

附件 2

银行间市场清算所股份有限公司

集中清算业务指南

(标准利率互换部分)

1.1 标准利率互换集中清算业务

1.1.1 标准利率互换要素规定

标准利率衍生产品是指到期日、期限等产品要素标准化的利率远期、互换或期权合约。标准利率互换是标准利率衍生产品的一种，是指在银行间市场交易的，合约期限、结算日等产品要素标准化的利率互换合约。上海清算所为标准利率互换合约提供集中清算服务，初期先行推出挂钩在中国货币网发布的3个月期主要全国性银行同业存单发行利率统计指标的标准利率互换合约，后续交易中心、上海清算所将根据市场需求稳妥拓展至其它标的。

表五：标准利率互换合约要素表

合约品种	3个月同业存单利率互换
合约代码	合约代码由浮动利率名称、合约期限和到期月份组成 PrimeNCD3M _2309、 PrimeNCD3M _2310 PrimeNCD3M _2312、 PrimeNCD3M _2311 PrimeNCD3M _2403 PrimeNCD3M _2406
合约月份	4个季月合约和不在季月循环里的最近2个日历月合约
到期结算日	合约月份的第三个星期三，若非工作日，则调整到下一工作日（D日）
最后交易日	结算日前一个工作日（D-1日）
新合约上市日	前一个合约最后交易日的下一个工作日，D日
最小报价单位	0.0001%（0.01bp）
合约面值	1000万（1手）

报价收益率		为最后交易日（D-1日）PrimeNCD3M的预期值（年化利率），单位：%，精确到0.0001%
浮动利率支付明细	参考利率	PrimeNCD3M
	重置周期	-
	重置日规则	-
	支付周期	期满
	计息周期	计息期首日为结算日的下一个工作日（D+1日），计息期尾日为计息期首日往后3M对应的日历日。
	计息方式	单利
	计息基准	A/A-bond
	利率确定日	D-1日
	参考利率取值	中国人民银行授权交易中心于利率确定日18:00在www.chinamoney.com.cn发布的PrimeNCD3M利率。
到期结算利率		货币网公布的最后交易日的PrimeNCD3M的数值（年化利率）
累计到期结算金额		$(\text{合约到期结算利率} - \text{合约成交价}) * \text{合约面值} * A/A$
挂牌基准利率		合约上市前一营业日交易中心的同业存单（AAA）收盘收益率曲线推算出的对应计息期的远期利率
每日结算利率		<p>1. 取当日最后1小时成交的加权价格，该时段因系统故障等原因导致交易中中断的，扣除中断时间后向前取满相应时段；</p> <p>2. 若最后1小时成交笔数少于5笔，则取当日最后5笔交易的加权价格；</p> <p>3. 若全天该合约成交笔数少于5笔，取最后一小时的（bid的平均+ ofr平均）$\times 0.5$；</p> <p>4. 若无报价或出现其他难以确定结算利率的情况，则可取前一日结算利率（如为合约上市首日，则取挂牌基准利率）或交易中心计算的其他利率。</p>
保证金率		各合约保证金率由上海清算所定期测算并公布。
交易时间		银行间市场交易日9:00-12:00, 13:30-16:30
清算方式		集中清算

结算方式	现金结算
------	------

1.1.2 日间清算处理

表六：标准利率互换业务运营时间表

日期	时间	事项
T 日	9:00	开市
	9:00-16:30	日间数据接收 日间清算处理
	16:30	闭市
	16:30-19:20	日终清算处理
T+1 日	11:00	保证金结算截止 保证金违约判定
	11:10-16:30	保证金提取
结算日 (D 日)	11:00	现金交割

9:00-12:00 及 13:30-16:30, 对交易双方在上海清算所规定的总持仓限额内达成、符合集中清算要求的标准利率互换交易, 上海清算所实时接单, 完成合约替代。

