11.6 | 客户违约的处理..... | 41 |
| 12. | 应急业务处理..... | 41 |
| 12.1 | 应急处理范围..... | 41 |
| 12.2 | 办理流程..... | 41 |
| 13. | 清算费用..... | 42 |
| 13.1 | 收费流程..... | 43 |
| 13.2 | 收费组成..... | 43 |
| 14. | 附表..... | 43 |

标准债券远期集中清算业务指南

1. 总则

为便于市场参与者了解和熟悉标准债券远期集中清算业务（以下简称标准债券远期业务），进一步明确标准债券远期业务操作流程，确保标准债券远期业务顺利开展，银行间市场清算所股份有限公司（以下简称上海清算所）根据《标准债券远期集中清算业务规则》（以下简称《业务规则》），制定标准债券远期业务指南。

符合上海清算所相关资质要求的市场参与者，可申请成为上海清算所标准债券远期业务清算会员，包括综合清算会员和普通清算会员，并直接参与标准债券远期业务（以下简称自营业务）。其他市场参与者（以下简称非清算会员或客户）可通过综合清算会员以代理方式参与标准债券远期业务（以下简称代理业务）。综合清算会员、普通清算会员和客户统称为清算参与者。本指南适用于上述参与上海清算所标准债券远期业务的清算参与者。

2. 清算产品

上海清算所提供集中清算的标准债券远期合约，包括：票面利率为 3% 的 3 年期、5 年期和 10 年期虚拟国开债合约等。

| | |
|------|--------------------------|
| 合约品种 | 3年期、5年期和10年期标准国开债远期合约 |
| 合约代码 | CDB3_1503等 CDB5_1503等 |

| | |
|-----------------|---|
| | CDB10_1503等 |
| 合约标的 | 票面利率为3%的3年期、5年期和10年期虚拟国开债 |
| 合约月份 | 最近的4个季月 |
| 合约到期交割日 (D日) | 合约月份的第三个星期三，若非营业日，则调整到下一营业日 |
| 最后交易日 | 交割日前一个营业日(D-1日)，中午12:00收盘 |
| 新合约上市日 | 旧合约交割日 |
| 报价方式 | 百元报价，净价 |
| 交易时间 | 周一至周五：北京时间9:00-12:00,13:30-16:30，节假日除外 |
| 最小价格变动单位 | 0.001元 |
| 单位报价量 | 1000万 |
| 价格涨跌幅 | 每日价格涨跌停板幅度，为上一交易日结算价的±日价%(参数化设计)，合约上市首日涨跌停板幅度为挂牌基准价的±合约% |
| 清算方式 | 集中清算 |
| 结算方式 | 首推现金交割，待后期条件成熟后推出实物交割的结算方式 |
| 可交割债券 | 为一篮子债券，由交易中心商上海清算所后确定或调整，在合约上市前一营业日或调整后发布 |
| 转换因子 | <p>以合约对应虚拟债券的票面利率作为到期收益率，计算出的单位面值可交割债券的到期交割日净价。计算公式为：</p> <p>其中：</p> $CF = \left\{ \sum_{i=1}^k \frac{c/f}{(1+y/f)^{\frac{d}{TS}+i-1}} + \frac{100}{(1+y/f)^{\frac{d}{TS}+k-1}} - \frac{c}{f} * \left(1 - \frac{d}{TS}\right) \right\} \div 100$ <p>c: 可交割券票面利率 f: 可交割券付息频率 y: 标的券票面利率 d: 到期交割日距可交割券下一付息日的实际天数 TS: 可交割券当前付息周期实际天数</p> |

| | |
|------|---|
| | K: 可交割券剩余付息次数 |
| 保证金率 | 各合约保证金率由上海清算所定期测算并公布。业务上线初期, 3年期标准国开债远期合约保证金率暂定为1.17%, 5年期标准国开债远期合约保证金率为1.80%, 10年期标准国开债远期合约保证金率为3.74%。上海清算所可根据市场情况适时调整以上参数标准, 并予以公告。 |

根据业务需要, 可增加或调整集中清算的标准债券远期品种。

3. 清算业务资格申请

3.1 上海清算所清算会员参与本业务申请

已是上海清算所清算会员的, 可向上海清算所直接申请参与标准债券远期业务, 并提交以下书面材料:

- A. 标准债券远期集中清算业务申请书 (附表 A-1-2);
- B. 标准债券远期集中清算业务基础信息表 (附表 A-2-2);
- C. 标准债券远期清算会员账户信息 (变更) 登记表 (附表 A-3);
- D. 资金结算专户 (标准债券远期专用) 开户申请表 (附表 A-4) (如适用);
- E. 标准债券远期集中清算业务印鉴卡 (附表 A-5);
- F. 法人代表委托授权书及身份证明材料 (附表 A-6);
- G. 标准债券远期清算会员终端管理员信息 (变更) 登记表 (附表 A-7-1);
- H. 标准债券远期清算会员费用发票寄送信息 (变更) 登记表 (附表 A-8-1);

- I. 标准债券远期清算限额（调整）申请表（附表 A-9）；
- J. 申请机构已完成签署的《标准债券远期集中清算协议》（一式四份）；
- K. 申请机构已完成签署的《清算会员协议补充条款》（一式四份）（上海清算所 B、C 类普通清算会员适用）；
- L. 上海清算所要求的其他材料。

以上材料中，A、B、C、D、G、H、I 应同时提供 word 电子版，发送至上海清算所会员专用邮箱 member@shclearing.com。

上海清算所在收到完整申请材料后，及时审核并反馈结果。

3.2 其他市场参与者参与本业务资格申请

符合上海清算所规定条件的其他市场机构，可申请成为普通清算会员并参与本业务。

3.2.1 本业务普通清算会员资格申请条件

- 1. 依法登记注册的法人或其他机构；
- 2. 最近两个会计年度的净资产（证券公司为净资本）达到上海清算所要求；
- 3. 达到上海清算所制定的清算会员内部评级标准；
- 4. 相关业务管理制度、风险管理制度及技术系统能够支持自营清算业务的开展；
- 5. 遵守监管机构的有关规定，在申请成为清算会员之前两年内，无重大违法、违规记录，未发生重大的风险管理违规违约事件；

6. 具有较好的持续经营能力，未被行政机关、司法机关或监管机构采取停业整顿、托管、接管、重整以及其他可能影响其持续经营能力的措施或行政、司法程序；

7. 上海清算所要求的其他条件。

3.2.2 申请本业务普通清算会员应提交的书面材料

尚未成为上海清算所清算会员的其他市场机构，符合上海清算所规定条件的，可申请成为本业务普通清算会员并参与本业务，市场机构需提交以下书面材料进行申请：

- A. 标准债券远期清算会员资格申请书（附表 A-1-1）；
- B. 标准债券远期清算会员基础信息表（附表 A-2-1）；
- C. 标准债券远期清算会员账户信息（变更）登记表（附表 A-3）；
- D. 资金结算专户（标准债券远期专用）开户申请表（附表 A-4）（如适用）；
- E. 标准债券远期集中清算业务印鉴卡（附表 A-5）；
- F. 法人代表委托授权书及身份证明材料（附表 A-6）；
- G. 标准债券远期清算会员终端管理员信息（变更）登记表（附表 A-7-1）；
- H. 标准债券远期清算会员费用发票寄送信息（变更）登记表（附表 A-8-1）；
- I. 最新经年检的法人营业执照复印件，并加盖公章；
- J. 机构法人许可证复印件，并加盖公章；

- K. 组织机构代码证复印件，并加盖公章；
- L. 最近两个会计年度经审计的财务报告，并加盖公章；
- M. 标准债券远期清算限额（调整）申请表（附表 A-9）；
- N. 财务数据表（附表 A-10）；
- O. 申请机构已完成签署的《标准债券远期集中清算协议》（一式四份）；
- P. 申请机构已完成签署的《清算会员协议》和《清算会员协议补充条款》（一式四份）；
- Q. 上海清算所要求的其他材料。

以上材料中，A、B、C、D、G、H、L、M、N 应同时提供 Word 电子版，发送至上海清算所会员专用邮箱 member@shclearing.com。

上海清算所在收到完整申请资料后，完成内部审批流程并反馈申请结果。

3.3 综合清算会员资格申请条件

符合上海清算所规定条件的标准债券远期普通清算会员，可申请成为本业务综合清算会员。

3.3.1 本业务综合清算会员资格申请条件

- 1. 已成为上海清算所 A 类普通清算会员；
- 2. 最近两个会计年度期末净资产（证券公司为净资本）不低于 100 亿元人民币；
- 3. 积极参与标准债券远期集中清算业务，且利率衍生品集

中清算业务规模排名靠前；

4. 达到上海清算所制定的标准债券远期综合清算会员内部评级标准；

5. 相关业务管理制度、风险管理制度、技术系统能够支持代理清算业务的开展；

6. 具有独立的代理清算业务团队，具有 4 名以上已获得上海清算所培训资格证书的代理清算业务在岗人员；

7. 上海清算所规定的其他条件。

3.3.2 申请本业务综合清算会员应提交的书面材料

市场机构需提交以下书面材料进行申请：

A. 标准债券远期综合清算会员申请书（附表 A-1-3）；

B. 标准债券远期集中清算代理业务基础信息表（附表 A-2-3）；

C. 标准债券远期综合清算会员代理客户信息登记表（附表 A-2-4）；

D. 资金结算专户（标准债券远期专用）开户申请表（附表 A-4）；

E. 标准债券远期集中清算业务印鉴卡（附表 A-5）；

F. 法人代表委托授权书及身份证明材料（附表 A-6）

G. 标准债券远期综合清算会员代理业务会员终端管理员信息（变更）登记表（附表 A-7-2）；

H. 标准债券远期综合清算会员代理业务费用发票寄送信息

(变更) 登记表 (附表 A-8-2) ;

I. 标准债券远期代理清算业务、风险管理等内部相关制度;

J. 已与客户完成签署的《标准债券远期集中清算业务代理客户清算协议》;

K. 申请机构已完成签署的《标准债券远期集中清算协议》的补充协议 (一式四份);

L. 申请机构已完成签署的《清算会员协议补充条款》 (一式四份) (如适用);

M. 上海清算所要求的其他材料。

以上材料中, A、B、C、D、G、H、I 应同时提供 word 电子版, 发送至上海清算所会员专用邮箱 member@shclearing.com。综合清算会员提供的信息应真实、完整、准确。上海清算所在收到完整申请材料后, 及时审核并反馈结果。

