

附件 3

3 个月同业存单标准利率互换合约要素

合约名称	3 个月同业存单利率互换
合约标的	3 个月全国性银行同业存单发行利率 (PrimeNCD 3M)
合约代码	PrimeNCD3M _2306
合约面值	1000 万 (1 手)
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
报价收益率	为最后交易日 PrimeNCD3M 的预期值 (年化 利率) 单位: %, 精确到 0.0001%
最小报价单位	0.0001% (0.01bp)
合约计息期首日	到期结算日的下一个营业日
合约计息期尾日	计息期首日往后 3M 对应的日历月。如遇节 假日, 调整为下一个营业日。
计息方式/基准	单利, A/A-bond
结算方式	现金结算
到期结算日	到期月份的第三个周三, D 日

最后交易日	到期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营业日，D 日
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	$(\text{合约到期结算利率} - \text{合约成交价}) * \text{合约面值} * A / A - \text{Bond}$
挂牌基准利率	合约上市前一营业日同业拆借中心同业存单（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）或同业拆借中心计算的其他利率。</p>
涨跌幅	50BP

<p>头寸报告标准</p>	<p>1. 当全市场总持仓达到 2 万手时,单个参与者总持仓占市场总持仓量超过 5%的,应当向交易中心履行报告义务。</p> <p>2. 达到以下标准之一的,交易中心可以要求相关参与者履行报告义务:</p> <p> (1) 参与者总持仓占市场总持仓量超过 20%的。</p> <p> (2) 其他交易中心要求报告的情形。</p>
---------------	--