清算系统实时对所有成交数据进行要素合规性检查、风控合规性检查。

本业务代理清算确认均由系统自动完成。

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。

上海清算所以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。

1.1.3 日终清算处理

16:30 清算系统停止接收交易数据。16:30 至 19:20 前，清算系统计算持仓和持仓限额以及盯市损益，计算各清算参与者的保证金要求。

1.1.4 结算处理

1.1.4.1 保证金结算处理

（一）日终保证金交纳

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）。

对于清算会员，系统计算保证金要求与保证金余额进行比较。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。

对于综合清算会员，系统计算其代理的各非清算会员保证金要求总和并与代理保证金余额进行比较。

正常完成扣款和收款的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其代理的非清算会员 T 日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。

（二）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，交纳成功后保证金账户余额应等于或大于保证金要求。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。

上海清算所通过综合清算会员代理保证金账户实现对非清算会员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。

（三）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）。

（四）保证金提取

清算会员根据日终清算单据中的可提取金额，可通过上海清算所标准利率互换集中清算系统会员终端提交保证金提取申请；非清算会员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。

保证金提取指令需在每个工作日完成结算后，至 16:30 闭市前提交。清算会员自营账户日间超限保证金占用当前余额的部分，将相应可在可提取金额中扣减。

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。

1.1.4.2 清算基金操作

清算基金=清算会员自营和代理风险敞口日均值×清算基金比例。

清算基金比例=压力测试结果÷所有会员风险敞口日均值之和。

压力测试结果是指在压力场景下最大两家清算会员同时违约产生的未被其保证金覆盖的额外损失。

会员风险敞口日均值等于前三个月每日日终会员风险敞口的算术平均数。

上海清算所每日进行压力测试，并根据压力测试结果每季测算并调整清算会员的清算基金比例及金额。在执行季度测算和调整期间，为防止出现季度内压力测试结果突增导致风险较大的情况，当压力测试结果测算值达到当前清算基金已缴总额 125%以上时，上海清算所有权对全市场清算基金应缴值进行临时性调整。

1.1.4.3 交割机制

最后交易日日终，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。

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，导致现金交割失败的，上海清算所将按 1.4.4 违约处置相关规定进行处置。

1.1.4.4 违约处置相关规定

违约情形发生时，上海清算所通知违约会员了解情况。根据违约情况采取以下措施中的一种或多种进行违约处理：暂停违约清算会员标准利率互换业务资质；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

置期间的应收资金；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；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；上海清算所认为必要的其他措施等。

若违约清算会员在规定时点前完成相关履约义务，上海清算所恢复违约清算会员标准利率互换业务资质，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》。

若未按时完成相关履约义务，上海清算所可启动对违约清算会员的强行平仓和强制结算处理程序，并有权终止违约清算会员的清算业务资质。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非清算会员发生违规、违约等相关情况，上海清算所可在审核后对未违约的非清算会员进行移仓。

非清算会员发生违约时，上海清算所根据综合清算会员申请，协助其执行对非清算会员的违约处置，包括暂停非清算会员的清算业务资质、对违约非清算会员进行强行平仓和强制结算等。

强行平仓：指上海清算所按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完成相关履约义务的，由上海清算所对其持有的未平仓标准利率互换合约进行强行平仓。

强制结算：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。

违约处置相关未尽事宜详见《银行间市场清算所股份有限公司集中清算业务违约处置指引》。

1.1.5 清算业务相关计算

1.1.5.1 持仓及持仓限额计算

（一）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非清算会员之间不能轧差。

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= $\sum [|\text{合约 } i \text{ 净持仓量}| \times \text{转换系数 } i]$

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。

（二）单一清算参与者总持仓限额

单一清算参与者总持仓限额采用事前控制原则，上海清算所于 T-1 日日终及 T 日日间更新总持仓限额并发送外汇交易中心，作为 T 日交易达成前的限额控制。上海清算所根据清算限额、容忍度、日终持仓数量、保证金当前余额等计算总持仓限额。