3.4 客户申请参与本业务

市场机构可向标准债券远期综合清算会员申请以代理方式参与本业务, 并与综合清算会员完成签署《标准债券远期集中清算业务代理客户清算协议》后, 由综合清算会员向上海清算所提交相关登记备案材料。综合清算会员可参照本业务指南制定相应的代理清算业务、风险管理制度, 并提交上海清算所备案。

4. 业务开展准备

清算会员参与标准债券远期业务前, 应及时完成业务开展前的准备工作, 包括: 签署《标准债券远期集中清算协议》(以下

简称清算协议)及其补充协议(如适用);签署《清算会员协议》和《清算会员协议补充条款》(如适用);指定或开立相关账户;申报清算限额;足额交纳最低保证金和清算基金;清算业务人员参与培训并获得业务资格证书等。

客户参与标准债券远期业务前相关准备工作由综合清算会员参照本业务指南制定。

4.1 签订协议

清算协议是上海清算所作为集中清算服务提供方与清算会员作为服务接受方签订的,用以明确双方权利义务等内容的法律文本。协议文本由上海清算所提供。综合清算会员应与上海清算所就代理业务签订清算协议的补充协议。会员更名的,应重新签订清算协议。

根据《银行间市场清算所股份有限公司清算会员管理办法》(以下简称《清算会员管理办法》),以上海清算所作为中央对手方的清算业务实行清算会员制度。《清算会员协议》和《清算会员协议补充条款》是上海清算所与清算会员之间签订的,用以明确清算会员的会员资格类型和会员相关权利义务的法律文本。协议文本由上海清算所提供。清算会员资格调整的,应重新签订《清算会员协议补充条款》。清算会员更名的,应重新签订《清算会员协议》和《清算会员协议补充条款》。

4.2 指定或开立账户

4.2.1 资金结算账户

4.2.1.1 自营业务资金结算账户

清算会员应指定一个资金结算账户，并授权上海清算所对该账户直接借记或贷记处理。资金结算账户可以是清算会员在中国人民银行大额支付系统开立的清算账户，也可以是其在上海清算所开立的资金结算专户。

清算会员可自行选择指定原有的资金结算专户同时用于债券交易净额、人民币利率互换或标准债券远期的资金结算。

4.2.1.2 代理业务资金结算账户

综合清算会员应在上海清算所新开立资金结算专户用于标准债券远期代理业务的资金结算。

4.2.2 保证金账户

4.2.2.1 自营业务保证金账户

上海清算所为每个清算会员开立标准债券远期业务保证金账户，用于管理和核算该清算会员交纳的保证金。账户开立后的次一工作日，上海清算所向清算会员发送《保证金账户开户通知书》。

4.2.2.2 代理业务保证金账户

上海清算所为每个综合清算会员开立标准债券远期代理保证金账户，用于管理和核算该综合清算会员代理业务的保证金。账户开立后的次一工作日，上海清算所向综合清算会员发送《保

证金账户开户通知书》。

上海清算所计算并记录综合清算会员代理业务保证金账户的代理客户保证金要求及余额明细。

4.3 申请清算限额

4.3.1 清算限额含义

清算限额是指上海清算所针对本业务为各清算会员核定的持有净额额度（以名义本金计）。

清算限额是计算清算会员应交纳的清算基金和最低保证金的参数之一，清算限额的调整会导致清算基金和最低保证金的变动。

4.3.2 清算限额申请

4.3.2.1 自营业务清算限额申请

清算限额由清算会员自行测算并申请，上海清算所可根据清算会员类型进行清算限额申请指导，并结合清算会员业务规模、资信状况等因素审核确定。

清算会员申请清算限额的，应向上海清算所提交《标准债券远期清算限额（调整）申请表》（附表 A-9），并对相关情况进行说明。说明应包括但不限于以下内容：清算会员相关业务准备基本情况，限额申请的依据等。

上海清算所在收到清算限额申请后，及时反馈审核结果。审核通过的清算限额于次一工作日生效。

4.3.2.2 代理业务清算限额申请

综合清算会员为其代理的客户核定清算限额。综合清算会员应向上海清算所提交《标准债券远期综合清算会员代理客户信息登记表》（附表 A-2-4），报备客户的清算限额和容忍度。

4.4 交纳保证金和清算基金

清算会员应根据上海清算所的规定按时、足额交纳保证金和清算基金。

客户参与标准债券远期集中清算业务，应向综合清算会员交纳保证金，保证金要求不得低于上海清算所以对综合清算会员要求的标准。客户向综合清算会员交纳至上海清算所的代理业务保证金，归客户所有，应仅用于履行集中清算所产生的债权债务及其违约处理。综合清算会员应将客户提交的保证金与自有资产相隔离，严禁挪作他用。

本指南所指保证金和清算基金仅适用于标准债券远期业务。

4.5 业务培训

清算会员应及时安排相关清算人员参加由上海清算所组织的标准债券远期专项业务培训。通过业务培训并获得上海清算所认可的业务经办资格的清算人员，开展相关的业务工作。

5. 会员资格及相关信息变更与调整

5.1 会员资格变更与调整

5.1.1 清算会员资质变更及信息报备

清算会员如发生机构本身或其业务资质相关信息变更的，需

向上海清算所申请变更或备案，包括但不限于：

(1) 清算会员发生机构改制、重组、分立、合并等重大资质变更的，需在变动后的5个工作日内向上海清算所提交《标准债券远期清算会员信息变更报备表》（附表A-11-1）及相关资料。上海清算所在收到变更申请表后及时反馈变更结果。

(2) 清算会员发生机构法人代表、股东、注册资金、清算专员等基本信息或业务信息变更的，需在信息变更后的5个工作日内向上海清算所报备，提交《标准债券远期清算会员信息变更报备表》（附表A-11-1）及相关资料。

(3) 发生与清算会员及其标准债券远期业务相关的，如法律纠纷、商业案件、行政处罚等情形，清算会员需及时向上海清算所报备，上海清算所有权根据情况进行变更、审查等相关处理。

5.1.2 清算会员自营或代理业务资格终止

清算会员申请终止标准债券远期自营或代理业务资格的，需向上海清算所提交《标准债券远期清算会员资格终止申请表》（附表A-12）。上海清算所收到符合要求的终止清算会员资格申请材料后，于20个工作日内及时反馈审核意见。上海清算所审核时主要考虑的因素包括：会员是否有能力与上海清算所结清本业务的债权债务；会员退出对市场是否有重大影响；上海清算所认定的其他情形。上海清算所审核同意终止的，书面通知清算会员。

清算会员应在收到上海清算所的书面审核同意终止文件之日起15个工作日内办结相关手续，并与上海清算所不存在基于

本业务的债权债务关系。综合清算会员还应当协助客户办理移仓等相关工作。

清算会员完成终止或取消清算会员资格的相关手续后，上海清算所正式注销其清算会员资格并向市场公告。

清算会员可根据《保证金管理办法》的相关规定，在结清与上海清算所的相关债权债务后，向上海清算所申请退还保证金余额。

根据《清算基金与风险准备金管理办法》的相关规定，上海清算所终止清算会员参与标准债券远期业务的资格或批准清算会员退出标准债券远期业务的，该清算会员对标准债券远期业务的清算基金交纳义务自上海清算所批准的生效日终止。终止后，上海清算所退还该清算会员所交纳的标准债券远期业务的剩余清算基金（包括应计利息）。在终止生效日日终前标准债券远期业务发生违约事件的，上海清算所可待违约事件处理完成之后退还相应的剩余清算基金。

清算会员如发生评级下调、停业、整顿、接管、解散、清算破产等重大问题的，或严重违反上海清算所业务规则（包括但不限于业务规则、业务指南、办法、通知、公告、指引及操作流程等）、《清算会员管理办法》及实施细则认定的其他情形，上海清算所有权终止其清算会员资格，办理资格注销，并结清双方之间的债权债务。对未了结的债务，上海清算所有权进行追索，包括为综合清算会员所代理的客户进行强制移仓处理等。

5.1.3 客户终止代理关系

客户申请终止代理关系的，需由客户向综合清算会员提出申请。综合清算会员也可根据其业务、风险管理制度主动终止与客户的代理关系。综合清算会员应在代理关系终止前3个工作日内向上海清算所提交《标准债券远期综合清算会员代理客户终止报备表》（附表A-13）。

5.2 清算限额调整

5.2.1 清算会员限额调整

清算会员可根据自身业务开展情况自主申请增加或减少清算限额。清算会员申请清算限额调整的，应向上海清算所提交《标准债券远期清算限额（调整）申请表》（附表A-9），对调整进行相关说明，说明内容应包括但不限于以下内容：申请机构相关业务开展情况，限额调整的原因等。

上海清算所在收到清算限额调整申请后，及时反馈审核结果。审核通过的清算限额调整于次一工作日生效。

上海清算所有权根据清算参与者历史净持仓头寸等实际情况调整清算参与者的清算限额。上海清算所主动调整对清算参与者清算限额的，应向清算会员发送《标准债券远期集中清算业务清算限额调整通知》。

上海清算所每日对清算参与者持仓总数进行计算和监测，并计算当月或当季度会员实际持仓均值。清算参与者清算限额不低于其月度/季度实际持仓均值×清算限额调整因子，清算限额调

整因子由上海清算所另行规定。如会员申请的清算限额低于上述指标，上海清算所将按照上述指标调整会员的清算限额。

5.2.2 客户限额调整

客户清算限额、持仓限额发生调整的，综合清算会员应提前3个工作日向上海清算所提交《标准债券远期综合清算会员代理客户信息变更报备表》（附表 A-11-2）进行限额调整的报备，并完成客户最低保证金交纳到账，同步通过会员端完成客户保证金台账维护。

上海清算所有权根据清算参与者历史净持仓头寸等实际情况调整清算参与者的清算限额。上海清算所主动调整对清算参与者清算限额的，应向清算会员发送《标准债券远期集中清算业务清算限额调整通知》。

5.3 账户信息变更

5.3.1 清算会员账户信息变更

清算会员更名时，应同时变更账户名称，向上海清算所提交《标准债券远期清算会员信息变更报备表》（附表 A-11-1）、名称变更相关证明材料及新签署的清算协议、《清算会员协议》及其补充条款。上海清算所审核无误后，办理更名手续，并出具《账户更名确认书》。更名手续完成后，新清算协议替代更名前的清算会员与上海清算所签署的各类清算协议。

清算会员法定代表人、授权人员、预留资金往来账户和联络信息变更的，清算会员须委托经办人持相关证明材料和授权委托

书，提交《标准债券远期清算会员账户信息（变更）登记表》（附表 A-3），上海清算所收到登记表后及时进行信息更新并反馈结果。

5.3.2 客户信息变更

客户更名及账户信息等发生变更时，其综合清算会员应提前 3 个工作日向上海清算所提交《标准债券远期综合清算会员代理客户信息变更报备表》（附表 A-11-2）和新签署的《标准债券远期集中清算业务代理客户清算协议》（客户更名时适用）等。

6. 清算和结算处理

6.1 交易数据接收和处理

对交易双方在上海清算所规定的持仓限额内达成、且选择集中清算的标准债券远期交易，上海清算所实时接单，完成合约替代，适用集中清算协议。

上海清算所自动实时接收成交数据，并进行清算处理，当日日终生成并发布清算单据，并据此作为与清算会员办理保证金清算结算的有效凭证。

6.2 清算结算流程

6.2.1 日前清算准备

T-1 日日终-T 日 8:30，清算系统准备。

6.2.2 日间清算处理

9:00-12:00 及 13:30-16:30，对在上海清算所规定的持仓限额内达成、且选择集中清算的交易，上海清算所实时接单，完成

合约替代。

清算系统进行交易持仓维护、风险监测和计费管理，实时计算各清算参与者净持仓数，进行日间风险监测。

16:30，清算系统停止接收交易数据。

6.2.3 日间保证金追缴

6.2.3.1 自营业务日间保证金追缴

上海清算所实时监测全市场交易及清算参与者持仓和盯市损益情况，可日间向清算会员发出追加保证金的通知，对于日间保证金追缴要求，若清算会员保证金账户余额不足的，清算系统会向大额支付系统发送即时转账报文或向上海清算所资金系统发送扣款指令，将清算会员保证金应追缴金额从清算会员资金结算账户划拨至清算会员保证金账户。因清算会员资金结算账户金额不足导致在规定时间内划扣失败的，构成保证金追缴违约，按保证金追缴违约程序处理。

6.2.3.2 代理业务日间保证金追缴

上海清算所通过综合清算会员代理保证金账户实现对客户的持仓和盯市损益的监测。对需进行保证金追缴的代理保证金账户，向综合清算会员发出追加保证金的通知。因综合清算会员代理资金结算账户金额不足导致在规定时间内划扣失败的，构成综合清算会员保证金追缴违约，按保证金追缴违约程序处理。

6.2.4 T日日终清算与T+1日结算处理

6.2.4.1 自营业务T日日终清算与T+1日结算处理

T日16:30至19:00前，清算系统计算各清算参与者的保证金要求，生成并通过会员终端发布清算单据。

T+1日11:00，完成T日保证金要求与盯市盈亏的净额结算。清算系统将检查清算会员的保证金要求、前一日盯市盈利与保证金账户总额的差额（即为保证金账户可用余额）。

若可用余额大于等于0，则清算系统将完成清算会员间盈亏资金的结算。若可用余额小于0，则清算系统将按照清算会员资金结算路径，向大额支付系统发送即时转账报文或向上海清算所资金系统发送扣款指令，将自营或代理保证金应追缴金额从资金结算账户划拨至保证金账户，完成保证金和盈亏结算。

正常完成扣款和收款的自营清算会员将从会员终端获得T日的保证金结算清单，显示保证金账户中资金的收付情况；综合清算会员将从会员终端获得T日代理客户的保证金结算清单明细；未完成扣款的，该会员构成保证金结算违约，清算系统生成保证金结算违约通知单并通知该会员，并按违约处理程序办理。

6.2.4.2 代理业务T日日终清算与T+1日结算处理

对于非清算会员，系统逐一计算各代理客户的保证金要求并与客户保证金余额进行比较。其余处理流程同6.2.4.1自营业务T日日终清算与T+1日结算处理。

7. 风险管理

7.1 风险监控

上海清算所对清算会员的合约组合及其盯市损益情况进行风险监控，并采用包括回归测试、压力测试、会员资信评估、市场流动性评估等方式对市场风险因素、清算会员信用风险和市场流动性风险进行监测。上海清算所有权视风险监控具体情形，针对风险异常情况，对清算会员采取风险提示、追加变动保证金、限制开仓、强行平仓、强制结算等各项风控措施。

7.2 持仓计算与持仓限额

7.2.1 持仓计算

清算参与者持仓数量为该清算参与者所持各合约净持仓数量的绝对值乘以转换系数后加总，不同合约之间不能轧差。综合清算会员代理的各客户之间不能轧差。

由于不同合约可能设置不同的保证金率，上海清算所将提前指定某一合约为参考合约，并通过转换系数的方式将不同合约换算成参考合约。

清算参与者持仓总数

$$\begin{aligned} &= |\text{合约 1 净持仓数}| * \text{转换系数 1} + |\text{合约 2 净持仓数}| * \text{转换系数 2} + \dots + |\text{合约 N 净持仓数}| * \text{转换系数 N} \\ &= \sum [|\text{合约 i 净持仓量}| * \text{转换系数 i}] \end{aligned}$$

其中，转换系数 $i = \text{合约 } i \text{ 保证金率} / \text{参考合约保证金率}$ 。

各合约保证金率由上海清算所定期测算并公布。

7.2.2 持仓限额

单一清算参与者持仓总数不得超过其持仓限额，持仓限额= $\max(\text{清算限额}, \text{前一日日终持仓数量}) + (\text{容忍度} / \text{参考合约保证金比率})$ 。清算会员可根据自身业务开展情况自主申请和调整清算限额。上海清算所有权根据业务实际情况调整清算参与者的清算限额。（参见 5.2 清算限额调整）

清算会员自营及代理业务容忍度由上海清算所根据清算会员的资信情况、历史交易持仓水平等因素确定，综合清算会员应向上海清算所申报每个客户的容忍度，但其所有客户的容忍度之和不得超过该综合清算会员代理业务容忍度。综合清算会员可向上海清算所申请调整其客户容忍度，经上海清算所审核通过后生效。

7.3 价格计算

7.3.1 每日结算价格

根据合约成交时间、成交价格 and 成交量，按如下方式计算产生每日结算价格：

- (1) 取当日最后2小时成交的加权价格；
- (2) 若最后2小时的成交笔数少于5笔，则取当日最后5笔交易的加权价格；
- (3) 若全天该合约的成交笔数少于5笔，由交易中心组织报价团报价，报价团组织及具体报价方法由交易中心商上海清算所共同确定并对外发布。

7.3.2 到期交割价格

按照提前选取好的一篮子债券及事先公布的价格计算公式计算到期交割价，若一篮子债券当日没有成交价，由上海清算所组织报价团对标的债券进行报价，报价团组织及具体报价方法由上海清算所商交易中心共同确定并对外公布。

7.4 盯市损益计算

上海清算所根据合约的日间盯市价或每日结算价计算每个清算参与者的盯市损益，盯市损益包括日间盯市损益和日终盯市损益。

7.4.1 日间盯市损益

日间盯市损益用于日间风险监控。清算参与者出现较大盯市亏损的，上海清算所有权要求清算会员（或代理客户参与本业务的综合清算会员）交纳日间盯市保证金。

日间盯市损益=

$$\sum_{\text{合约 } i} \sum_{\text{交易 } j} [\text{当日日间成交名义本金} \times (\text{日间盯市价}_i - \text{成交价}_j) / 100 \times \text{买卖方向系数}]$$

+

$$\sum_{\text{合约 } i} [|\text{前一日日终净持仓}| \times (\text{日间盯市价}_i - \text{前一日结算价}_i) / 100 \times \text{持仓方向系数}]$$

其中，合约*i*的日间盯市价取该合约当日最近5笔的加权平均价；若少于5笔，取当天该合约全部交易的加权平均价；若当日无交易，取该合约前一日结算价为日间盯市价。

买卖方向系数中，当日成交的合约买方系数为+1，卖方系数为-1；持仓方向系数中，买持仓的为+1，卖持仓的为-1。根据日间盯市损益公式计算结果为负的，表示盯市亏损。

7.4.2 日终盯市损益

日终盯市损益用于上海清算所与清算会员的每日盈亏结算。上海清算所每日日终出具的清算单据中列明每个清算参与者的当日损益，于下一工作日上午规定时点，在保证金账户完成日终盯市损益资金的结算。

$$\begin{aligned}
 & \text{日终盯市损益} = \\
 & \sum_{\text{合约 } i} \sum_{\text{交易 } j} [\text{当日日间成交名义本金} \times (\text{当日结算价}_i - \\
 & \text{成交价}_j) / 100 \times \text{买卖方向系数}] \\
 & + \\
 & \sum_{\text{合约 } i} [|\text{前一日日终净持仓}| \times (\text{当日结算价}_i - \text{前一日结算价}_i) \\
 & / 100 \times \text{持仓方向系数}]
 \end{aligned}$$

买卖方向系数中，当日成交的合约买方系数为+1，卖方系数为-1；持仓方向系数中，买持仓的为+1，卖持仓的为-1。

根据日终盯市损益计算结果为正的，表示当日为盯市盈利；根据日终盯市损益计算结果为负的，表示当日为盯市亏损。

7.5 保证金计算

保证金包括最低保证金、变动保证金和特殊保证金。

7.5.1 最低保证金

最低保证金是清算会员根据上海清算所规定事先缴纳的现金或上海清算所认可的有价证券或资产，用于弥补清算会员违规违约情况下，上海清算所进行违约处理所产生的一定置信度下的潜在损失。最低保证金要求的计算方式如下：

最低保证金要求=清算参与者清算限额×参考合约保证金率

清算会员在参与中央对手清算业务之前，应根据上海清算所规定按时、足额交纳该清算业务的最低保证金。

7.5.2 变动保证金

变动保证金包括盯市保证金和超限保证金。

（一）盯市保证金

盯市保证金是清算参与者根据上海清算所对其持有的标准债券远期合约进行逐日盯市和风险监测的结果交纳的保证金，用于弥补清算参与者持仓的盯市亏损。

盯市保证金分为日间盯市保证金和日终盯市保证金。

日间盯市保证金要求由人工触发追缴，日间盯市保证金要求为日间盯市损益，日终归零。

日终盯市保证金由上海清算所每日日终计算并于次日结算。当日日终盯市损益计算结果为盈利的清算参与者，当日日终盯市保证金要求为 0；当日日终盯市损益计算结果为亏损的清算参与者，当日日终盯市保证金要求为当日日终盯市亏损值。

（二）超限保证金

超限保证金是清算参与者实际持仓超出清算限额时缴纳的保证金，用于弥补清算参与者违规违约时，上海清算所进行违约处理所产生的潜在损失中最低保证金无法覆盖的部分。超限保证金要求计算公式为：