清算会员可根据自身业务开展情况向上海清算所自主申请和调整清算限额；非清算会员可根据自身业务开展情况向综合清算会员申请和调整清算限额；综合清算会员应向上海清算所报备非清算会员的清算限额。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。

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非清算会员的容忍度，但其代理的所有非清算会员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代理的非清算会员容忍度，经上海清算所审核通过后生效。

对于自营业务，T-1 日日终上海清算所检查清算会员保证金当前余额，保证金当前余额大于等于 0 的，单一清算参与者总持仓限额= $\text{Max}(\text{清算限额}, \text{T-1 日日终持仓总数}) + [\text{容忍度} + \text{Max}(\text{自营保证金账户当前余额}, 0)] / \text{参考合约保证金率}$ ；保证金当前余额小于 0 的，单一清算参与者总持仓限额= $\text{Min}[\text{Max}(\text{清算限额}, \text{T-1 日日终持仓总数}), \text{前一次计算结果}] + [\text{容忍度} + \text{Max}(\text{自营保证金账户当前余额}, 0)] / \text{参考合约保证金率}$ 。T 日日间，清算会员保证金当前余额如发生变化，上海清算所重新计算总持仓限额，并发送外汇交易中心。

对于代理业务，T-1 日日终上海清算所检查清算会员保证金当前余额，保证金当前余额大于等于 0 的，单一清算参与者总持

仓限额= $\text{Max}(\text{清算限额}, T-1 \text{ 日日终持仓总数}) + (\text{容忍度} / \text{参考合约保证金率})$; 保证金当前余额小于 0 的, 单一清算参与者总持仓限额= $\text{Min}[\text{Max}(\text{清算限额}, T-1 \text{ 日日终持仓总数}), \text{前一次计算结果}] + (\text{容忍度} / \text{参考合约保证金率})$ 。T 日日间 11:00 结算后, 上海清算所重新进行保证金余额检查, 于 12:05 更新总持仓限额, 并发送外汇交易中心。清算会员自营和代理保证金当前余额分开检查。

(三) 单合约全市场单边持仓上限

为控制全市场对单一合约的持仓规模, 降低结算风险, 在标准利率互换业务中设置单合约全市场单边持仓上限控制。

单合约全市场单边持仓上限采用事前控制原则, 作为交易达成前的限额控制。全市场清算参与者对某一合约的单边净持仓总和不能超过单合约全市场单边持仓上限。

(四) 单一清算参与者单合约持仓上限

为控制各机构对于单一合约的持仓规模, 防范头寸集中度风险, 在标准利率互换业务中设置单一清算参与者单合约持仓上限控制。

单一清算参与者单合约持仓上限采用事前控制原则, 作为交易达成前的限额控制。单一清算参与者对某一合约的净持仓不得超过单一清算参与者单合约持仓上限。

1.1.5.2 价格计算

(一) 每日结算利率

根据合约成交时间、成交利率和成交量，按如下方式计算产生每日结算利率：

(1) 取当日最后 1 小时成交的加权价格，该时段因系统故障等原因导致交易中中断的，扣除中断时间后向前取满相应时段；

(2) 若最后 1 小时成交笔数少于 5 笔，则取当日最后 5 笔交易的加权价格；

(3) 若全天该合约成交笔数少于 5 笔，取最后一小时的(bid 的平均+ ofr 平均) $\times 0.5$ ；

(4) 若无报价或出现其他难以确定结算利率的情况，则可取前一日结算利率（如为合约上市首日，则取挂牌基准利率）或交易中心计算的其他利率。

(二) 到期结算利率

对于 3 个月同业存单利率互换，到期结算利率为货币网公布的最后交易日的 PrimeNCD3M 的数值（年化利率）；

(三) 新合约的挂牌基准利率

对于 3 个月同业存单利率互换，新合约的挂牌基准利率为合约上市前一营业日交易中心的同业存单（AAA）收盘收益率曲线推算出的对应计息期的远期利率。

1.1.5.3 盯市损益计算

(一) 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（或代理非清算会员参与

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

$$\begin{aligned} &= \sum_{\text{合约}i} \sum_{\text{交易}j} \left[\text{平前一日持仓量} \right. \\ &\quad \times \left(\text{前一日结算利率}_i - \text{合约成交价}_j \right) \times \text{计息基准} \\ &\quad \times \text{买卖方向系数} \left. \right] \\ &+ \sum_{\text{合约}i} \sum_{\text{平仓交易}j} \sum_{\text{开仓交易}k} \left[\text{平当日开仓量} \right. \\ &\quad \times \left(\text{合约平仓成交价}_j - \text{合约开仓成交价}_k \right) \\ &\quad \times \text{计息基准} \times \text{平仓交易的买卖方向系数} \left. \right] \\ &+ \sum_{\text{合约}i} \sum_{\text{交易}j} \left[\text{当日日间开仓成交量} \right. \\ &\quad \times \left(\text{日间盯市价}_i - \text{合约成交价}_j \right) \times \text{计息基准} \\ &\quad \times \text{买卖方向系数} \left. \right] \\ &+ \sum_{\text{合约}i} \left[\text{前一日未平仓头寸} \right. \\ &\quad \times \left(\text{日间盯市价}_i - \text{前一日结算利率}_i \right) \times \text{计息基准} \\ &\quad \times \text{持仓方向系数} \left. \right] \end{aligned}$$

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。

（二）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。

日终盯市损益

$$\begin{aligned} &= \sum_{\text{合约}i} \sum_{\text{交易}j} \left[\text{平前一日持仓量} \right. \\ &\quad \times \left(\text{前一日结算利率}_i - \text{合约成交价}_j \right) \times \text{计息基准} \\ &\quad \times \text{买卖方向系数} \left. \right] \\ &+ \sum_{\text{合约}i} \sum_{\text{平仓交易}j} \sum_{\text{开仓交易}k} \left[\text{平当日开仓量} \right. \\ &\quad \times \left(\text{合约平仓成交价}_j - \text{合约开仓成交价}_k \right) \\ &\quad \times \text{计息基准} \times \text{平仓交易的买卖方向系数} \left. \right] \\ &+ \sum_{\text{合约}i} \sum_{\text{交易}j} \left[\text{当日日间开仓成交量} \right. \\ &\quad \times \left(\text{当日结算利率}_i - \text{合约成交价}_j \right) \times \text{计息基准} \\ &\quad \times \text{买卖方向系数} \left. \right] \\ &+ \sum_{\text{合约}i} \left[\text{前一日未平仓头寸} \right. \\ &\quad \times \left(\text{当日结算利率}_i - \text{前一日结算利率}_i \right) \times \text{计息基准} \\ &\quad \times \text{持仓方向系数} \left. \right] \end{aligned}$$

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；计算结果为负的，表示当日为盯市亏损。

1.1.5.4 初始保证金

初始保证金包括最低保证金和超限保证金。

（一）最低保证金

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

（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（清算参与者持仓总数-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。

1.1.5.5 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利率互换合约进行逐日盯市和风险监测的结果缴纳的保证金，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

为追缴时的日间盯市亏损，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一工作日结算。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损益的亏损值。

1.1.5.6 特殊保证金

特殊保证金要求由人工触发追缴，日终不自动清零。

1.1.5.7 日终保证金要求计算

日终保证金要求=最低保证金要求+超限保证金要求+日终盯市保证金要求+特殊保证金要求

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

1.1.5.8 交割金额

现金交割金额

$$\begin{aligned} &= \sum_{\text{合约} i} \sum_{\text{交易} j} [\text{最后交易日合约成交量} \times (\text{到期结算利率}_i \\ &\quad - \text{合约成交价}_j) \times \text{计息基准} \times \text{买卖方向系数}] \\ &\quad + \sum_{\text{合约} i} [|\text{前一日日终净持仓}| \times (\text{到期结算利率}_i \\ &\quad - \text{前一日结算利率}_i) \times \text{计息基准} \times \text{持仓方向系数}] \end{aligned}$$