超限保证金要求=Max（清算参与者持仓-清算限额，0）×参考合约保证金率×风控乘数

风控乘数大于等于 1，一般情况下取值为 1。

7.5.3 特殊保证金

特殊保证金用于弥补异常情况下清算会员违规违约给上海清算所造成的潜在额外损失。

特殊保证金要求由人工触发追缴，日终不自动清零。

7.5.4 日终保证金要求计算

每日日终闭市后，上海清算所以对清算参与者标准债券远期合约组合计算对应的日终保证金要求：

日终保证金要求=最低保证金要求+变动保证金要求+特殊保证金要求

其中，当日日终盯市损益计算结果为盈利的清算参与者，当日日终盯市保证金要求为 0，盈利金额计入盯市盈利，次一工作日与保证金要求一同轧差结算；当日日终盯市损益计算结果为亏损的清算参与者，当日日终盯市保证金要求为当日盯市亏损值。

综合清算会员代理业务的保证金要求为其代理客户的保证金要求之和，由综合清算会员负责交纳至上海清算所。

8. 资金操作处理

8.1 资金结算账户操作

8.1.1 存入

资金结算账户的设立，自营清算会员可以使用大额支付系统备付金账户直接作为资金结算账户；也可在上海清算所开立资金结算专户，通过其开户银行直接将款项汇入开立在上海清算所的指定资金结算专户；综合清算会员代理业务必须在上海清算所开立代理资金结算专户。上海清算所在收到款项后，记增清算会员的资金结算专户余额。

汇款时应注意以下几点：

(1) 汇款时间：工作日 16:30 前。

(2) 结算方式：人行大额支付系统。

(3) 请正确填写收款人信息。收款人名称、收款人账号应分别填写清算会员在上海清算所开立的资金结算专户的户名、账号，收款人开户行名称、行号应分别填写银行间市场清算所、909290000007。

示例：XXX 证券股份有限公司在上海清算所开立的资金结算专户户名、账号分别为 XXX 证券公司资金结算专户、1000+持有人账号+XXXX，则收款人信息的填写方法如下：

收款人名称：XXX 证券公司资金结算专户

收款人账号：1000+持有人账号+XXXX

收款人开户行：银行间市场清算所

收款人开户行行号：909290000007

清算会员可通过上海清算所会员端实时查询资金结算专户余额和资金出入记录。

8.1.2 计息

对清算会员资金结算专户的资金，上海清算所按中国人民银行公布的人民币活期存款基准利率或双方约定的利率向清算会员计付利息。

计息规则：按日计息，按季结息，计息期间遇利率调整分段计息，每季度末月的20日为结息日。

计息方法：积数计息法

付息日：结息日后的第一个工作日。

清算会员应收利息直接计入其上海清算所开立的资金结算专户中。

8.2 保证金操作

保证金是清算会员向上海清算所缴纳的现金或有价证券，用于弥补清算会员违规违约对上海清算所造成的损失。保证金包括最低保证金、变动保证金和特殊保证金。

8.2.1 保证金的交纳

(1) 业务开展前的最低保证金交纳

清算参与者正式开展业务前应交纳最低保证金。

对于清算会员自营业务，上海清算所发出《关于参与标准债券远期集中清算业务有关事宜的通知》或《标准债券远期集中清

算业务清算会员资格认定通知书》后，清算会员应在收到通知后的 10 个工作日内将足额资金汇入标准债券远期业务的资金结算账户，上海清算所在收到资金后，将其转入清算会员的保证金账户。对于代理业务，综合清算会员应在向上海清算所提交《标准债券远期综合清算会员代理客户信息登记表》（附表 A-2-4）备案后，根据上海清算所的保证金清单，按时将足额保证金汇入上海清算所指定的代理资金结算账户。上海清算所在收到资金后，记增综合清算会员代理保证金账户余额。综合清算会员应于不迟于报备的代理客户生效日期前两个工作日完成客户最低保证金缴纳的台账维护，记录保证金交纳台账。

清算会员可通过上海清算所会员终端实时查询保证金账户余额和资金出入记录。

（2）最低保证金调整

根据清算限额等变化，清算参与者的最低保证金要求随之调高或调低。

最低保证金要求调低的，上海清算所将于调整生效日自动释放相应保证金，相应增加清算参与者保证金账户可用余额。

最低保证金要求调高、且清算参与者保证金账户可用余额不足的，上海清算所将于生效日前一工作日向清算会员发出调整后的最低保证金要求（包含在日终清算单据中）。

（3）保证金追缴和保证金结算

日终和日间保证金计算得出清算参与者保证金应追缴金额，

进入保证金结算和追缴的处理流程（参见 6.2 清算结算流程）。

8.2.2 保证金计息

保证金的计息采用中国人民银行公布的人民币活期存款基准利率或双方约定的利率计算。最低保证金、变动保证金计息所采用利率以上海清算所公布数据为准。

计息规则、计息方法、付息日同结算资金相应处理。

保证金账户的结息金额计入保证金账户。

8.2.3 保证金提取

清算会员根据日终清算单据中的可提取金额，可通过上海清算所会员终端提交保证金提取申请；客户无法直接提取保证金，可通过综合清算会员在会员终端提交代理保证金提取申请。

保证金账户可提取金额=Max(保证金账户总额-保证金要求, 0)

保证金提取指令需在每个工作日 11:00 完成结算后，至 16:30 闭市前提交。

上海清算所在核实保证金账户可用余额为正后，记减清算会员的保证金账户可用余额，并根据其资金结算路径的不同进行后续处理：

(1) 对资金结算账户开立在大额支付系统的，清算系统生成即时转账报文，将相应资金主动划付至清算会员大额支付系统清算账户；

(2) 在上海清算所开立资金结算专户的，则直接记增其资

金结算专户余额，清算会员可将相应资金从该专户划拨至其预留的往来账户。代理业务一律需要新开代理资金结算专户。

清算会员可通过会员终端查询提取申请的处理状态。

8.3 清算基金操作

清算基金是指清算会员参与标准债券远期业务前缴纳的现金，以弥补清算会员违约时保证金不足以覆盖的损失。

8.3.1 清算基金计算

清算基金按清算限额及清算基金比例收取。清算限额调整后的次一工作日，清算基金进行相应调整。

清算基金=清算会员自营清算限额和代理清算限额×清算基金比例。

清算基金比例=压力测试结果÷会员清算限额之和。

压力测试结果是指在最大两家清算会员同时违约情况下可能产生的损失。

8.3.2 清算基金交纳

上海清算所计算清算会员应交纳的清算基金数额，向清算会员发出初始清算基金交纳通知或清算基金调整通知。清算会员应在收到清算基金交纳及调整通知后的 10 个工作日内，将足额清算基金通过大额支付系统或其开户银行直接将款项汇入上海清算所指定的清算基金专户，上海清算所在收到资金后，记增清算会员的清算基金资金余额，并向清算会员发送清算基金到账通知。

清算基金汇款注意事项与资金结算账户的资金存入操作相同。

8.3.3 清算基金释放

清算基金调低的，上海清算所在调低后的次一工作日将清算会员调低资金划付清算会员的资金结算账户（开立在清算所的资金结算专户或开立在大额支付系统的清算账户）。

8.3.4 清算基金计息

清算基金的计息采用中国人民银行公布的人民币 3 个月定存利率计算。

9. 交割机制

标准债券远期业务初期实行现金交割机制。实物交割机制另行规定。

处理流程如下：

最后交易日 12:00，到期合约闭市；日终，上海清算所计算并发送交割资金结算清单。

交割日 11:00，上海清算所完成现金交割。

现金交割金额=

$$\sum_{\text{合约 } i} \sum_{\text{交易 } j} [\text{最后交易日成交名义本金} \times (\text{现金交割价}_i - \text{成交价}_j) / 100 \times \text{买卖方向系数}]$$

+

$$\sum_{\text{合约 } i} [|\text{前一日日终净持仓}| \times (\text{现金交割价}_i - \text{前一日结算价}_i) / 100 \times \text{持仓方向系数}]$$

买卖方向系数中，当日成交的合约买方系数为+1，卖方系数为-1；持仓方向系数中，买持仓的为+1，卖持仓的为-1。

根据现金交割金额计算结果为正的，表示现金交割盈利；根据现金交割金额计算结果为负的，表示现金交割亏损。

若存在现金交割违约，上海清算所将按交割违约流程进行处置。

10. 代理业务注意事项

10.1 客户首次参与业务

综合清算会员新增首次参与本业务的客户的，应在代理客户生效前，向上海清算所报送备案材料，并完成客户最低保证金交纳到账。有关备案材料，参见 3.3 综合清算会员资格申请条件；有关客户最低保证金交纳，参见 8.2.1 保证金的交纳。

10.2 客户代理客户关系终止

综合清算会员与客户终止代理客户关系的，应在终止生效日期 3 个工作日前，向上海清算所报送《标准债券远期综合清算会员代理客户终止报备表》（附表 A-13）。

10.3 客户代理关系变更

客户可以自主更换综合清算会员，变更代理清算关系。客户发生代理清算关系变更的，应结清与原综合清算会员的债权债务关系。原综合清算会员应在代理客户终止生效日期 3 个工作日前，向上海清算所报送《标准债券远期综合清算会员代理客户终

止报备表》（附表 A-13）备案。

新选择的综合清算会员应在新代理客户生效日期 3 个工作日内，将与客户签署的《标准债券远期集中清算业务代理客户清算协议》、《标准债券远期综合清算会员代理客户信息登记表》（附表 A-2-4）等提交上海清算所备案，并完成客户最低保证金交纳到账。

上海清算所收齐相关材料后，完成客户的代理清算关系变更，同步将由原综合清算会员代理的该客户头寸和相应客户保证金转移至新综合清算会员。

10.4 客户清算限额调整

综合清算会员调整客户清算限额的，应于新限额生效前，向上海清算所提交《标准债券远期综合清算会员代理客户信息变更报备表》（附表 A-11-2）进行限额调整的报备，并完成客户最低保证金交纳到账，上海清算所在变更生效日通过会员终端反馈调整结果。

10.5 客户的保证金结算处理

综合清算会员应根据上海清算所提供的代理保证金账户清单明细，与客户逐个完成保证金与每日盯市盈亏结算。参见 6.2.4 T 日日终清算与 T+1 结算处理。

10.6 客户的清算费用

综合清算会员应向客户收取代理清算相关费用，费用标准原则上不得低于上海清算所收费标准。

10.7 综合清算会员代理业务终止

综合清算会员终止代理业务的，需向上海清算所提交《标准债券远期清算会员资格终止申请表》（附表 A-12），并在 5 个工作日内完成代理客户终止的报备。客户经由新选择的综合清算会员向上海清算所提交代理客户变更报备。上海清算所逐个完成客户的代理关系变更。