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。

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

1.1.6 业务申请与相关账户开立

标准利率互换参与者沿用利率互换集中清算分层清算体系。利率互换清算会员可申请开展标准利率互换集中清算自营或代理业务，利率互换代理客户及非利率互换集中清算业务参与者可通过综合清算会员代理的方式参与。

清算会员开展业务前通过提交限额申请表确定清算限额并授权扣款路径；非清算会员通过综合清算会员确定清算限额和日间容忍度。使用利率互换集中清算业务印鉴。

对于申请开展自营业务的清算会员，上海清算所为其开立标准利率互换保证金账户，资金结算账户沿用利率互换自营业务的资金结算账户，即开在大额支付系统的清算账户或开立在上海清算所的自营资金结算专户。标准利率互换保证金的扣款路径和提款路径使用利率互换自营业务的资金结算账户。若已有标准利率衍生品清算基金账户的，则标准利率互换清算基金账户沿用标准利率衍生品清算基金账户；若未开立标准利率衍生品清算基金账户的，则新开标准利率衍生品清算基金账户。

对于申请开展代理业务的综合清算会员，上海清算所将为其开立标准利率互换代理保证金账户，代理资金结算账户沿用利率互换代理业务的资金结算账户，即开在大额支付系统的清算账户

或开立在上海清算所的代理资金结算专户。标准利率互换代理保证金的扣款路径和提款路径使用利率互换代理业务的资金结算账户。

银行间市场清算所股份有限公司

标准利率互换集中清算限额申请单（自营）

申请机构全称			
清算会员账号 (7 位)			
一、标准利率互换限额申请			
清算限额			
二、标准利率互换账户及扣款提款路径			
<p>1. 标准利率互换资金结算账户沿用我单位参与人民币利率互换集中清算自营业务所使用的资金结算账户,即开在大额支付系统的清算账户或开在上海清算所的资金结算专户。</p> <p>2. 新开立标准利率互换保证金账户,该账户的扣款路径和提款路径与上述人民币资金结算路径共用。</p> <p>3. 若我单位已开立了标准利率衍生品清算基金账户,则标准利率互换清算基金账户沿用该账户;若尚未开立标准利率衍生品清算基金账户,则请为我单位新开立标准利率衍生品清算基金账户。</p>			
新开立标准利率衍生品清算基金账户,需填写以下提款路径信息:			
三、清算基金提款路径信息			
户名			
行号			
账号			
经办人姓名		经办人联系电话	

说明:

1. 申请机构可根据机构内部分工填写相关联系信息,栏目数量可根据实际情况自行添加;

2. 请加盖单位公章或人民币利率互换集中清算自营业务预留印鉴(双面打印或骑缝章);

3. 咨询电话(电子邮箱)

业务申请: 李昕 021-23198860; lixin@shclearing.com.cn

业务咨询: 戴珺 021-23194847; daijun@shclearing.com.cn

风险管理咨询: 周丽娜 021-23198624; zhoulina@shclearing.com.cn

机构签章:

日期:

银行间市场清算所股份有限公司

标准利率互换集中清算限额申请单（代理）

综合清算会员全称				
综合清算会员账号 (7 位)				
编号	非清算会员 全称	非清算会员账号 (7 位)	清算限额	日间容忍度
1				
2				
3				
.....				
生效日期		(选填, 以实际收到原件为准)		
标准利率互换账户及扣款提款路径				
<p>1. 标准利率互换代理资金结算账户沿用我单位参与人民币利率互换集中清算代理业务所使用的资金结算账户, 即开在大额支付系统的清算账户或开在上海清算所的资金结算专户。</p> <p>2. 新开立标准利率互换代理保证金账户。该账户的扣款路径和提款路径与上述人民币资金结算路径共用。</p>				
综合清算会员 经办人姓名			综合清算会员 经办人联系电话	