11. 违约处理

11.1 保证金结算违约和交割违约的处理

清算会员未能在上海清算所发出日间保证金追缴通知后规定时间内于指定账户备足相应资金，导致保证金追缴失败，为日间保证金追缴违约；清算会员未能在日终保证金结算规定时点（T+1 日 11:00）内于指定账户备足相应资金，导致保证金结算失败，为日终保证金结算违约；清算会员未能在现金交割结算规定时点（T+1 日 11:00）内于指定账户备足相应资金，导致现金交割失败，为交割违约。发生上述三种情况或其他上海清算所认定的清算会员违约情况时，上海清算所可视实际情况采取以下措施中的一种或多种进行违约处理：

（1）暂停违约清算会员标准债券远期业务资格。

（2）如为代理清算业务发生违约，综合清算会员应及时向上海清算所报告客户发生违规、违约等相关情况。上海清算所可在审核后对未违约的客户进行移仓。

（3）冻结违约清算会员开立在上海清算所的保证金账户，

和清算基金账户，冻结违约清算会员违约处置期¹间的应收资金。

(4) 启动银行授信机制，融入资金以完成对未违约清算会员的资金结算。

(5) 按照违约金额的千分之一逐日计收违约罚金，不足一日的，按一日计算。

(6) 对违约清算会员及违约客户的持仓进行强行平仓和强制结算。

(7) 上海清算所认为必要的其他措施。

11.2 违约后续处理

清算会员发生违约情形时，上海清算所将向其发送保证金结算违约通知单，违约清算会员应于规定时点前履行保证金结算义务，足额将违约金额和违约罚金补交至上海清算所。

按时完成足额补交的，上海清算所恢复违约清算会员及违约客户的标准债券远期业务资格，解冻其保证金账户及清算基金；已启动银行授信的，偿还授信银行相应资金，支付授信费，向违约清算会员发送《罚息通知单》。

未按时完成足额补交的，上海清算所可启动对违约清算会员及违约客户的强行平仓和强制结算处理程序，并有权取消违约清算会员的业务资格。

11.3 强行平仓

上海清算所实行强行平仓制度。强行平仓是指上海清算所按

¹违约处置期：是指自上海清算所认定清算会员违约当日至违约处置完成日所包含的时间。

照有关规定对违约清算参与者持仓实施强制出售以弥补违约损失。

违约清算参与者未在规定时间内按要求补交违约金额及违约罚金的，由上海清算所对其持有的未平仓标准债券远期合约进行强行平仓。

违约清算参与者有义务配合上海清算所进行强行平仓。

11.4 强制结算

上海清算所实行强制结算制度。强制结算制度是指上海清算所为防范风险，在强行平仓无法执行时，将持有该协议的对手方持仓按一定规则强制进行结算的措施。

11.5 损失弥补

上海清算所按以下顺序动用风险准备资源，弥补清算会员违约时产生的相关费用和损失：

- (1) 违约清算会员、客户交纳的标准债券远期业务保证金；
- (2) 违约清算会员交纳的标准债券远期业务清算基金；
- (3) 上海清算所风险准备金的一定比例与未违约清算会员交纳的清算基金；
- (4) 未违约清算会员根据上海清算所规定补充交纳的相关清算业务清算基金；
- (5) 上海清算所剩余的风险准备金。

详细处理办法依据上海清算所《清算基金与风险准备金管理办法》执行。

11.6 客户违约的处理

客户对综合清算会员构成违约，但综合清算会员在代理清算业务中未发生违约的，综合清算会员有权主动中止对客户的代理服务，依照协议对违约客户进行处置并追索损失。上海清算所可协助综合清算会员进行处置，产生的相关费用和损失由综合清算会员承担。

12. 应急业务处理

12.1 应急处理范围

清算会员因网络、系统或其他原因，无法及时通过上海清算所会员终端进行相关操作的，可通过应急方式办理相关业务。

应急操作适用的业务情况包括以下几种：

- (1) 会员终端无法正常发送提款指令；
- (2) 会员终端无法正常接收保证金账户清单、保证金账户结算清单等相关文件；
- (3) 会员终端无法正常进行账户余额等相关信息的查询；
- (4) 其他临时出现的会员终端异常情况。

12.2 办理流程

为保证标准债券远期业务的正常进行，清算会员需启用应急操作的，可在电话通知上海清算所后，启动应急操作。

- (1) 会员终端无法正常发送提款指令的应急操作流程

应急情况下，应填制《保证金提取应急指令书》（附表 B-1），于工作日 16:00 前以传真方式发送至上海清算所。上海清算所将

验印并检查会员保证金账户可用余额，按应急指令书指定账户划款。业务完成后，会员将收到上海清算所的电话，告知处理结果。

(2) 会员终端无法正常接收保证金账户清单、保证金账户结算清单等相关文件的应急操作流程

应急情况下，清算会员应在工作日不晚于 11:00，将加盖单位预留印鉴章并列明所需协助下载内容的情况说明传真至上海清算所。

(3) 会员终端无法正常进行账户余额等相关信息查询的应急操作流程

应急情况下，清算会员应在工作日不晚于正常业务截止前 30 分钟致电上海清算所查询相关信息，及时将加盖单位预留印鉴章并列明所需协助下载内容的情况说明传真至上海清算所，上海清算所将以人工方式通过电话告知。

(4) 其他临时出现的会员终端异常情况的应急操作流程

应急情况下，清算会员应在工作日不晚于正常业务截止前 30 分钟致电上海清算所反映相关异常情况，及时将加盖单位预留印鉴章并列明所需协助下载内容的情况说明传真至上海清算所，上海清算所视情况进行相应处理。

13. 清算费用

上海清算所按照有偿服务的原则，向清算会员收取标准债券远期业务的相关费用。

13.1 收费流程

(1) 上海清算所于新季度第一个月月初汇总清算会员上一季度的各项应交费用，生成缴费通知单，并通过会员终端发送至各清算会员。

(2) 清算会员可通过会员终端查询、下载缴费通知单，核对无误后于新季度第一个月 25 日前在其资金结算账户中备足相应资金，上海清算所将于该月 25 日进行费用扣收；选择大额支付系统偿付保证金的，上海清算所将于该月 25 日发送费用扣收指令。

13.2 收费组成

本清算业务的费用包括清算费、清算会员费等费用。

清算费 = 单笔基本费 + 清算金额 × 清算费率

式中，“单笔基本费”为 10 元，“清算费率”为百万分之五，自营和代理业务清算费率相同。

业务上线后的第一季度免收清算费，后一季度内减半收取。

清算会员费由上海清算所另行规定。

上海清算所可根据本业务今后开展情况，对费用实行优惠。

14. 附表

以下分为业务申请、变更、终止表单（A 类）、业务应急表单（B 类）。

A-0 标准债券远期集中清算业务申请材料适用情况一览表

- A-1-1 标准债券远期清算会员资格申请书
- A-1-2 标准债券远期集中清算业务申请书
- A-1-3 标准债券远期综合清算会员申请书
- A-2-1 标准债券远期清算会员基础信息表
- A-2-2 标准债券远期集中清算业务基础信息表
- A-2-3 标准债券远期集中清算代理业务基础信息表
- A-2-4 标准债券远期综合清算会员代理客户信息登记表
- A-3 标准债券远期清算会员账户信息（变更）登记表
- A-4 资金结算专户（标准债券远期专用）开户申请表
- A-5 标准债券远期集中清算业务印鉴卡
- A-6 法人代表委托授权书及身份证明材料
- A-7-1 标准债券远期清算会员终端管理员信息（变更）登记表
- A-7-2 标准债券远期综合清算会员代理业务会员终端管理员信息（变更）登记表
- A-8-1 标准债券远期清算会员费用发票寄送信息（变更）登记表
- A-8-2 标准债券远期综合清算会员代理业务费用发票寄送信息（变更）登记表
- A-9 标准债券远期清算限额（调整）申请表
- A-10 财务数据表
- A-11-1 标准债券远期清算会员信息变更报备表

A-11-2 标准债券远期综合清算会员代理客户信息变更报备
表

A-12 标准债券远期清算会员资格终止申请表

A-13 标准债券远期综合清算会员代理客户终止报备表

B-1 保证金提取应急指令书

A-0 标准债券远期集中清算业务申请材料适用情况一览表

| 序号 | 资料内容 | 已是上海清算所清算会员的机构申请时提供 | 非上海清算所清算会员申请时提供 | 申请综合清算会员时提供 | 变更时提供 |
|-------|-----------------------|---------------------|-----------------|-------------|-------|
| A-1-1 | 标准债券远期清算会员资格申请书 | | √ | | |
| A-1-2 | 标准债券远期集中清算业务申请书 | √ | | | |
| A-1-3 | 标准债券远期综合清算会员申请书 | | | √ | |
| A-2-1 | 标准债券远期清算会员基础信息表 | | √ | | |
| A-2-2 | 标准债券远期集中清算业务基础信息表 | √ | | | |
| A-2-3 | 标准债券远期集中清算代理业务基础信息表 | | | √ | |
| A-2-4 | 标准债券远期综合清算会员代理客户信息登记表 | | | √ | |
| A-3 | 标准债券远期清算会员账户信息（变更）登记表 | √ | √ | | √ |
| A-4 | 资金结算专户（标准债券远期专用）开户申请表 | (√) 或有 | (√) 或有 | √ | |
| A-5 | 标准债券远期集中清算业务印鉴卡 | √ | √ | √ | √ |

| | | | | | |
|--------|----------------------------------|---|---|---|---|
| A-6 | 法人代表委托授权书及身份证明材料 | √ | √ | √ | √ |
| A-7-1 | 标准债券远期清算会员终端管理员信息（变更）登记表 | √ | √ | | √ |
| A-7-2 | 标准债券远期综合清算会员代理业务会员终端管理员信息（变更）登记表 | | | √ | √ |
| A-8-1 | 标准债券远期清算会员费用发票寄送信息（变更）登记表 | √ | √ | | √ |
| A-8-2 | 标准债券远期综合清算会员代理业务费用发票寄送信息（变更）登记表 | | | √ | √ |
| A-9 | 标准债券远期清算限额（调整）申请表 | √ | √ | | √ |
| A-10 | 财务数据表 | | √ | | |
| A-11-1 | 标准债券远期清算会员信息变更报备表 | | | | √ |
| A-11-2 | 标准债券远期综合清算会员代理客户信息变更报备表 | | | | √ |
| A-12 | 标准债券远期清算会员资格终止申请表 | | | | √ |
| A-13 | 标准债券远期综合清算会员代理客户终止报备表 | | | | √ |
| 其他 | 最新经年检的法人营业执照复印件 | | √ | | √ |

| | | | | | |
|--|---------------------------------|----------------|---|---|---|
| | 机构法人许可证复印件 | | √ | | √ |
| | 组织机构代码证复印件 | | √ | | √ |
| | 最近两个会计年度经审计的财务报告 | | √ | | |
| | 一式四份已签署的《标准债券远期集中清算协议》 | √ | √ | | √ |
| | 一式四份已签署的《标准债券远期集中清算协议》 的补充协议 | | | √ | √ |
| | 一式四份已签署的《清算会员协议》 | | √ | | √ |
| | 一式四份已签署的《清算会员协议补充条款》 | √ ² | √ | √ | √ |
| | 《标准债券远期集中清算业务代理客户清算协 议》 | | | √ | √ |

以上所需材料请加盖公章（材料页数在一页以上的须加盖骑缝章）后邮寄至：上海市黄浦区北京东路2号上海清算所会员部（收），邮编：200002；以上材料电子版（Word 或 PDF 版）请发至上海清算所会员专用邮箱 member@shclearing.com。如有疑问，可邮件 member@shclearing.com。

² B类、C类普通清算会员适用。

附表 A-1-1 （非上海清算所清算会员适用）

标准债券远期清算会员资格申请书

银行间市场清算所股份有限公司：

我单位自愿申请银行间市场清算所股份有限公司的标准债券远期集中清算会员资格。

一、本单位基本情况

（简要介绍申请单位概况，包括但不限于注册资本、业务范围、单位历史沿革、行业地位、控股股东情况、内部控制组织机构设置及运行情况等）。

二、本单位在银行间市场相关产品的开展情况

（简要介绍申请单位参与银行间利率衍生品市场各项业务基本情况，参与上海清算所登记托管、现券净额等业务的情况，以及参与上海清算所航运及大宗商品金融衍生品，外汇竞价、询价中央对手清算等业务的情况）。

三、本单位关于参与标准债券远期集中清算业务的初步规划

（简要介绍成为标准债券远期集中清算会员后，申请单位对业务量、内部风险控制等方面的计划）。

四、承诺事项（范例）

我单位成为标准债券远期集中清算会员后，将严格遵守上海清算所标准债券远期集中清算会员管理规定及有关业务规则，服从上海清算所标准债券远期集中清算会员管理，积极配合标准债券远期集中清算会员工作，认真履行标准债券远期集中清算会员义务。有违反上海清算所有关标准债券远期集中清算会员管理规定的，我单位将承担由此引起的一切后果及法律责任。

法人代表或授权代表签章：

单位公章：

日期：

附表 A-1-2（已是上海清算所清算会员适用）

标准债券远期集中清算业务申请书

银行间市场清算所股份有限公司：

我单位自愿申请参加银行间市场清算所股份有限公司的标准债券远期集中清算业务。

一、本单位在银行间市场相关产品的开展情况

（简要介绍申请单位参与银行间利率衍生品市场各项业务基本情况，参与上海清算所登记托管、现券净额等业务的情况，以及参与上海清算所航运及大宗商品金融衍生品，外汇竞价、询价中央对手清算等业务的情况）。

二、本单位关于参与标准债券远期集中清算业务的初步规划

（简要介绍参与标准债券远期集中清算业务后，申请单位对业务量、内部风险控制等方面的计划）。

三、承诺事项（范例）

我单位参与标准债券远期集中清算业务后，将严格遵守上海清算所标准债券远期集中清算业务相关规则，服从上海清算所标准债券远期清算会员管理，认真履行标准债券远期集中清算相关义务。有违反上海清算所有关标准债券远期集中清算业务或会员管理规定的，我单位将承担由此引起的一切后果及法律责任。

法人代表或授权代表签章：

单位公章：

日期：

附表 A-1-3（申请本业务综合清算会员适用）

标准债券远期综合清算会员申请书

银行间市场清算所股份有限公司：

我单位自愿申请银行间市场清算所股份有限公司的标准债券远期集中清算业务综合清算会员资格。

一、本单位银行间利率衍生品市场相关产品的开展情况

介绍本单位开展利率衍生品业务（人民币利率互换、标准债券远期等）的基本情况（从事该业务的时间、开展情况、所获相关奖励等）；

为满足开展标准债券远期业务的需要，我单位设置了相应部门，配备了有关人员，制定了相关的制度和操作流程。

二、本单位参与标准债券远期代理清算业务的初步规划

介绍目前本单位针对标准债券远期代理清算业务所设置的风险管理部门、岗位及人员配备等情况；

介绍目前本单位针对标准债券远期代理清算业务风险点所制定的管理制度、措施及业务流程等情况；

介绍本单位参与标准债券远期代理清算业务后对业务量、代理客户拓展、市场发展、内部风险控制等方面的计划；

为满足开展标准债券远期代理清算业务的需要，我单位设置了相应部门，配备了有关人员，制定了相关的制度和操作流程。

三、其他相关情况

申请机构可列述需要银行间市场清算所股份有限公司知悉的其他事项。

四、承诺事项（范例）

我单位参与标准债券远期代理清算业务后，将严格遵守上海清算所标准债券远期代理清算业务相关规则，认真履行标准债券远期代理清算相关义务，积极拓展标准债券远期代理清算市场。有违反上海清算所有关标准债券远期代理清算业务规定的，我单位将承担由此引起的一切后果及法律责任。

法人代表或授权代表签章：

单位公章：

日期：

附表 A-2-1（非上海清算所清算会员适用）

标准债券远期清算会员基础信息表

| 申请机构基本信息 | | | |
|-------------------------------|---|--------|--|
| 申请机构全称 | | | |
| 申请机构简称 | | | |
| 全国银行间同业拆借 中心会员代码 (21位码) | | | |
| 注册地址 | | | |
| 注册资本 | (万元) | 法定代表人 | |
| 企业法人营业执照号 | | 邮政编码 | |
| 联系人 | | 联系电话 | |
| 传真 | | 电子邮件地址 | |
| 通讯地址 | | | |
| 网页地址 | | | |
| 申请机构类别 | <input type="checkbox"/> 银行金融机构 <input type="checkbox"/> 非银行金融机构 <input type="checkbox"/> 其他_____ | | |
| | <input type="checkbox"/> 政策性银行 <input type="checkbox"/> 国有商业银行 <input type="checkbox"/> 股份制商业银行 <input type="checkbox"/> 城市商业银行 <input type="checkbox"/> 农村商业银行 <input type="checkbox"/> 外资银行 <input type="checkbox"/> 信用社 <input type="checkbox"/> 证券公司 <input type="checkbox"/> 基金公司 <input type="checkbox"/> 年金 <input type="checkbox"/> 保险公司 <input type="checkbox"/> 财务公司 <input type="checkbox"/> 信托公司 <input type="checkbox"/> 央企 <input type="checkbox"/> 一般企业 <input type="checkbox"/> 其他 | | |
| 法人营业执照号码 | | | |
| 金融许可证号码 | | | |
| 组织机构代码证号码 | | | |

| | | | | | | |
|--------------------|---------------|----------|----------|----------|-------|-------|
| 控股股东及控股比例 | | | | | | |
| 实际控制人 | | | | | | |
| 申请机构高管人员信息 | | | | | | |
| | 联系人 | 姓名 | 电话 | 手机 | 传真 | Email |
| 高 管 名 单 | 董事长或法定代表人 | | | | | |
| | 行长(总经理或总裁) | | | | | |
| | 副行长(副总经理或副总裁) | | | | | |
| | | | | | | |
| 申请机构人员信息 | | | | | | |
| | 姓名 | 部门职务 | 手机 | 传真 | Email | 职责 |
| | | | | | | |
| | | | | | | |
| | | | | | | |
| | | | | | | |
| | | | | | | |
| | | | | | | |
| 申请机构财务信息(最近三个会计年度) | | | | | | |
| | 项目 | 20XX年(末) | 20XX年(末) | 20XX年(末) | | |
| | 注册资本(亿元) | | | | | |
| | 净资产(亿元) | | | | | |

附表 A-2-4（首次报备填写）

标准债券远期综合清算会员

代理客户信息登记表

综合清算会员全称_____

综合清算会员代客业务印鉴

综合清算会员代码_____

| 客户基本信息 | |
|---------------------------|--|
| 客户全称 | |
| 客户简称 | |
| 客户账号 | |
| 全国银行间同业拆借中心会员代码 (21位码) | |
| 注册地址 | |
| 通讯地址 | |
| 客户机构类别 | <input type="checkbox"/> 银行金融机构 <input type="checkbox"/> 非银行金融机构 <input type="checkbox"/> 其他_____ |
| | <input type="checkbox"/> 政策性银行 <input type="checkbox"/> 国有商业银行 <input type="checkbox"/> 股份制商业银行 <input type="checkbox"/> 城市商业银行 <input type="checkbox"/> 农村商业银行 <input type="checkbox"/> 外资银行 <input type="checkbox"/> 证券公司 <input type="checkbox"/> 基金公司 <input type="checkbox"/> 年金 <input type="checkbox"/> 保险公司 <input type="checkbox"/> 财务公司 <input type="checkbox"/> 信托公司 <input type="checkbox"/> 央企 <input type="checkbox"/> 一般企业 <input type="checkbox"/> 其他 |
| 客户清算限额(千万) | |
| 客户容忍度(元) | |
| 法人营业执照号码 | |
| 金融许可证号码 | |
| 组织机构代码证号码 | |
| 生效日期 | |
| 客户联系人信息 | |

| 姓名 | 部门职务 | 手机 | 传真 | Email |
|----|------|----|----|-------|
| | | | | |
| | | | | |
| | | | | |

注：1. 请在电子版上填写后签字、盖章；

2. 客户联系人至少填写 2 人，并提供准确、完整的联系方式；

3. 综合清算会员代码为综合清算会员在上海清算所系统中的持有人代码；

4. 客户账号为客户在上海清算所系统中的持有人代码，由 1 位字母+7 位数字构成；

5. 最迟应在客户代理关系生效前 3 个工作日向上海清算所提交备案。

经办人：_____联系电话：_____手机：_____ Email：_____

附表 A-3

标准债券远期清算会员账户信息（变更）登记表

| | | | |
|---|--|-------|--|
| 申请机构全称 | | | |
| 清算会员代码 | | | |
| 资金结算账户 (三选一) | <input type="checkbox"/> 开在大额支付系统的清算账户 <input type="checkbox"/> 与其他业务（_____业务）共用资金结算账户 <input type="checkbox"/> 新开上海清算所的资金结算专户(标准债券远期专用) | | |
| 户名 | | | |
| 行号 | | | |
| 账号 | | | |
| 变更申请信息（仅变更信息时填写） | | | |
| 变更内容 | | | |
| 变更前信息 | | | |
| 变更后信息 | | | |
| 申请机构承诺事项： | | | |
| 1. 我单位保证提供的信息真实、完整、准确； 2. 我单位授权上海清算所在标准债券远期集中清算业务中对我单位上述提供的账户进行自动的借记和贷记处理。 | | | |
| 单位公章： | | 日期： | |
| 经办人 | | 联系电话 | |
| 手机 | | Email | |