说明:

1. 综合清算会员应向上海清算所申请其代理非清算会员的限额, 上表相应栏目数量可根据实际情况自行增减, 不可留空行;
2. 请加盖人民币利率互换集中清算代理业务预留印鉴 (双面打印或骑缝章);
3. 咨询电话 (电子邮箱)

业务申请: 李昕 021-23198860; lixin@shclearing.com.cn

业务咨询：戴珺 021-23194847；daijun@shclearing.com.cn

风险管理咨询：周丽娜 021-23198624；zhoulina@shclearing.com.cn

机构签章：

日期：

全国银行间同业拆借中心
银行间市场清算所股份有限公司
标准利率互换申请单

申请机构全称	(本币交易系统交易账户名称)		
申请机构简称			
综合清算会员全称			
综合清算会员账号 (7 位)			
一、业务主管领导及联系方式			
姓名		部门及职务	
办公室电话		传真	
联系地址		电子邮箱	
二、业务交易人员及联系方式			
姓名		部门及职务	
办公室电话		本币交易员 资格证书编号	
联系地址		电子邮箱	
三、业务清算人员及联系方式			
姓名		部门及职务	
办公室电话		电子邮箱	
<input type="checkbox"/> 是否与综合清算会员完成签署《中央对手方清算业务代理清算协议》			
<input type="checkbox"/> 是否具备相应的风险识别和承担能力，知悉并自行承担投资风险			
<input type="checkbox"/> 是否具有熟悉标准利率互换市场的专业人员、完善的内部制度和系统			
<input type="checkbox"/> 已阅读、理解并同意遵守《全国银行间同业拆借中心标准利率互换交易规则》			

非清算会员 经办人姓名		非清算会员 经办人联系电话	
以下内容由综合清算会员填写：			
四、额度申请			
清算限额			
日间容忍度			
生效日期	(选填，以实际收到原件为准)		
五、账户及扣款提款路径			
<input type="checkbox"/> 标准利率互换代理资金结算账户沿用综合清算会员参与人民币利率互换集中清算代理业务所使用的资金结算账户，即开在大额支付系统的清算账户或开在上海清算所的资金结算专户。			
<input type="checkbox"/> 新开立标准利率互换代理保证金账户。该账户的扣款路径和提款路径与上述人民币资金结算路径共用。			
综合清算会员 经办人姓名		综合清算会员 经办人联系电话	

说明：

1. 申请机构可根据机构内部分工填写相关联系信息，栏目数量可根据实际情况自行添加；
2. 申请机构需加盖单位公章，综合清算会员加盖人民币利率互换集中代理清算业务预留印鉴（双面打印或骑缝章）；
3. 申请单一式两份，分别发送交易中心和上海清算所；
4. 本表内容如有变化，请在发生变更之日起十个工作日内向交易中心和上海清算所变更；
5. 咨询电话（电子邮箱）

交易中心：

贺田子 021-38585725；hetianzi@chinamoney.com.cn

陆夏冰 021-38585321；luxiabing@chinamoney.com.cn

闫 慧 021-38585302；yanhui@chinamoney.com.cn

上海清算所：

业务申请：李昕 021-23198860；lixin@shclearing.com.cn

业务咨询：戴珺 021-23194847；daijun@shclearing.com.cn

风险管理咨询：周丽娜 021-23198624；zhoulina@shclearing.com.cn

6. 交易中心将对参与机构交易情况进行评估，并汇报中国人民银行。

申请机构：（盖章）

综合清算会员代理业务印鉴：（盖

章）

日期：

日期：