填表说明：

1. 资金结算账户请选择“开在大额支付系统的清算账户”、“与其他业务共用资金结算账户”或“新开上海清算所的资金结算专户”其中之一。1) 如选择大额支付系统账户，请填写大额账户的行号、账号、户名。2) 已有资金结算账户的机构可选择与其他业务共用资金结算账户，请填写大额账户的行号、账号、户名。3) 无上海清算所资金结算账户的机构，请选择新开上海清算所的资金结算专户（标准债券远期专用），并填写 A-4《资金结算专户（标准债券远期专用）开户申请表》。
2. 清算会员代码为申请机构在上海清算所系统中的持有人代码，由 1 位字母+7 位数字构成。
3. 如对已提供的账户信息进行变更，请填写“变更申请信息”一栏。

附表 A-4

资金结算专户（标准债券远期专用）开户申请表

| | | | |
|--|---|-----------------|--|
| 申请单位名称 | | | |
| 资金结算专户属性 (单选) | <input type="checkbox"/> 自营业务 <input type="checkbox"/> 代理业务 | | |
| 资金往来账号 | | 资金往来账户 户名 | |
| 资金往来账户开户 行行号 | | 资金往来账户 开户行行名 | |
| 联系人 | | 联系地址 | |
| 联系电话 | | 邮编 | |
| <input type="checkbox"/> 法定代表人 | 姓名 | | |
| <input type="checkbox"/> 单位负责人 | 证件种类 | 证件号码 | |
| <p>我单位申请在上海清算所开立资金结算专户（标准债券远期专用），并作如下授权：</p> <p>授权一：授权上海清算所根据日终清算结果进行直接借记或贷记处理；</p> <p>授权二：授权上海清算所可直接通过我单位资金结算专户（标准债券远期专用）直接扣收我公司因标准债券远期业务产生的清算款项及相关税收、费用等，无须事先通知；承诺该“资金结算专户”为我公司标准债券远期集中清算业务结算资金收款、付款账户，并通过该账户进行结算资金的提取。</p> <p style="text-align: center; margin-top: 20px;">法定代表人或授权代表签章：</p> <p style="text-align: center; margin-top: 20px;">单位公章：</p> <p style="text-align: center; margin-top: 20px;">日期：</p> | | | |

以下栏目由上海清算所审核后填写：

| | | | |
|------------------------|--|------|-------|
| 资金结算专户（标准 债券远期专用）账号 | | 开户日期 | 年 月 日 |
| 资金结算专户（标准 债券远期专用）名称 | | | |
| 经办 | | 复核 | |

填表说明：

1. 本表仅在《账户信息（变更）登记表》中选择使用开在上海清算所的资金结算专户且为新开专用账户时，以及申请综合清算会员时填写。否则，无需填写。
2. “资金结算专户（标准债券远期专用）”是指定作为标准债券远期业务结算资金的收款、付款账户，须为开户单位的实名账户。

附表 A-5

标准债券远期集中清算业务印鉴卡

| | | | |
|---------------|---|----------------------------|--|
| 清算会员全称 | | 清算会员代码 (如有) | |
| 地址 | | 邮编 | |
| 联系人 | | 电话 | |
| 印模：(请清晰居中盖章) | | | |
| 使用范畴 (可多选) | 用于标准债券远期集中清算 <input type="checkbox"/> 自营业务 <input type="checkbox"/> 代理业务 | 共____章，凭业务章____章、私章____章有效 | |
| | | 启用日期：_____年____月____日 | |

送存/更换印鉴通知

现送存/更换标准债券远期集中清算业务的印鉴于印鉴卡上半部分。

新印鉴自_____年____月____日起启用，原印鉴于同日失效。

| | |
|-----------------------|---------------------|
| 开户单位加盖公章 年 月 日 | 原预留印鉴章 年 月 日 |
|-----------------------|---------------------|

填表说明：

1. 本印鉴卡一式四份，提交上海清算所三份，会员单位留存一份；
2. 印模及单位公章请使用印泥加盖，须清晰且不与其他字迹重叠；
3. 首次送存或更换印鉴卡，都应加盖会员单位法人公章。

关于标准债券远期集中清算业务预留印鉴的使用说明

本印鉴卡预留印鉴可用于标准债券远期业务的以下情形：

1. 费用发票重开申请

会员机构收到费用发票后如有特殊需求需重开发票的，需提交加盖预留印鉴章的费用发票重开申请。

2. 客户终端管理员信息变更

会员机构如需变更客户终端管理员信息的，需填写客户终端管理员申请表，通过标记“注销”或“注册”体现要删除的原用户信息或要增加的新用户信息，加盖预留印鉴章后寄至上海清算所。

3. 信息变更

会员机构账户信息、会员信息、清算限额、代理客户信息如发生变更的，需填写相关表单，加盖预留印鉴章后寄至上海清算所。

4. 费用发票寄送信息变更

会员机构费用发票寄送信息如发生变更的，需填写费用发票寄送联系信息表，加盖预留印鉴章后寄至上海清算所，上海清算所收到后自动废止原表。

5. 应急操作流程指引中规定的情形：

- (1) 客户终端无法下载单据需申请单据应急导出；
- (2) 客户终端无法提交保证金提款信息需申请保证金应急提款；
- (3) 客户终端无法进行代理清算确认；
- (4) 客户终端无法进行代理客户保证金明细的维护。

6. 生产专线、CFCA 证书申请

会员机构根据自己需要需再申请生产专线、CFCA 证书用于标准债券远期集中清算业务的，相应的申请材料加盖预留印鉴章后寄至上海清算所。

7. 其他上海清算所认可的情形

会员机构参与标准债券远期集中清算业务需向上海清算所提供其他材料，如经上海清算所认可，相应材料可加盖预留印鉴章后有效。

附表 A-6

法人代表委托授权书

银行间市场清算所股份有限公司：

我单位授权以下人员代表我单位办理标准债券远期集中清算业务相关手续。

授权经办人员 1 姓名：

授权经办人员身份证号码：

授权有效期：_____年_____月_____日至_____年_____月_____日

授权经办人员 2 姓名：

授权经办人员身份证号码：

授权有效期：_____年_____月_____日至_____年_____月_____日

法人代表或授权代表签章：

单位公章：

日期：

(请附授权经办人员身份证复印件)

附：授权经办人员联系方式

| 姓名 | 座机 | 手机 | 传真 | 电邮 |
|----|----|----|----|----|
| | | | | |
| | | | | |

附表 A-7-1

标准债券远期清算会员终端 管理员信息（变更）登记表

清算会员全称：_____

清算会员代码：_____

| | | |
|---|------|--|
| <input type="checkbox"/> 注册 <input type="checkbox"/> 修改 <input type="checkbox"/> 注销 | 姓 名 | |
| | 身份证号 | |
| | 联系电话 | |
| | 手 机 | |
| <input type="checkbox"/> 注册 <input type="checkbox"/> 修改 <input type="checkbox"/> 注销 | 姓 名 | |
| | 身份证号 | |
| | 联系电话 | |
| | 手 机 | |

CFCA 证书串号_____。

单位公章：

日期：

填表说明：

1. 客户终端管理员必须是两人或两人以上，由上海清算所办理注册、注销和修改。

2. “CFCA 证书串号”：请填写以“041”开头的证书串号，例如：
041@712345678-X@shchcs@00000001；具体可咨询陆雯婷：021-23198693。

3. 清算会员代码为清算会员在上海清算所系统中的持有人代码。

4. 上海清算所将根据清算会员申请，为自营业务客户终端管理员分配登录名和初始密码，并通过资格认定通知书告知。

附表 A-7-2

标准债券远期综合清算会员代理业务 会员终端管理员信息（变更）登记表

清算会员全称：_____

清算会员代码：_____

| | | |
|---|------|--|
| <input type="checkbox"/> 注册 <input type="checkbox"/> 修改 <input type="checkbox"/> 注销 | 姓 名 | |
| | 身份证号 | |
| | 联系电话 | |
| | 手 机 | |
| <input type="checkbox"/> 注册 <input type="checkbox"/> 修改 <input type="checkbox"/> 注销 | 姓 名 | |
| | 身份证号 | |
| | 联系电话 | |
| | 手 机 | |

CFCA 证书串号_____。

单位公章：

日期：

填表说明：

1. 客户终端管理员必须是两人或两人以上，由上海清算所办理注册、注销和修改；代理业务客户终端管理员需与自营业务客户终端管理员相分离。

2. “CFCA 证书串号”：请填写以“041”开头的证书串号，例如：
041@712345678-X@shchcs@00000001；具体可咨询陆雯婷：021-23198693。

3. 代理业务可以复用自营业务的 CFCA 证书。

4. 清算会员代码为清算会员在上海清算所系统中的持有人代码，由 1 位字母+7 位数字构成。

5. 上海清算所将根据综合清算会员申请，为代理业务客户终端管理员分配登录名和初始密码，并通过资格认定通知书告知。

附表 A-8-1

标准债券远期清算会员费用发票寄送信息（变更） 登记表

机构全称： _____

| | |
|-----------|---|
| 登记类型 | <input type="checkbox"/> 新增 <input type="checkbox"/> 变更 |
| 发票寄送地址及邮编 | |
| 联系人（主要） | |
| 联系电话 | |
| 电子邮件地址 | |
| 联系人（备份） | |
| 联系电话 | |
| 电子邮件地址 | |

注：1. 关于发票的任何问题我们将直接联系表格中人员；

2. 首次申请请加盖单位公章，申请变更可加盖单位公章或预留印鉴。

机构签章：

日期：

附表 A-8-2

标准债券远期综合清算会员代理业务 费用发票寄送信息（变更）登记表

机构全称： _____

| | |
|-----------|---|
| 登记类型 | <input type="checkbox"/> 新增 <input type="checkbox"/> 变更 |
| 发票寄送地址及邮编 | |
| 联系人（主要） | |
| 联系电话 | |
| 电子邮件地址 | |
| 联系人（备份） | |
| 联系电话 | |
| 电子邮件地址 | |

注：1. 关于发票的任何问题我们将直接联系表格中人员；
2. 首次申请请加盖单位公章，申请变更可加盖单位公章或预留印鉴。

机构签章：

日期：

附表 A-9

标准债券远期清算限额（调整）申请表

| 申报信息 | | | |
|---|---|-------|--|
| 申报机构名称 | | | |
| 清算限额申请量(元) | | | |
| 申请类型 | <input type="checkbox"/> 首次申请限额 <input type="checkbox"/> 申请调整现有限额 | | |
| 申报说明 | | | |
| | | | |
| 申报机构承诺事项： | | | |
| <p>1. 我单位自愿申报银行间市场清算所股份有限公司（以下简称上海清算所）的清算限额，保证提供的所有资料真实、完整、准确；</p> <p>2. 我单位申报之清算限额获得审批后，将严格遵守上海清算所清算限额管理规定及有关业务规则；</p> <p>3. 我单位服从上海清算所清算限额的管理，积极配合清算限额管理工作；</p> <p>4. 有违反上海清算所有关清算限额管理规定的，我单位将承担由此引起的一切后果及法律责任。</p> | | | |
| 机构签章： | | 日期： | |
| 经办人 | | 联系电话 | |
| 手机 | | Email | |

注：首次申请限额请加盖单位公章，申请调整现有限额可加盖单位公章或预留印鉴。

附表 A-10（非上海清算所清算会员适用）

财务数据表（财务公司类）

会员名称：_____

填表时间：_____

填表人：_____

联系方式：_____

| 序号 | 指标 | 20XX 年末/年度数据 |
|----|-----------|--------------|
| 1 | 资本充足率 | |
| 2 | 资产流动性比率 | |
| 3 | 存贷款比例 | |
| 4 | 拆入资金比例 | |
| 5 | 不良贷款比例 | |
| 6 | 拨备率 | |
| 7 | 不良资产率 | |
| 8 | 担保比率 | |
| 9 | 资本收益率 | |
| 10 | 资产收益率 | |
| 11 | 短期投资比例 | |
| 12 | 长期投资比例 | |
| 13 | 实收资本 | |
| 14 | 资产总额 | |
| 15 | 净资产与实收资本比 | |
| 16 | 营业收入 | |
| 17 | 净利润 | |

单位公章：

日期：

填表说明：

- 1.请填写最近一个会计年度数据，并与财务报告的相关数据保持一致；
- 2.比例指标请填写百分比数据，金额指标单位为亿元人民币，小数点后保留两位数；
- 3.如对指标含义有疑问请联系风险管理部 021-23198627，陆轶鸣；
- 4.电子版请发送至 member@shclearing.com。

财务数据表（银行类）

会员名称：_____

填表时间：_____

填表人：_____

联系方式：_____

| 序号 | 指标 | 20XX 年末/年度数据 | | |
|----|-------------|---------------------|---------------------|---------------------|
| 1 | 资本充足率 | | | |
| 2 | 核心资本充足率 | | | |
| 3 | 资本积累率 | | | |
| 4 | 备付金比例 | | | |
| 5 | 人民币超额准备金比例 | | | |
| 6 | 资产流动性指标 | | | |
| 7 | 存贷款比例 | | | |
| 8 | 拆入资金比例 | | | |
| 9 | 不良贷款比例 | | | |
| 10 | 拨备率 | | | |
| 11 | 减值准备贷款比例* | | | |
| 12 | 资本收益率 | | | |
| 13 | 资产收益率 | | | |
| 14 | 成本收入比例 | | | |
| 15 | 注册资本金 | | | |
| 16 | 资产总额 | | | |
| 17 | 净资产 | | | |
| 18 | 营业收入 | | | |
| 19 | 净利润 | | | |
| | 新增指标 | 20XX 年末/年度数据 | 20XX 年末/年度数据 | 20XX 年末/年度数据 |
| 20 | 流动性覆盖率 | | | |
| 21 | 正常类贷款迁徙率 | | | |

| | | | | |
|-------|----------|--|-----|--|
| 22 | 关注类贷款迁徙率 | | | |
| 单位公章： | | | 日期： | |

填表说明：

1.* 减值准备贷款比率=减值贷款准备/拨备前贷款余额；

2.对于新增指标以外的指标，请填写最近会计年度数据，并与财务报告的相关数据保持一致；

3.对于新增指标，请填写最近三个会计年度数据，并与报监管机构口径保持一致；

4.比例指标请填写百分比数据，金额指标单位为亿元人民币，小数点后保留两位数；

5.如对指标含义有疑问请联系风险管理部 021-23198627，陆轶鸣；

6.电子版请发送至 member@shclearing.com。

财务数据表（证券公司类）

会员名称：_____

填表时间：_____

填表人：_____

联系方式：_____

| 序号 | 指标 | 20XX 年末/年度数据 | | |
|----|--------------------|---------------------|---------------------|---------------------|
| | | 20XX 年末/年度数据 | 20XX 年末/年度数据 | 20XX 年末/年度数据 |
| 1 | 净资本与各项风险准备之和的比例 | | | |
| 2 | 净资本比例 | | | |
| 3 | 净资本负债率 | | | |
| 4 | 净资产负债率 | | | |
| 5 | 流动比率 | | | |
| 6 | 风险资产比率 | | | |
| 7 | 不良资产率 | | | |
| 8 | 净资产收益率 | | | |
| 9 | 总资产收益率 | | | |
| 10 | 未分配利润率 | | | |
| 11 | 注册资本金 | | | |
| 12 | 资产总额 | | | |
| 13 | 净资产 | | | |
| 14 | 营业收入 | | | |
| 15 | 净利润 | | | |
| | 新增指标 | 20XX 年末/年度数据 | 20XX 年末/年度数据 | 20XX 年末/年度数据 |
| | | 据 | 据 | |
| 16 | 净资本 | | | |
| 17 | 持有一种权益类证券的成本与净资本比例 | | | |
| 18 | 对单一客户融资规模与净资本的比例 | | | |

| | | | | |
|--|-------------------|--|--|--|
| 19 | 对单一客户融券规模与净资产的比例 | | | |
| 20 | 自营权益类证券及证券衍生品/净资产 | | | |
| 21 | 自营固定收益类证券/净资产 | | | |
| 单位公章： 日期： | | | | |

填表说明：

- 1.对于新增指标以外的指标，请填写最近会计年度的数据，并与财务报告的相关数据保持一致；
- 2.对于新增指标，请填写最近三个会计年度数据，并与报监管机构口径保持一致；
- 3.比例指标请填写百分比数据，金额指标单位为亿元人民币，小数点后保留两位数；
- 4.如对指标含义有疑问请联系风险管理部 021-23198627，陆轶鸣；
- 5.电子版请发送至 member@shclearing.com。

附表 A-11-1

标准债券远期清算会员信息变更报备表

| 变更报备信息 | | | |
|--|--|-------|--|
| 机构名称 | | | |
| 变更项目 | | | |
| 变更前信息 | | | |
| 变更后信息 | | | |
| 变更情况说明 | | | |
| | | | |
| 报备机构承诺事项： | | | |
| 1. 我单位保证提供的所有资料真实、完整、准确； | | | |
| 2. 有违反上海清算所有关标准债券远期清算会员管理规定的，我单位将承担由此引起的一切后果及法律责任。 | | | |
| 机构签章： | | 日期： | |
| 经办人 | | 联系电话 | |
| 手机 | | Email | |

填表说明：

如会员机构发生机构改制、重组、分立、合并等重大资质变更，法人代表、股东、注册资金、清算专员等基本信息或业务信息变更，需在变更后的5个工作日内向上海清算所提交此表及相关资料。

附表 A-11-2

标准债券远期综合清算会员 代理客户信息变更报备表

综合清算会员全称_____

综合清算会员代客业务印鉴

综合清算会员代码_____

| 变更报备信息 | |
|---|---|
| 客户全称 | |
| 客户简称 | |
| 客户账号 | |
| 变更项目 | <input type="checkbox"/> 客户名称 <input type="checkbox"/> 客户清算限额 <input type="checkbox"/> 客户持仓限额 |
| | <input type="checkbox"/> 其他（请在下行注明） |
| 变更前信息 | |
| 变更后信息 | |
| 生效日期 | |
| 变更情况说明 | |
| 注： 1. 请在电子版上填写后打印、盖章； 2. 综合清算会员代码为综合清算会员在上海清算所系统中的持有人代码； 3. 客户账号为客户在上海清算所系统中的持有人代码，由 1 位字母+7 位数字构成； 4. 综合清算会员应提前 3 个工作日向上海清算所报备。 | |

经办人：_____联系电话：_____手机：_____Email：_____

附表 A-12

标准债券远期清算会员资格终止申请表

| 申请机构信息 | | | |
|--|---|-------|--|
| 机构名称 | | | |
| 终止类型 | <input type="checkbox"/> 自营清算业务 <input type="checkbox"/> 代理清算业务 | | |
| 资格批准时间 | | | |
| 终止原因说明 | | | |
| | | | |
| 报备机构承诺事项： | | | |
| <p>1. 我单位自愿申请银行间市场清算所股份有限公司（以下简称上海清算所）的标准债券远期清算会员资格终止，保证提供的所有资料真实、完整、准确；</p> <p>2. 有违反上海清算所有关标准债券远期清算会员管理规定的，我单位将承担由此引起的一切后果及法律责任。</p> | | | |
| 机构签章： | | 日期： | |
| 经办人 | | 联系电话 | |
| 手机 | | Email | |

附表 A-13

标准债券远期综合清算会员代理客户终止报备表

综合清算会员全称_____

综合清算会员代客业务印鉴

综合清算会员代码_____

| 报备机构信息 | | | |
|---------------------------------------|--|-------|--|
| 客户全称 | | | |
| 客户账号 | | | |
| 代理客户生效时间 | | | |
| 代理客户终止生效时间 | | | |
| 终止原因说明 | | | |
| | | | |
| 报备机构承诺事项: | | | |
| 我单位自愿终止与****代理客户关系，保证提供的所有资料真实、完整、准确。 | | | |
| 综合清算会员签章: | | 日期: | |
| 经办人 | | 联系电话 | |
| 手机 | | Email | |

注：1. 客户账号为客户在上海清算所系统中的持有人代码。

2. 综合清算会员至少需在代理客户终止生效日前3个工作日向上海清算所提交本表。

B-1

保证金提取应急指令书

传真指令编号：

银行间市场清算所股份有限公司：

我单位因_____原因，不能正常办理保证金提取业务，故以传真方式发送提款应急指令。请将下述款项从我公司保证金账户转入我公司结算资金专户中。

保证金账户账号：

保证金账户名称：

结算资金专户账号：

结算资金专户名称：

提款金额（大写）：

提款金额（小写）： 元

发送指令方简称：

发送指令方账号：

发送指令方预留印鉴：

发送日期： 年 月 日

确认电话：

确认人：

接收传真号码：

- 注意：1. 传真指令编号：由指令发送方自行编制，当天不重复；
2. 填写必须清晰，不得涂改；
3. 上海清算所接收传真电话：021-63326661。